



CONNOR, CLARK & LUNN

FONDS

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS

31 décembre 2023

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

TABLE DES MATIÈRES

Rapport de l'auditeur indépendant	3
Fonds mondial neutre au marché CC&L II (auparavant, Fonds alternatif d'actions mondiales CC&L)	7
Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)	89
Fonds alternatif de revenu CC&L	165
Fonds de rendement absolu PCJ II	184
Notes annexes	200



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 mondial neutre au marché CC&L II
Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
Fonds alternatif de revenu CC&L
Fonds de rendement absolu PCJ II
(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 2023 et 2022;
- 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 informations significatives sur les 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 2023 et 2022, ainsi que de leur performance financière et de leurs flux de trésorerie pour les exercices clos à cette date, conformément aux normes IFRS de comptabilité.

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.



Fonds mondial neutre au marché CC&L II
Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
Fonds alternatif de revenu CC&L
Fonds de rendement absolu PCJ II
Page 2

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 normes IFRS de comptabilité, 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 mondial neutre au marché CC&L II
Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
Fonds alternatif de revenu CC&L
Fonds de rendement absolu PCJ II
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. N. L. / S. E. N. C. R. L.

Comptables professionnels agréés

Vancouver (Canada)

Le 22 mars 2024

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

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2023	2022
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	9 509 310 \$	3 521 869 \$
Placements	29 310 342	26 093 492
Plus-value latente des contrats de change à terme	664 638	26 488
Plus-value latente des contrats de swap	410 450	335 931
Marge de variation quotidienne	3 682 841	1 669 874
Montant à recevoir du courtier	1 221 163	1 244 620
Dividendes à recevoir	23 436	34 215
Autres créances	–	264
Souscriptions à recevoir	26 822	–
	44 849 002	32 926 753
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	–	3 261 019
Placements vendus à découvert	18 458 428	7 238 990
Moins-value latente des contrats de change à terme	85 685	2 663
Moins-value latente des contrats de swap	1 036 133	380 013
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	23 066	9 685
Montant à payer au courtier	1 525 979	1 168 917
Frais d'emprunt de titres à payer	11 148	8 523
Charges à payer	60 564	63 129
Frais de gestion à payer	9 088	1 370
Rémunération au rendement à payer	68 175	6 944
Rachats à payer	–	2 400
	21 278 266	12 143 653
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23 570 736 \$	20 783 100 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	417 870 \$	146 875 \$
Série F	11 663 995 \$	1 930 574 \$
Série I	11 488 871 \$	18 705 651 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	37 609	14 220
Série F	1 044 406	187 498
Série I	1 018 642	1 833 972
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	11,11 \$	10,33 \$
Série F	11,17 \$	10,30 \$
Série I	11,28 \$	10,20 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

« Tim Elliott »

Administrateur

Administrateur

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

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(213 033) \$	9 504 \$
Variation du gain (perte) de change latent	(220 853)	(31 882)
Charges d'intérêts négatives	—	(64 214)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	3 446	1 740
Autres revenus (pertes)	7 475	504
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	542 763	633 926
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(316 723)	(148 872)
Intérêts aux fins des distributions	378 551	30 523
Gain (perte) net réalisé sur les placements	2 450 196	(788 495)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(305 444)	1 027 770
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	205 430	(39 614)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(123 084)	137 250
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(232 779)	233 745
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	2 013 520	(3 519 089)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(1 509 356)	332 862
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	555 128	25 720
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	(581 601)	(147 555)
Gain (perte) net total sur placements	<u>3 076 601</u>	<u>(2 221 829)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>2 653 636</u>	<u>(2 306 177)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	25 583	32 167
Honoraires des dépositaires	82 995	90 618
Frais de dépôt	19 047	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 464	4 711
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	578	642
Charges d'intérêts	197 167	12 120
Frais de gestion	60 380	19 772
Rémunération au rendement	82 607	15 185
Honoraires de professionnels	9 338	8 509
Coût d'emprunt de titres	129 750	112 804
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	15 264	8 528
Coûts de transaction (note 9)	54 745	53 834
Total des charges d'exploitation	<u>681 918</u>	<u>381 141</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(74 337)</u>	<u>(82 698)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>1 897 381 \$</u>	<u>(2 770 016) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	19 015 \$	(19 166) \$
Série F	394 293 \$	(405 255) \$
Série I	1 484 073 \$	(2 345 595) \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	24 810	13 653
Série F	529 208	290 773
Série I	1 202 715	1 744 979
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,77 \$	(1,40) \$
Série F	0,75 \$	(1,39) \$
Série I	1,23 \$	(1,34) \$
	<hr/>	<hr/>

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

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

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	146 875 \$	164 703 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	19 015	(19 166)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	277 780	15 000
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	7 708
Rachat de parts rachetables	(25 800)	(13 662)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	251 980	9 046
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	–	(7 708)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	(7 708)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	270 995	(17 828)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	417 870 \$	146 875 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	1 930 574 \$	3 922 852 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	394 293	(405 255)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	10 965 080	242 732
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	101 962
Rachat de parts rachetables	(1 625 952)	(1 829 755)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	9 339 128	(1 485 061)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	–	(101 962)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	(101 962)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	9 733 421	(1 992 278)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	11 663 995 \$	1 930 574 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

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

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	18 705 651 \$	24 130 695 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 484 073	(2 345 595)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	–	590
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	1 399 181
Rachat de parts rachetables	(8 700 853)	(3 080 039)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(8 700 853)	(1 680 268)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	–	(1 399 181)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	(1 399 181)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(7 216 780)	(5 425 044)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	11 488 871 \$	18 705 651 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	20 783 100 \$	28 218 250 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 897 381	(2 770 016)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	11 242 860	258 322
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	1 508 851
Rachat de parts rachetables	(10 352 605)	(4 923 456)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	890 255	(3 156 283)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	–	(1 508 851)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	(1 508 851)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	2 787 636	(7 435 150)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	23 570 736 \$	20 783 100 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 897 381 \$	(2 770 016) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	220 853	31 882
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(2 450 196)	788 495
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	305 444	(1 027 770)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(2 013 520)	3 519 089
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	1 509 356	(332 862)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(555 128)	(25 720)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	581 601	147 555
Achat de placements	(135 481 981)	(111 393 538)
Produit de la vente de placements	146 514 004	117 116 848
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(2 012 967)	712 024
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	10 779	9 412
(Augmentation) diminution des autres créances	264	(264)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	2 625	2 888
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	13 381	2 192
Augmentation (diminution) des charges à payer	(2 565)	20 168
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	7 718	(612)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	61 231	(10 402)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	8 608 280	6 789 369
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	11 216 038	248 991
Rachat de parts rachetables**	(10 355 005)	(4 911 725)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	861 033	(4 662 734)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	9 469 313	2 126 635
Variation du gain (perte) de change latent	(220 853)	(31 882)
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	3 521 869	551 929
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(3 261 019)	(2 385 832)
	9 509 310	260 850
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	9 509 310 \$	3 521 869 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	– \$	4(3 261 019) \$
	9 509 310 \$	260 850 \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	479 512 \$	560 794 \$
Dividendes payés*	(303 342)	(146 680)
Intérêts reçus*	378 551	30 523
Intérêts payés*	(197 167)	(12 120)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 1,95 %)				
Athabasca Oil Corp.	5 300	10 575	22 101	
Baytex Energy Corp.	1 900	11 386	8 322	
Corporation Cameco, TSE	1 500	80 641	85 695	
Canadian Natural Resources Ltd.	500	42 452	43 405	
Cardinal Energy Ltd.	3 400	15 759	21 352	
Cenovus Energy Inc.	4 600	124 856	101 589	
Crew Energy Inc.	800	3 396	3 632	
Ensign Energy Services Inc.	400	1 194	868	
Gear Energy Ltd.	800	952	512	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	200	15 744	15 096	
Parex Resources Inc.	2 200	35 201	54 890	
Suncor Énergie Inc.	2 700	122 057	114 615	
Corporation TC Énergie, TSE	700	34 803	36 232	
Tourmaline Oil Corp.	1 200	77 329	71 508	
Whitecap Resources Inc.	4 200	31 354	37 254	
Yangarra Resources Ltd.	600	1 667	768	
		609 366	617 839	2,63
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,84 %)				
Aris Mining Corp.	1 000	5 723	4 370	
Cascades inc.	600	8 028	7 638	
Centerra Gold Inc.	3 400	31 785	26 894	
First Quantum Minerals Ltd.	5 200	65 221	56 420	
Interfor Corp.	1 000	30 884	23 480	
Ivanhoe Mines Ltd.	1 200	14 838	15 420	
Neo Performance Materials Inc.	300	2 840	2 289	
New Gold Inc.	2 600	4 473	4 992	
OceanaGold Corp.	6 985	15 809	17 742	
Orezone Gold Corp.	700	928	595	
Minière Osisko Inc.	800	3 074	2 136	
Pan American Silver Corp.	800	16 720	17 304	
Silvercorp Metals Inc.	500	2 376	1 725	
Taseko Mines Ltd.	801	872	1 490	
		203 571	182 495	0,77
Industries (31 décembre 2022 : 1,71 %)				
Air Canada	800	14 433	14 952	
ATS Corp.	1 200	54 804	68 532	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, TSE	500	50 967	52 420	
Civeo Corp.	31	697	934	
Dexterra Group Inc.	100	355	576	
Doman Building Materials Group Ltd.	400	2 706	3 316	
Magellan Aerospace Corp.	200	1 563	1 570	
Corporation Internationale Masonite	19	2 103	2 121	
Thomson Reuters Corp.	196	35 117	37 971	
		162 745	182 392	0,77
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 0,26 %)				
Les Industries Dorel Inc., cat B	300	2 976	1 875	
Martinrea International Inc.	300	2 542	4 302	
Roots Corp.	200	586	500	
		6 104	6 677	0,03
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,30 %)				
Soins de santé (31 décembre 2022 : 0,11 %)				
Andlauer Healthcare Group Inc.	100	4 726	4 098	
Sienna Senior Living Inc.	937	13 861	10 766	
		18 587	14 864	0,06
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,45 %)				
La Banque de Nouvelle-Écosse	100	6 235	6 450	
Brookfield Corp.	400	20 856	21 260	
Groupe Canaccord Genuity Inc.	100	803	760	
CI Financial Corp.	2 500	58 478	37 150	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Power Corporation du Canada	300	11 339	11 367	
		97 711	76 987	0,33
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 0,71 %)				
Celestica Inc.	100	3 960	3 881	
Quarterhill Inc.	300	441	585	
Shopify Inc.	700	49 095	72 212	
		53 496	76 678	0,33
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,67 %)				
Aimia Inc.	300	1 120	939	
Corus Entertainment Inc.	4 200	21 362	2 982	
Illumin Holdings Inc.	1 300	2 810	2 067	
Lions Gate Entertainment Corp., cat. A	183	2 055	2 630	
Lions Gate Entertainment Corp., cat. B	151	1 436	2 029	
Québecor inc.	200	6 422	6 304	
Telesat Corp.	211	5 276	2 902	
		40 481	19 853	0,08
Services publics (31 décembre 2022 : 0,72 %)				
Boralex Inc.	200	7 160	6 736	
Brookfield Infrastructure Corp.	200	7 744	7 628	
Emera Inc.	200	10 790	10 060	
Fortis Inc.	2 200	121 359	119 922	
Northland Power Inc.	2 600	71 907	62 582	
Polaris Renewable Energy Inc.	100	1 831	1 323	
Superior Plus Corp.	300	3 498	2 889	
		224 289	211 140	0,90
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,93 %)				
Allied Properties REIT	100	2 207	2 018	
Groupe Altus limitée	340	21 080	14 328	
FPI Granite	900	77 318	68 652	
InterRent REIT	700	8 962	9 261	
Killam Apartment REIT	900	18 439	16 164	
Minto Apartment REIT	100	1 462	1 618	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	200	3 253	2 954	
		132 721	114 995	0,49
Total des actions canadiennes – position acheteur		1 549 071	1 503 920	6,39
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,54 %)				
Canacol Energy Ltd.	(619)	(7 677)	(4 308)	
Crescent Point Energy Corp.	(3 000)	(28 196)	(27 570)	
Denison Mines Corp.	(36 200)	(68 080)	(83 984)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(9 631)	(76 686)	(91 309)	
Energy Fuels Inc., TSE	(2 300)	(22 976)	(21 850)	
Gibson Energy Inc.	(200)	(4 362)	(4 026)	
Headwater Exploration Inc.	(200)	(1 290)	(1 250)	
North American Construction Group Ltd.	(500)	(7 275)	(13 825)	
Pason Systems Inc.	(1 300)	(8 389)	(21 021)	
Shawcor Ltée	(2 000)	(10 485)	(30 320)	
Spartan Delta Corp.	(100)	(313)	(301)	
Tamarack Valley Energy Ltd.	(900)	(2 900)	(2 763)	
Total Energy Services Inc.	(300)	(2 246)	(2 268)	
Ur-Energy Inc.	(4 800)	(5 933)	(9 696)	
Vermilion Energy Inc.	(5 400)	(99 532)	(86 241)	
		(346 340)	(400 732)	(1,70)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,75 %)				
Algoma Steel Group Inc.	(800)	(7 843)	(10 640)	
Americas Gold & Silver Corp.	(5 500)	(16 723)	(1 815)	
Canfor Pulp Products Inc.	(500)	(4 627)	(900)	
Endeavour Silver Corp.	(100)	(277)	(260)	
Equinox Gold Corp.	(4 100)	(25 677)	(26 404)	
ERO Copper Corp.	(100)	(2 188)	(2 095)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Fortuna Silver Mines Inc.	(4 900)	(24 798)	(24 990)	
Galiano Gold Inc.	(1 800)	(1 589)	(2 214)	
Global Atomic Corp.	(200)	(483)	(556)	
I-80 Gold Corp.	(200)	(417)	(466)	
Largo Inc.	(2 100)	(14 477)	(6 405)	
Lithium Americas Argentina Corp.	(5 000)	(45 208)	(41 750)	
MAG Silver Corp.	(1 300)	(21 350)	(17 927)	
Nevada Copper Corp.	(500)	(377)	(65)	
Northern Dynasty Minerals Ltd.	(23 800)	(24 164)	(10 234)	
Novagold Resources Inc.	(2 900)	(17 783)	(14 355)	
Orla Mining Ltd.	(3 400)	(15 041)	(14 688)	
Seabridge Gold Inc.	(600)	(9 277)	(9 636)	
SilverCrest Metals Inc.	(2 424)	(19 590)	(21 065)	
Skeena Resources Ltd.	(1 800)	(13 712)	(11 610)	
Stelco Holdings Inc.	(100)	(5 351)	(5 019)	
Triple Flag Precious Metals Corp.	(300)	(5 381)	(5 292)	
		(276 333)	(228 386)	(0,97)
Industries (31 décembre 2022 : -0,67 %)				
Ballard Power Systems Inc.	(3 200)	(19 903)	(15 712)	
CAE inc.	(5 100)	(151 850)	(145 860)	
Chorus Aviation Inc.	(6 000)	(19 039)	(15 360)	
GFL Environmental Inc., TSE	(3 800)	(158 171)	(173 698)	
K-Bro Linen Inc.	(100)	(3 748)	(3 300)	
La Compagnie Électrique Lion	(5 100)	(13 852)	(12 036)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 398)	(8 963)	(1 031)	
Corporation Savaria	(400)	(5 808)	(6 068)	
TELUS International CDA Inc.	(800)	(9 974)	(9 104)	
Xebec Adsorption Inc.	(1 500)	(4 106)	(574)	
		(395 414)	(382 743)	(1,62)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,77 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(400)	(2 378)	(2 712)	
Canada Goose Holdings Inc	(3 500)	(68 430)	(55 090)	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc., TSE	(800)	(31 512)	(35 056)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(600)	(30 745)	(33 906)	
Pet Valu Holdings Ltd.	(600)	(16 763)	(17 268)	
Pollard Banknote Ltd.	(100)	(1 804)	(3 203)	
		(151 632)	(147 235)	(0,62)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,41 %)				
Neighbourly Pharmacy Inc.	(100)	(1 490)	(1 679)	
SunOpta Inc.	(4 400)	(29 239)	(31 812)	
		(30 729)	(33 491)	(0,14)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,70 %)				
Aurora Cannabis Inc.	(48 700)	(43 291)	(31 655)	
Bausch Health Cos Inc.	(6 900)	(74 219)	(73 347)	
Cannabist Co Holdings Inc.	(3 500)	(1 722)	(2 030)	
CannTrust Holdings Inc.	(1 600)	(4 665)	-	
Canopy Growth Corp.	(4 506)	(36 070)	(30 461)	
Cronos Group Inc.	(15 500)	(70 227)	(42 935)	
HLS Therapeutics Inc.	(100)	(1 007)	(395)	
Thérapeutique Knight Inc.	(3 400)	(16 974)	(17 646)	
Oncolytics Biotech Inc.	(1 400)	(3 165)	(2 506)	
Organigram Holdings Inc., TSE	(3 025)	(8 361)	(5 203)	
SNDL Inc.	(30 233)	(98 000)	(65 379)	
Well Health Technologies Corp.	(1 000)	(5 182)	(3 850)	
		(362 883)	(275 407)	(1,17)
Services financiers (31 décembre 2022 : -0,10 %)				
ECN Capital Corp.	(2 305)	(5 396)	(6 915)	
Corporation Nuvei	(1 400)	(31 505)	(48 734)	
		(36 901)	(55 649)	(0,24)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -0,42 %)				
Blackberry Ltd.	(800)	(4 175)	(3 760)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Canadian Solar Inc.	(107)	(2 999)	(3 701)	
Computer Modelling Group Ltd.	(2 600)	(15 464)	(26 338)	
Converge Technology Solutions Corp.	(1 600)	(7 146)	(6 624)	
Dye & Durham Ltd.	(1 100)	(17 374)	(15 796)	
Lightspeed Commerce Inc.	(6 200)	(139 622)	(172 484)	
Softchoice Corp.	(300)	(5 153)	(4 620)	
		(191 933)	(233 323)	(0,99)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,39 %)				
IMAX Corp.	(730)	(16 520)	(14 458)	
Groupe Stingray Inc.	(398)	(2 154)	(2 412)	
WildBrain Ltd.	(2 200)	(5 252)	(2 398)	
		(23 926)	(19 268)	(0,08)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,19 %)				
Fiducie d'impact Dream	(450)	(6 336)	(2 768)	
DREAM Unlimited Corp.	(500)	(11 350)	(11 325)	
European Residential REIT	(1 100)	(3 813)	(2 838)	
Morguard REIT	(100)	(553)	(534)	
NorthWest Healthcare Properties REIT	(100)	(398)	(516)	
Tricon Residential Inc	(2 100)	(21 899)	(25 326)	
True North Commercial REIT	(138)	(2 402)	(1 387)	
		(46 751)	(44 694)	(0,19)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(1 862 842)	(1 820 928)	(7,72)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 5,56 %)				
Amplify Energy Corp.	93	903	727	
Antero Midstream Corp.	3 006	44 648	49 665	
Baker Hughes Co.	3 921	161 401	176 719	
Berry Corp.	333	2 987	3 087	
Chesapeake Energy Corp.	633	65 018	64 220	
Chevron Corp.	300	59 245	59 005	
Civitas Resources Inc.	14	1 273	1 262	
CNX Resources Corp.	644	18 012	16 984	
Comstock Resources Inc.	1 113	17 891	12 988	
Diamond Offshore Drilling Inc.	276	4 539	4 731	
Diamondback Energy Inc.	96	20 296	19 631	
DT Midstream Inc.	114	8 233	8 238	
Equitrans Midstream Corp.	135	1 683	1 812	
Exxon Mobil Corp.	1 689	226 676	222 667	
FutureFuel Corp.	177	1 918	1 419	
Gran Tierra Energy Inc., NYSE	104	437	773	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	330	6 761	2 455	
Green Plains Inc.	438	15 608	14 566	
Helix Energy Solutions Group Inc.	1 869	22 040	25 335	
Hess Midstream LP	194	8 143	8 091	
Mammoth Energy Services Inc.	259	1 721	1 523	
Marathon Petroleum Corp.	102	20 549	19 954	
Murphy Oil Corp.	218	11 621	12 263	
Oil States International Inc.	562	5 386	5 032	
Overseas Shipholding Group Inc.	74	514	514	
Peabody Energy Corp.	244	7 878	7 825	
PHX Minerals Inc.	649	2 992	2 756	
REX American Resources Corp.	28	1 781	1 746	
SM Energy Co.	662	26 026	33 799	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	107	1 497	1 123	
Uranium Energy Corp.	2 046	14 506	17 266	
Valero Energy Corp.	795	136 613	136 277	
Williams Cos Inc.	919	43 174	42 207	
		961 970	976 660	4,14
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,27 %)				
Air Products and Chemicals Inc.	15	5 417	5 415	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ashland Inc.	499	54 595	55 474	
Coronado Global Resources Inc.	1 724	2 770	2 730	
Freeport-McMoRan Inc.	111	6 277	6 231	
Graphic Packaging Holding Co.	1 519	45 861	49 373	
HB Fuller Co.	118	11 121	12 667	
Hecla Mining Co.	1 198	8 445	7 598	
Ingevity Corp.	66	3 739	4 109	
Louisiana-Pacific Corp.	232	17 773	21 668	
McEwen Mining Inc., TSE	30	343	286	
Newmont Corp.	1 200	62 116	65 820	
Nucor Corp.	125	29 226	28 686	
O-I Glass Inc.	727	16 102	15 702	
Olin Corp.	238	16 805	16 931	
Origin Materials Inc.	1 115	1 054	1 229	
PPG Industries Inc.	15	2 986	2 958	
Ramaco Resources Inc.	684	14 326	15 495	
RPM International Inc.	23	3 406	3 385	
Ryerson Holding Corp.	17	803	777	
Scotts Miracle-Gro Co.	18	1 532	1 513	
Sealed Air Corp.	72	3 474	3 467	
Sensient Technologies Corp.	155	12 122	13 489	
Steel Dynamics Inc.	53	8 569	8 254	
SunCoke Energy Inc.	185	2 376	2 620	
Tredegar Corp.	535	3 891	3 816	
Warrior Met Coal Inc.	67	5 428	5 386	
		340 557	355 079	1,51
Industries (31 décembre 2022 : 4,04 %)				
AAON Inc.	58	5 046	5 649	
Acuity Brands Inc.	139	30 403	37 542	
AGCO Corp.	88	13 989	14 088	
Air Lease Corp.	71	3 716	3 926	
Alaska Air Group Inc.	482	24 726	24 832	
Allient Inc.	7	319	279	
Alta Equipment Group Inc.	43	871	701	
American Superconductor Corp.	228	2 835	3 349	
Apogee Enterprises Inc.	27	1 496	1 902	
Astronics Corp.	293	5 100	6 730	
Axon Enterprise Inc.	181	49 908	61 655	
AZEK Co Inc.	220	9 365	11 096	
Barnes Group Inc.	204	6 430	8 777	
BGSF Inc.	18	358	223	
Blade Air Mobility Inc.	181	871	842	
Bloom Energy Corp.	1 416	26 697	27 634	
Blue Bird Corp.	184	5 496	6 541	
Boise Cascade Co.	42	6 292	7 164	
BrightView Holdings Inc.	50	367	555	
Builders FirstSource Inc.	158	34 550	34 780	
CECO Environmental Corp.	38	961	1 016	
CH Robinson Worldwide Inc.	466	59 105	53 084	
Comfort Systems USA Inc.	119	26 293	32 272	
Commercial Vehicle Group Inc.	67	669	619	
CSG Systems International Inc.	64	4 383	4 490	
Cummins Inc.	20	6 336	6 318	
Driven Brands Holdings Inc.	107	1 832	2 012	
Ducommun Inc.	25	1 536	1 716	
DXP Enterprises Inc.	24	1 148	1 066	
Eastern Co.	40	1 155	1 160	
EMCOR Group Inc.	246	56 769	69 880	
Encore Wire Corp.	89	20 239	25 067	
Ennis Inc.	93	2 655	2 687	
Enviri Corp.	845	6 247	10 028	
Exponent Inc.	1	124	116	
Franklin Electric Co Inc.	67	8 187	8 539	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Frontier Group Holdings Inc.	1 236	16 064	8 899	
Generac Holdings Inc.	123	17 097	20 961	
Gorman-Rupp Co.	197	7 032	9 229	
GXO Logistics Inc.	1	64	81	
H&E Equipment Services Inc.	47	2 623	3 242	
Healthcare Services Group Inc.	83	1 117	1 135	
HEICO Corp.	114	25 841	26 888	
Hertz Global Holdings Inc.	1 423	16 789	19 495	
HNI Corp.	361	18 162	19 912	
Hubbell Inc.	63	24 108	27 325	
Hudson Technologies Inc.	228	3 729	4 056	
Huron Consulting Group Inc.	13	1 633	1 762	
John Bean Technologies Corp.	11	1 509	1 442	
Kaman Corp.	169	5 277	5 337	
Kennametal Inc.	917	32 939	31 184	
LSI Industries Inc.	370	6 370	6 869	
Lyft Inc.	4 199	64 116	82 997	
Manitowoc Co Inc.	16	353	352	
MasTec Inc.	224	16 858	22 365	
Masterbrand Inc.	997	11 799	19 522	
McGrath RentCorp	51	6 277	8 044	
MillerKnoll Inc.	773	17 368	27 194	
Mistras Group Inc.	136	1 027	1 313	
Mueller Industries Inc.	30	1 856	1 865	
NL Industries Inc.	130	1 114	962	
Norfolk Southern Corp.	10	3 104	3 117	
Northrop Grumman Corp.	28	17 340	17 284	
OPENLANE Inc.	1 060	21 541	20 700	
Paycom Software Inc.	88	21 933	23 987	
Powell Industries Inc.	14	935	1 632	
Proto Labs Inc.	13	681	668	
Quad/Graphics Inc.	673	2 927	4 810	
RBC Bearings Inc.	47	14 302	17 656	
Republic Services Inc.	37	8 066	8 046	
Snap-on Inc.	4	1 526	1 523	
Southwest Airlines Co.	1 772	61 592	67 480	
Steelcase Inc.	447	6 309	7 969	
Sterling Infrastructure Inc.	507	39 443	58 784	
SunPower Corp.	2 441	35 415	15 546	
Tennant Co.	19	2 275	2 322	
Terex Corp.	240	15 994	18 184	
Tetra Tech Inc.	130	27 975	28 615	
Triumph Group Inc.	960	15 256	20 988	
Tutor Perini Corp.	41	363	492	
Uber Technologies Inc.	1 932	143 727	156 852	
United Parcel Service Inc., cat. B	521	108 953	108 016	
Upwork Inc.	1 847	34 998	36 215	
V2X Inc.	25	1 449	1 531	
Vicor Corp.	71	3 746	4 207	
Wabash National Corp.	381	12 132	12 871	
Watsco Inc.	90	42 275	50 848	
Willis Lease Finance Corp.	29	777	1 869	
Xylem Inc.	14	2 076	2 111	
		1 374 706	1 525 089	6,47
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 6,99 %)				
2U Inc.	331	488	537	
ADT Inc.	1 078	10 681	9 694	
Airbnb Inc.	244	43 565	43 801	
Allbirds Inc.	821	1 983	1 326	
Amazon.com Inc.	80	16 084	16 028	
American Eagle Outfitters Inc.	276	7 667	7 701	
Aramark	1 144	42 382	42 388	
Arhaus Inc.	150	1 771	2 344	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Asbury Automotive Group Inc.	36	10 830	10 679	
AutoNation Inc.	203	40 161	40 200	
Beazer Homes USA Inc.	360	5 606	16 040	
Best Buy Co Inc.	299	30 501	30 863	
Big Lots Inc.	170	1 453	1 746	
Boot Barn Holdings Inc.	350	35 741	35 426	
BorgWarner Inc.	417	19 894	19 712	
Boyd Gaming Corp.	199	16 187	16 429	
Bright Horizons Family Solutions Inc.	77	9 399	9 568	
Build-A-Bear Workshop Inc.	104	3 340	3 153	
Caesars Entertainment Inc.	239	14 279	14 774	
CarMax Inc.	2 077	206 861	210 170	
Carrols Restaurant Group Inc.	272	741	2 826	
Chegg Inc.	832	15 378	12 463	
China Automotive Systems Inc.	3 610	23 146	15 375	
Columbia Sportswear Co.	9	915	944	
Coursera Inc.	130	3 497	3 320	
Dana Inc.	842	16 718	16 221	
Dave & Buster's Entertainment Inc.	487	24 798	34 580	
Dine Brands Global Inc.	81	7 125	5 303	
DoorDash Inc.	1 311	148 304	170 950	
DR Horton Inc.	496	80 690	99 399	
DraftKings Inc.	2 890	140 820	134 329	
Dream Finders Homes Inc.	304	10 894	14 242	
eBay Inc.	792	43 593	45 554	
El Pollo Loco Holdings Inc.	125	1 972	1 454	
Ethan Allen Interiors Inc.	33	1 386	1 389	
Etsy Inc.	936	99 683	100 033	
Everi Holdings Inc.	324	4 719	4 815	
Foot Locker Inc.	1 060	38 154	43 539	
Fox Factory Holding Corp.	43	3 733	3 826	
Frontdoor Inc.	48	2 239	2 229	
General Motors Co.	4 628	197 181	219 201	
Graham Holdings Co.	3	2 341	2 755	
Green Brick Partners Inc.	28	1 056	1 918	
Guess? Inc.	415	12 629	12 619	
Hanesbrands Inc.	2 340	18 493	13 761	
Harley-Davidson Inc.	1 203	52 168	58 438	
Hovnanian Enterprises Inc.	3	604	616	
Installed Building Products Inc.	41	7 549	9 884	
JAKKS Pacific Inc.	71	2 330	3 328	
Kandi Technologies Group Inc.	6 579	27 826	24 290	
Kohl's Corp.	537	19 623	20 308	
Landsea Homes Corp.	421	4 450	7 294	
LGI Homes Inc.	31	5 351	5 443	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	101	1 231	1 501	
Lithia Motors Inc.	36	11 104	15 631	
Lovesac Co.	19	741	640	
Macy's Inc.	2 777	50 431	73 674	
Malibu Boats Inc.	17	1 299	1 229	
MasterCraft Boat Holdings Inc.	19	754	567	
MDC Holdings Inc.	35	2 506	2 550	
MGM Resorts International	191	10 938	11 253	
Newell Brands Inc.	2 199	25 499	25 169	
Nordstrom Inc.	1 909	41 436	46 442	
Oxford Industries Inc.	10	1 274	1 319	
Papa John's International Inc.	132	12 617	13 268	
Peloton Interactive Inc.	5 134	49 797	41 227	
Penn Entertainment Inc.	287	9 815	9 847	
Penske Automotive Group Inc.	39	8 553	8 254	
Perdoceo Education Corp.	538	12 190	12 457	
Petco Health & Wellness Co Inc.	3 054	15 495	12 725	
Polaris Inc.	521	76 811	65 106	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Potbelly Corp.	389	5 498	5 345	
Qurate Retail Inc.	1 562	7 449	1 803	
Revolve Group Inc.	62	1 178	1 355	
RH	135	47 900	51 887	
Rush Street Interactive Inc.	210	1 189	1 243	
Sally Beauty Holdings Inc.	490	5 921	8 580	
Sonos Inc.	2 006	41 891	45 337	
Standard Motor Products Inc.	53	2 558	2 782	
Steven Madden Ltd.	278	12 440	15 396	
Tapestry Inc.	761	32 544	36 937	
Topgolf Callaway Brands Corp.	90	1 715	1 702	
Travel + Leisure Co.	100	5 090	5 154	
Tri Pointe Homes Inc.	348	15 434	16 244	
Universal Technical Institute Inc.	259	3 051	4 276	
Upbound Group Inc.	126	5 703	5 644	
Vacasa Inc.	9	417	97	
Vail Resorts Inc.	18	5 586	5 067	
Vera Bradley Inc.	75	762	761	
Wayfair Inc.	1 311	103 934	106 660	
Wolverine World Wide Inc.	62	778	727	
Wynn Resorts Ltd.	121	13 698	14 537	
Xponential Fitness Inc.	258	3 683	4 385	
		2 189 889	2 304 003	9,78
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 5,22 %)				
Altria Group Inc.	1 144	63 841	60 852	
Boston Beer Co Inc.	38	17 569	17 316	
Central Garden & Pet Co., NAS	22	1 260	1 278	
Darling Ingredients Inc.	64	4 245	4 206	
Elf Beauty Inc.	159	18 675	30 262	
Energizer Holdings Inc.	310	13 288	12 950	
Estée Lauder Cos Inc.	906	209 307	174 718	
Hershey Co.	187	48 734	45 972	
Ingles Markets Inc.	65	7 840	7 403	
LifeMD Inc.	251	1 852	2 744	
National Beverage Corp.	40	2 833	2 622	
Nu Skin Enterprises Inc.	505	19 122	12 932	
Oil-Dri Corp. of America	65	2 192	5 749	
Post Holdings Inc.	22	2 545	2 555	
Reynolds Consumer Products Inc.	119	4 417	4 212	
Spectrum Brands Holdings Inc.	254	26 072	26 717	
Target Corp.	712	120 308	133 710	
Tyson Foods Inc.	1 620	110 769	114 817	
United Natural Foods Inc.	376	9 728	8 047	
Village Super Market Inc.	140	4 215	4 842	
		688 812	673 904	2,86
Soins de santé (31 décembre 2022 : 12,34 %)				
23andMe Holding Co.	276	972	332	
ABIOMED Inc., droits	13	-	-	
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	1 209	34 047	49 914	
Accolade Inc.	83	1 184	1 314	
ADMA Biologics Inc.	1 080	4 585	6 437	
Akero Therapeutics Inc.	32	992	985	
Alignment Healthcare Inc.	536	4 880	6 085	
Alphatec Holdings Inc.	1 428	21 765	28 452	
Alpine Immune Sciences Inc.	30	777	754	
Amgen Inc.	12	4 549	4 557	
Amicus Therapeutics Inc.	942	14 306	17 626	
AMN Healthcare Services Inc.	291	36 898	28 732	
Anneal Pharmaceuticals Inc.	1 955	7 015	15 648	
Amphastar Pharmaceuticals Inc.	35	2 318	2 854	
Amylyx Pharmaceuticals Inc.	468	12 406	9 084	
AngioDynamics Inc.	316	4 566	3 267	
Annexon Inc.	151	938	904	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Arcellx Inc.	117	8 495	8 562	
Arcturus Therapeutics Holdings Inc.	349	11 446	14 510	
Astria Therapeutics Inc.	167	2 817	1 691	
Atea Pharmaceuticals Inc.	109	718	438	
AtriCure Inc.	147	8 287	6 918	
Axonics Inc.	274	21 699	22 483	
Axsome Therapeutics Inc.	40	3 596	4 198	
Baxter International Inc.	789	36 480	40 221	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	1 425	15 031	11 255	
Biomea Fusion Inc.	122	2 408	2 336	
Blueprint Medicines Corp.	45	5 138	5 473	
Bristol-Myers Squibb Co.	1 701	120 646	115 085	
Brookdale Senior Living Inc.	1 027	5 349	7 881	
Bruker Corp.	150	13 073	14 534	
C4 Therapeutics Inc.	1 049	6 086	7 815	
Cardinal Health Inc.	140	18 814	18 608	
CareDx Inc.	228	2 927	3 608	
Castle Biosciences Inc.	338	10 404	9 618	
Celldex Therapeutics Inc.	83	3 122	4 341	
Charles River Laboratories International Inc.	46	11 383	14 339	
Chimerix Inc.	980	3 330	1 244	
Cidara Therapeutics Inc.	247	389	259	
Citius Pharmaceuticals Inc.	1	2	1	
Clover Health Investments Corp.	7 995	10 958	10 037	
Cogent Biosciences Inc.	89	535	690	
Collegium Pharmaceutical Inc.	101	3 615	4 099	
Compass Therapeutics Inc.	234	1 246	481	
Computer Programs and Systems Inc.	158	3 250	2 333	
CONMED Corp.	32	5 152	4 621	
Corcept Therapeutics Inc.	1 373	40 860	58 803	
Corvus Pharmaceuticals Inc.	138	415	320	
CryoPort Inc.	65	1 188	1 328	
Cytek Biosciences Inc.	1 247	9 594	14 996	
Cytokinetics Inc.	505	24 660	55 595	
CytomX Therapeutics Inc.	1 070	2 639	2 187	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	443	8 216	9 422	
Editas Medicine Inc.	157	2 199	2 097	
Edwards Lifesciences Corp.	610	59 164	61 331	
Elanco Animal Health Inc.	1 995	25 657	39 196	
Embecta Corp.	309	10 052	7 713	
Emergent BioSolutions Inc.	471	2 893	1 491	
Enovis Corp.	388	27 798	28 661	
Ensign Group Inc.	32	4 059	4 735	
Envista Holdings Corp.	815	32 072	25 856	
Erasca Inc.	740	2 816	2 078	
Esperion Therapeutics Inc.	1 408	6 776	5 551	
Eton Pharmaceuticals Inc.	65	358	375	
Evolus Inc.	54	624	750	
Exact Sciences Corp.	401	37 743	39 118	
EyePoint Pharmaceuticals Inc.	434	11 974	13 225	
Flexion Therapeutics Inc., droits	87	–	–	
G1 Therapeutics Inc.	406	1 217	1 633	
Galectin Therapeutics Inc.	131	360	287	
Gilead Sciences Inc.	353	37 658	37 707	
Glaukos Corp.	332	27 741	34 799	
GoodRx Holdings Inc.	2 805	23 252	24 781	
Halozyme Therapeutics Inc.	432	23 565	21 054	
HCA Healthcare Inc.	13	4 648	4 640	
Health Catalyst Inc.	123	1 256	1 502	
HealthStream Inc.	49	1 651	1 746	
Hims & Hers Health Inc.	2 994	34 780	35 136	
Hologic Inc.	57	5 352	5 370	
Illumina Inc.	345	47 803	63 343	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Immunovant Inc.	543	23 063	30 165	
Incyte Corp.	1 411	120 645	116 824	
Inogen Inc.	57	422	413	
Insmed Inc.	254	7 296	10 379	
Inspire Medical Systems Inc.	242	49 741	64 915	
Integer Holdings Corp.	28	3 206	3 658	
Integra LifeSciences Holdings Corp.	87	4 477	4 996	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	587	29 517	39 158	
IQVIA Holdings Inc.	367	100 663	111 971	
iRadimed Corp.	100	5 331	6 259	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	326	4 836	4 918	
Karuna Therapeutics Inc.	146	39 446	60 933	
Karyopharm Therapeutics Inc.	162	539	185	
KORU Medical Systems Inc.	100	533	324	
Lantheus Holdings Inc.	580	61 167	47 417	
Lexicon Pharmaceuticals Inc.	236	722	476	
MacroGenics Inc.	495	3 792	6 279	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	144	43 277	43 934	
MannKind Corp.	1 634	10 170	7 843	
Medpace Holdings Inc.	78	22 850	31 527	
Merit Medical Systems Inc.	12	1 143	1 202	
MiMedx Group Inc.	1 036	8 277	11 980	
Mirum Pharmaceuticals Inc.	212	7 701	8 252	
Morphic Holding Inc.	96	3 763	3 656	
Myriad Genetics Inc.	271	7 347	6 840	
Nurix Therapeutics Inc.	287	4 217	3 905	
OmniAb Inc.	547	3 666	4 450	
Omniceil Inc.	126	6 070	6 252	
OPKO Health Inc.	2 578	6 922	5 133	
OraSure Technologies Inc.	1 100	9 553	11 894	
Organogenesis Holdings Inc.	425	1 849	2 292	
Organon & Co.	1 198	22 809	22 779	
Orthofix Medical Inc.	92	1 944	1 635	
PDL BioPharma Inc.	467	567	–	
Pediatrix Medical Group Inc.	504	9 696	6 181	
Pfizer Inc.	157	5 954	5 960	
Phreesia Inc.	33	805	1 007	
PMV Pharmaceuticals Inc.	66	798	270	
Poseida Therapeutics Inc.	557	1 947	2 468	
Progyny Inc.	110	4 588	5 393	
Protagonist Therapeutics Inc.	413	13 766	12 487	
Protalix BioTherapeutics Inc.	113	408	265	
Relay Therapeutics Inc.	101	1 172	1 466	
Replimune Group Inc.	609	10 531	6 770	
ResMed Inc.	429	88 888	97 308	
Revance Therapeutics Inc.	162	1 382	1 878	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	262	7 493	15 881	
Savara Inc.	806	2 237	4 995	
Seer Inc.	56	394	143	
Shockwave Medical Inc.	68	23 154	17 087	
Supernus Pharmaceuticals Inc.	73	3 317	2 786	
Tactile Systems Technology Inc.	245	2 450	4 620	
Tandem Diabetes Care Inc.	259	5 979	10 102	
Tango Therapeutics Inc.	648	6 862	8 459	
Tarsus Pharmaceuticals Inc.	130	3 295	3 471	
Teladoc Health Inc.	1 691	67 465	48 051	
Teleflex Inc.	86	22 381	28 275	
TG Therapeutics Inc.	1 499	31 097	33 760	
Tilray Brands Inc.	1 600	6 432	4 896	
TransMedics Group Inc.	55	5 036	5 724	
Traverse Therapeutics Inc.	874	25 394	10 361	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	214	12 567	13 494	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	199	2 008	1 107	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Varex Imaging Corp.	121	3 514	3 271	
Ventyx Biosciences Inc.	619	9 314	2 016	
Veracyte Inc.	223	6 729	8 089	
Vertex Pharmaceuticals Inc.	44	23 607	23 607	
Waters Corp.	205	74 905	88 995	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	264	2 322	2 374	
Zimmer Biomet Holdings Inc.	207	30 727	33 218	
Zoetis Inc.	89	21 452	23 162	
Zymeworks Inc.	301	3 447	4 124	
		2 170 668	2 347 815	9,96
Services financiers (31 décembre 2022 : 8,08 %)				
Affiliated Managers Group Inc.	145	26 583	28 951	
Aflac Inc.	616	68 495	67 011	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	267	2 374	2 236	
A-Mark Precious Metals Inc.	92	3 737	3 670	
Arrow Financial Corp.	12	457	442	
AvidXchange Holdings Inc.	524	6 921	8 561	
Banc of California Inc.	141	2 304	2 497	
Bank OZK	569	28 431	37 387	
Banner Corp.	18	1 150	1 271	
Block Inc.	2 177	180 183	222 040	
Bread Financial Holdings Inc.	255	10 096	11 076	
Byline Bancorp Inc.	42	1 288	1 305	
Central Pacific Financial Corp.	74	1 885	1 920	
Civista Bancshares Inc.	100	2 921	2 431	
CNB Financial Corp.	12	357	357	
Coinbase Global Inc.	570	65 355	130 719	
Commerce Bancshares Inc.	38	2 535	2 676	
ConnectOne Bancorp Inc.	25	783	755	
Crawford & Co., cat. A	74	773	1 286	
CVB Financial Corp.	785	16 596	20 899	
Eagle Bancorp Inc.	25	940	994	
eHealth Inc.	148	2 152	1 702	
Enova International Inc.	113	6 441	8 249	
ESSA Bancorp Inc.	14	369	370	
Evans Bancorp Inc.	100	3 236	4 158	
Federated Hermes Inc.	283	12 637	12 635	
First Community Corp.	103	2 663	2 924	
First Financial Corp.	91	4 638	5 163	
First Horizon Corp.	2 910	50 986	54 334	
First Merchants Corp.	26	1 100	1 271	
First of Long Island Corp.	24	416	419	
Franklin BSP Realty Trust Inc.	46	876	819	
Green Dot Corp.	519	6 291	6 775	
Heritage Commerce Corp.	102	1 335	1 334	
HomeStreet Inc.	68	845	924	
Jack Henry & Associates Inc.	55	12 176	11 851	
Kemper Corp.	14	759	898	
LendingTree Inc.	69	1 446	2 759	
Macatawa Bank Corp.	444	6 439	6 604	
Medallion Financial Corp.	97	827	1 260	
Merchants Bancorp/IN	29	1 279	1 628	
Mercury General Corp.	61	2 452	3 001	
MetLife Inc.	483	41 087	42 117	
Moelis & Co.	303	18 828	22 426	
National Bankshares Inc.	69	2 777	2 943	
NerdWallet Inc.	599	9 524	11 626	
NMI Holdings Inc.	285	9 179	11 154	
OP Bancorp	100	1 545	1 444	
PayPal Holdings Inc.	468	36 505	37 896	
Popular Inc.	360	27 634	38 958	
Preferred Bank	35	3 041	3 371	
Premier Financial Corp.	68	1 953	2 161	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
PROG Holdings Inc.	1	36	41	
Provident Financial Services Inc.	122	2 711	2 900	
Ready Capital Corp.	403	5 808	5 447	
Remitly Global Inc.	1 721	47 977	44 070	
Rithm Capital Corp.	1 574	22 660	22 166	
Robinhood Markets Inc.	2 510	33 202	42 165	
Shore Bancshares Inc.	19	383	357	
SoFi Technologies Inc.	1 411	16 378	18 512	
Starwood Property Trust Inc.	73	1 870	2 023	
Stewart Information Services Corp.	30	2 261	2 324	
Toast Inc.	4 565	114 802	109 914	
TPG RE Finance Trust Inc.	181	1 341	1 551	
United Bankshares Inc.	1 432	63 004	70 903	
Universal Insurance Holdings Inc.	43	949	906	
US Bancorp	76	4 369	4 337	
UWM Holdings Corp.	151	1 456	1 424	
Veritex Holdings Inc.	32	1 003	982	
Western New England Bancorp Inc.	218	2 061	2 587	
		1 017 871	1 184 267	5,02
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 16,02 %)				
8x8 Inc.	2 974	12 897	14 823	
Advanced Micro Devices Inc.	1 138	177 485	221 199	
Alarm.com Holdings Inc.	224	15 035	19 087	
Altair Engineering Inc.	280	26 269	31 069	
American Software Inc.	41	671	611	
Amtech Systems Inc.	34	401	188	
Apple Inc.	874	229 276	221 882	
Arlo Technologies Inc.	1 218	15 180	15 290	
Arrow Electronics Inc.	234	37 949	37 721	
Atlassian Corp.	340	68 914	106 638	
AvePoint Inc.	222	1 993	2 403	
Axcelis Technologies Inc.	230	45 952	39 332	
Bel Fuse Inc.	65	3 102	5 723	
Benchmark Electronics Inc.	156	4 959	5 686	
Box Inc.	1 475	53 992	49 810	
Brightcove Inc., droits	137	1 164	468	
Calix Inc.	317	19 154	18 262	
CDW Corp.	69	20 445	20 682	
Cerence Inc.	250	8 814	6 481	
CEVA Inc.	62	2 284	1 857	
Cirrus Logic Inc.	347	39 100	38 064	
Cleantech Inc.	1 660	27 531	24 143	
Clear Secure Inc.	1 266	38 344	34 472	
Clearwater Analytics Holdings Inc.	830	22 547	21 922	
Cohu Inc.	276	13 944	12 880	
Couchbase Inc.	240	5 279	7 127	
CPI Card Group Inc.	15	764	380	
CrowdStrike Holdings Inc.	63	20 958	21 210	
Datadog Inc.	269	32 421	43 054	
DigitalOcean Holdings Inc.	391	17 626	18 916	
DocuSign Inc.	2 053	140 119	160 936	
Dropbox Inc.	1 303	47 609	50 651	
Duolingo Inc.	286	56 970	85 550	
DXC Technology Co.	692	20 374	20 868	
Envestnet Inc.	17	1 107	1 110	
Everbridge Inc.	234	7 125	7 501	
Evolv Technologies Holdings Inc.	719	4 895	4 475	
Expensify Inc.	65	402	212	
Extreme Networks Inc.	1 274	35 319	29 633	
Fastly Inc.	440	13 766	10 327	
FormFactor Inc.	51	2 399	2 805	
Fortinet Inc.	2 682	196 280	206 991	
Guidewire Software Inc.	292	27 472	41 984	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
HashiCorp Inc.	710	21 031	22 132	
Infinera Corp.	1 557	14 108	9 752	
Informatica Inc.	1 175	27 842	43 986	
Intapp Inc.	191	9 567	9 575	
Intel Corp.	3 197	135 866	211 832	
Intevac Inc.	743	4 270	4 232	
Jamf Holding Corp.	226	5 689	5 382	
Juniper Networks Inc.	214	8 144	8 319	
Knowles Corp.	270	6 064	6 376	
Kulicke & Soffa Industries Inc.	65	4 401	4 690	
Lattice Semiconductor Corp.	1 100	87 258	100 067	
LiveRamp Holdings Inc.	55	2 157	2 747	
Lumentum Holdings Inc.	221	13 507	15 276	
Magnachip Semiconductor Corp.	15	366	148	
Marathon Digital Holdings Inc.	471	17 218	14 589	
Marvell Technology Inc.	629	48 289	50 021	
Methode Electronics Inc.	147	5 520	4 406	
Micron Technology Inc.	1 040	106 005	117 031	
Mitek Systems Inc.	83	1 427	1 427	
Model N Inc.	16	615	568	
nCino Inc.	698	22 678	30 952	
NetApp Inc.	283	34 239	32 898	
NETGEAR Inc.	116	2 045	2 230	
nLight Inc.	124	1 997	2 207	
Nutanix Inc.	1 392	57 673	87 535	
NVIDIA Corp.	195	125 294	127 334	
Okta Inc.	679	66 299	81 054	
Olo Inc.	286	2 347	2 157	
ON Semiconductor Corp.	176	19 765	19 385	
OneSpan Inc.	376	6 640	5 315	
Onto Innovation Inc.	94	15 175	18 952	
PagerDuty Inc.	956	34 271	29 182	
PDF Solutions Inc.	200	9 187	8 476	
Pegasystems Inc.	340	21 024	21 905	
Photronics Inc.	583	14 648	24 116	
Porch Group Inc.	214	391	869	
PowerSchool Holdings Inc.	98	2 792	3 044	
Procure Technologies Inc.	1 148	90 587	104 782	
Progress Software Corp.	144	10 631	10 310	
Pure Storage Inc.	3 612	142 508	169 841	
Q2 Holdings Inc.	321	11 804	18 374	
Rapid7 Inc.	271	19 793	20 404	
Rimini Street Inc.	438	2 609	1 889	
RingCentral Inc.	915	39 545	40 961	
Riot Platforms Inc.	3 260	66 341	66 500	
Sanmina Corp.	109	7 828	7 383	
SecureWorks Corp.	19	345	185	
SEMrush Holdings Inc.	150	1 850	2 702	
Semtech Corp.	730	20 052	21 090	
SmartRent Inc.	159	720	669	
Smartsheet Inc.	649	35 448	40 923	
Solo Brands Inc.	152	1 116	1 235	
Sprinklr Inc.	2 324	38 810	36 896	
Sprout Social Inc.	543	34 320	43 991	
Squarespace Inc.	253	8 916	11 012	
Super Micro Computer Inc.	23	9 814	8 621	
Synaptics Inc.	46	7 160	6 920	
Telos Corp.	114	587	549	
Tenable Holdings Inc.	557	33 111	33 829	
Ultra Clean Holdings Inc.	22	726	990	
Unity Software Inc.	4 074	168 283	219 660	
Varonis Systems Inc.	778	28 615	46 451	
Veeco Instruments Inc.	77	2 105	3 151	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Verint Systems Inc.	415	13 239	14 791	
Vishay Precision Group Inc.	16	764	719	
Weave Communications Inc.	228	2 808	3 448	
Western Digital Corp.	2 170	123 254	149 850	
Wolfspeed Inc.	834	50 444	47 848	
Xperi Inc.	156	2 094	2 267	
Yext Inc.	1 676	21 718	13 017	
Zscaler Inc.	403	113 720	117 736	
Zuora Inc.	833	9 402	10 325	
		3 595 163	4 073 909	17,28
Services de communication (31 décembre 2022 : 5,51 %)				
AdTheorent Holding Co Inc.	152	358	291	
Alphabet Inc., cat. C	627	117 938	116 516	
Angi Inc.	1 495	17 353	4 909	
AT&T Inc.	461	10 106	10 200	
Bandwidth Inc.	40	1 576	763	
Endeavor Group Holdings Inc.	81	2 630	2 535	
Eventbrite Inc.	1 414	15 315	15 587	
Iridium Communications Inc.	67	4 822	3 636	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM, série A	154	4 384	5 836	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM, série C	553	21 073	20 986	
Live Nation Entertainment Inc.	914	105 968	112 807	
Lumen Technologies Inc.	6 326	36 895	15 265	
Madison Square Garden Sports Corp.	144	35 586	34 526	
Marcus Corp.	51	1 071	980	
Meta Platforms Inc.	110	50 263	51 340	
NII Holdings Inc.	500	1 424	171	
Ooma Inc.	51	898	722	
Paramount Global	1 616	33 886	31 515	
Pinterest Inc.	1 983	82 301	96 852	
ROBLOX Corp.	1 802	97 788	108 636	
Roku Inc.	912	76 467	110 227	
Shutterstock Inc.	295	19 027	18 780	
Snap Inc.	9 331	146 602	208 304	
Spok Holdings Inc.	435	5 171	8 879	
Take-Two Interactive Software Inc.	173	36 902	36 716	
Telephone and Data Systems Inc.	415	10 182	10 041	
TKO Group Holdings Inc.	118	12 074	12 693	
Vivid Seats Inc.	732	7 577	6 100	
Walt Disney Co.	1 056	129 250	125 724	
Yelp Inc.	25	1 497	1 561	
		1 086 384	1 173 098	4,98
Services publics (31 décembre 2022 : 0,88 %)				
AES Corp.	2 549	49 909	64 701	
Ameren Corp.	284	29 183	27 090	
Black Hills Corp.	198	14 823	14 085	
NRG Energy Inc.	2 177	105 072	148 410	
OGE Energy Corp.	282	13 014	12 989	
ONE Gas Inc.	43	3 652	3 613	
Ormat Technologies Inc.	259	24 217	25 884	
Pinnacle West Capital Corp.	15	1 491	1 421	
PPL Corp.	772	27 384	27 587	
Sunnova Energy International Inc.	230	4 590	4 625	
UGI Corp.	414	13 286	13 429	
WEC Energy Group Inc.	468	52 752	51 942	
		339 373	395 776	1,68
Immobilier (31 décembre 2022 : 1,79 %)				
Anywhere Real Estate Inc.	885	6 761	9 464	
Four Corners Property Trust Inc.	59	1 688	1 968	
Highwoods Properties Inc.	88	2 151	2 664	
Lamar Advertising Co.	11	1 553	1 542	
Medical Properties Trust Inc.	6 294	59 986	40 749	
Office Properties Income Trust	346	2 931	3 340	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Outfront Media Inc.	1 281	19 428	23 580	
Public Storage	104	37 531	41 826	
RE/MAX Holdings Inc.	316	7 825	5 554	
Redfin Corp.	428	5 533	5 824	
RMR Group Inc.	249	7 714	9 269	
Weyerhaeuser Co.	250	11 265	11 462	
Zillow Group Inc.	2 896	174 634	220 948	
		<u>339 000</u>	<u>378 190</u>	1,60
Total des actions américaines – position acheteur		14 104 393	15 387 790	65,28
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,45 %)				
Aemetis Inc.	(200)	(1 245)	(1 382)	
Archrock Inc.	(135)	(2 698)	(2 741)	
Centrus Energy Corp.	(37)	(2 157)	(2 655)	
CONSOL Energy Inc.	(16)	(2 373)	(2 121)	
Core Laboratories Inc.	(265)	(7 992)	(6 171)	
Delek US Holdings Inc.	(2)	(70)	(68)	
Enviva Inc.	(1 831)	(25 166)	(2 404)	
Gevo Inc.	(2 202)	(6 639)	(3 368)	
Gulfport Energy Corp.	(72)	(9 471)	(12 646)	
Liberty Energy Inc.	(1 616)	(30 641)	(38 654)	
New Fortress Energy Inc.	(425)	(15 280)	(21 144)	
NextDecade Corp.	(755)	(5 511)	(4 749)	
Nine Energy Service Inc.	(242)	(1 819)	(855)	
Ring Energy Inc.	(434)	(1 083)	(836)	
RPC Inc.	(514)	(5 087)	(4 934)	
Select Water Solutions Inc.	(84)	(833)	(841)	
Southwestern Energy Co.	(12 894)	(85 518)	(111 363)	
Tellurian Inc.	(4 925)	(9 667)	(4 907)	
TETRA Technologies Inc.	(324)	(2 425)	(1 931)	
Vertex Energy Inc.	(892)	(6 853)	(3 987)	
W&T Offshore Inc.	(750)	(4 198)	(3 224)	
		<u>(226 726)</u>	<u>(230 981)</u>	(0,98)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,29 %)				
American Vanguard Corp.	(296)	(5 857)	(4 282)	
AptarGroup Inc.	(63)	(10 723)	(10 269)	
Aspen Aerogels Inc.	(195)	(2 165)	(4 057)	
ATI Inc.	(740)	(41 915)	(44 368)	
Balchem Corp.	(80)	(14 568)	(15 691)	
Berry Global Group Inc.	(336)	(28 793)	(29 857)	
Cabot Corp.	(46)	(4 774)	(5 065)	
Carpenter Technology Corp.	(643)	(57 817)	(60 028)	
Century Aluminum Co.	(216)	(2 925)	(3 458)	
Chemours Co.	(226)	(9 110)	(9 399)	
Corteva Inc.	(267)	(16 323)	(16 871)	
Eastman Chemical Co.	(165)	(19 246)	(19 542)	
Flotek Industries Inc.	(238)	(2 186)	(1 230)	
Kaiser Aluminum Corp.	(161)	(16 598)	(15 113)	
Livent Corp.	(2 547)	(66 635)	(60 385)	
Loop Industries Inc.	(842)	(2 913)	(4 197)	
LSB Industries Inc.	(25)	(351)	(307)	
Materion Corp.	(9)	(1 345)	(1 544)	
Mosaic Co.	(594)	(29 060)	(27 985)	
MP Materials Corp.	(129)	(2 762)	(3 376)	
Piedmont Lithium Inc.	(186)	(11 874)	(6 924)	
PureCycle Technologies Inc.	(1 745)	(15 893)	(9 319)	
Ranpak Holdings Corp.	(174)	(972)	(1 335)	
Stepan Co.	(6)	(746)	(748)	
Sylvamo Corp.	(178)	(11 328)	(11 527)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Worthington Enterprises Inc.	(63)	(4 520)	(4 781)	
		(381 399)	(371 658)	(1,58)
Industries (31 décembre 2022 : -0,93 %)				
3D Systems Corp.	(514)	(3 581)	(4 304)	
AAR Corp.	(79)	(6 354)	(6 500)	
ACCO Brands Corp.	(50)	(420)	(401)	
AeroVironment Inc.	(18)	(3 039)	(2 992)	
AerSale Corp.	(132)	(2 327)	(2 210)	
Allegiant Travel Co.	(23)	(2 424)	(2 505)	
Ameresco Inc.	(320)	(18 946)	(13 363)	
American Airlines Group Inc.	(3 813)	(66 324)	(69 082)	
API Group Corp.	(92)	(3 803)	(4 197)	
ArcBest Corp.	(8)	(1 288)	(1 268)	
Array Technologies Inc.	(182)	(3 703)	(4 032)	
Avis Budget Group Inc.	(22)	(6 055)	(5 142)	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	(163)	(391)	(314)	
Blink Charging Co.	(826)	(10 592)	(3 692)	
Brink's Co.	(30)	(3 516)	(3 479)	
Broadridge Financial Solutions Inc.	(91)	(22 764)	(24 688)	
Carlisle Cos Inc.	(11)	(4 427)	(4 532)	
Carrier Global Corp.	(465)	(34 573)	(35 225)	
Concentrix Corp.	(30)	(3 571)	(3 885)	
Crane Co.	(2)	(202)	(312)	
Delta Air Lines Inc.	(1 615)	(85 357)	(85 671)	
Douglas Dynamics Inc.	(37)	(1 310)	(1 448)	
Eos Energy Enterprises Inc.	(1 638)	(4 084)	(2 354)	
Equifax Inc.	(6)	(1 532)	(1 956)	
FedEx Corp.	(138)	(43 129)	(46 032)	
Fluence Energy Inc.	(863)	(26 118)	(27 140)	
FuelCell Energy Inc.	(3 407)	(14 795)	(7 188)	
Gibraltar Industries Inc.	(63)	(4 874)	(6 561)	
Graco Inc.	(25)	(2 850)	(2 860)	
Hayward Holdings Inc.	(1 846)	(29 198)	(33 104)	
Hillenbrand Inc.	(16)	(930)	(1 010)	
Hub Group Inc.	(32)	(3 795)	(3 879)	
Hyllion Holdings Corp.	(316)	(1 405)	(339)	
ICF International Inc.	(55)	(8 127)	(9 725)	
INNOVATE Corp.	(247)	(421)	(401)	
ITT Inc.	(82)	(12 671)	(12 902)	
JELD-WEN Holding Inc.	(139)	(2 434)	(3 460)	
Kadant Inc.	(65)	(18 480)	(24 025)	
Kelly Services Inc.	(51)	(1 105)	(1 454)	
Kforce Inc.	(88)	(7 467)	(7 839)	
Korn Ferry	(42)	(2 994)	(3 287)	
Landstar System Inc.	(124)	(29 815)	(31 663)	
Lennox International Inc.	(27)	(15 459)	(15 933)	
Leonardo DRS Inc.	(556)	(11 993)	(14 692)	
Lincoln Electric Holdings Inc.	(31)	(8 699)	(8 889)	
Lindsay Corp.	(36)	(6 294)	(6 131)	
Mastech Digital Inc.	(100)	(1 822)	(1 111)	
Matson Inc.	(15)	(1 967)	(2 168)	
Maximus Inc.	(172)	(18 508)	(19 019)	
Mercury Systems Inc.	(25)	(1 249)	(1 206)	
MYR Group Inc.	(5)	(996)	(954)	
National Presto Industries Inc.	(102)	(9 976)	(10 797)	
Nikola Corp.	(19 041)	(31 267)	(21 964)	
Nordson Corp.	(21)	(7 180)	(7 315)	
NuScale Power Corp.	(601)	(3 916)	(2 607)	
Oshkosh Corp.	(874)	(107 956)	(124 938)	
Otis Worldwide Corp.	(36)	(3 995)	(4 247)	
Owens Corning	(224)	(41 973)	(43 782)	
Paylocity Holding Corp.	(92)	(21 388)	(19 998)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(457)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Plug Power Inc.	(3 822)	(22 475)	(22 679)	
Preformed Line Products Co.	(4)	(716)	(706)	
Regal Rexnord Corp.	(98)	(19 301)	(19 128)	
Rocket Lab USA Inc.	(1 861)	(11 102)	(13 570)	
Shoals Technologies Group Inc.	(1 792)	(47 325)	(36 720)	
Shyft Group Inc.	(144)	(2 287)	(2 320)	
Standex International Corp.	(21)	(3 626)	(4 386)	
TriNet Group Inc.	(827)	(100 988)	(129 691)	
Trinity Industries Inc.	(100)	(3 280)	(3 506)	
TuSimple Holdings Inc.	(628)	(1 656)	(727)	
Universal Logistics Holdings Inc.	(7)	(360)	(259)	
Velo3D Inc.	(82)	(164)	(43)	
Viad Corp.	(98)	(2 901)	(4 678)	
Virgin Galactic Holdings Inc.	(2 495)	(11 186)	(8 060)	
Werner Enterprises Inc.	(167)	(8 859)	(9 330)	
Wheels Up Experience Inc.	(613)	(1 773)	(2 772)	
Xometry Inc.	(206)	(4 510)	(9 754)	
		(1 038 698)	(1 080 958)	(4,59)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,74 %)				
1-800-Flowers.com Inc.	(176)	(2 365)	(2 502)	
Academy Sports & Outdoors Inc.	(240)	(19 381)	(20 887)	
Acushnet Holdings Corp.	(32)	(2 491)	(2 665)	
America's Car-Mart Inc.	(96)	(11 846)	(9 591)	
AMMO Inc.	(1 300)	(10 501)	(3 600)	
AutoZone Inc.	(12)	(40 667)	(40 913)	
BARK Inc.	(1 120)	(2 383)	(1 190)	
Bassett Furniture Industries Inc.	(151)	(3 571)	(3 305)	
Bath & Body Works Inc.	(196)	(11 148)	(11 155)	
Brunswick Corp.	(76)	(8 495)	(9 696)	
Caleres Inc.	(178)	(6 863)	(7 213)	
Camping World Holdings Inc.	(176)	(5 852)	(6 094)	
Cavco Industries Inc.	(3)	(1 182)	(1 371)	
Children's Place Inc.	(289)	(11 123)	(8 849)	
Citi Trends Inc.	(150)	(4 365)	(5 594)	
Clarus Corp.	(166)	(2 010)	(1 509)	
ContextLogic Inc.	(71)	(1 801)	(557)	
Designer Brands Inc.	(706)	(8 422)	(8 239)	
Dorman Products Inc.	(30)	(3 208)	(3 300)	
Dutch Bros Inc.	(748)	(27 459)	(31 237)	
Escalade Inc.	(297)	(4 696)	(7 868)	
European Wax Center Inc.	(114)	(2 708)	(2 043)	
EVgo Inc.	(1 448)	(8 149)	(6 835)	
Five Below Inc.	(231)	(52 655)	(64 928)	
Flexsteel Industries Inc.	(26)	(745)	(646)	
Full House Resorts Inc.	(430)	(4 454)	(3 045)	
Funko Inc.	(407)	(10 823)	(4 148)	
GameStop Corp.	(2 198)	(48 738)	(50 807)	
Gentherm Inc.	(87)	(5 841)	(6 007)	
G-III Apparel Group Ltd.	(304)	(13 186)	(13 621)	
Grand Canyon Education Inc.	(35)	(6 124)	(6 094)	
Groupon Inc.	(279)	(2 104)	(4 724)	
Groupon Inc., droits	(279)	-	-	
GrowGeneration Corp.	(638)	(11 307)	(2 112)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(239)	(8 670)	(11 188)	
Hilton Grand Vacations Inc.	(24)	(1 304)	(1 272)	
Home Depot Inc.	(82)	(38 438)	(37 471)	
Kontoor Brands Inc.	(210)	(12 329)	(17 284)	
Krispy Kreme Inc.	(169)	(3 032)	(3 363)	
Kura Sushi USA Inc.	(33)	(2 675)	(3 307)	
Lakeland Industries Inc.	(21)	(366)	(513)	
Lazydays Holdings Inc.	(112)	(1 888)	(1 041)	
LCI Industries	(14)	(2 186)	(2 321)	
Leslie's Inc.	(269)	(2 382)	(2 451)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Life Time Group Holdings Inc.	(144)	(3 508)	(2 863)	
Light & Wonder Inc.	(171)	(19 981)	(18 514)	
Lucid Group Inc.	(7 798)	(74 644)	(43 289)	
MercadoLibre Inc.	(70)	(150 098)	(145 056)	
Mohawk Industries Inc.	(385)	(47 695)	(52 543)	
Monro Inc.	(364)	(24 498)	(14 082)	
Movado Group Inc.	(23)	(878)	(914)	
National Vision Holdings Inc.	(84)	(2 241)	(2 318)	
NIKE Inc., cat. B	(248)	(39 155)	(35 504)	
ODP Corp.	(79)	(5 439)	(5 865)	
Patrick Industries Inc.	(10)	(1 323)	(1 323)	
PetMed Express Inc.	(67)	(649)	(668)	
Planet Fitness Inc.	(647)	(50 536)	(62 279)	
PulteGroup Inc.	(351)	(45 061)	(47 773)	
Purple Innovation Inc.	(339)	(335)	(460)	
Rivian Automotive Inc.	(188)	(5 819)	(5 816)	
Ross Stores Inc.	(70)	(12 499)	(12 774)	
Skyline Champion Corp.	(25)	(2 024)	(2 448)	
Smith & Wesson Brands Inc.	(122)	(2 043)	(2 181)	
Solid Power Inc.	(687)	(2 547)	(1 314)	
Sonic Automotive Inc.	(107)	(7 719)	(7 931)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(616)	(3 132)	(3 460)	
Stitch Fix Inc.	(325)	(1 800)	(1 530)	
Strattec Security Corp.	(124)	(3 987)	(4 106)	
Sweetgreen Inc.	(699)	(7 530)	(10 415)	
Target Hospitality Corp.	(359)	(6 325)	(4 606)	
Tempur Sealy International Inc.	(1 039)	(57 577)	(69 830)	
Tesla Inc.	(98)	(32 213)	(32 109)	
Tilly's Inc.	(111)	(1 245)	(1 104)	
Tractor Supply Co.	(79)	(22 646)	(22 400)	
Under Armour Inc., cat. A	(557)	(7 784)	(6 456)	
Unifi Inc.	(110)	(1 712)	(966)	
VOXX International Corp.	(91)	(1 449)	(1 282)	
Vroom Inc.	(2 039)	(3 372)	(1 620)	
Vuzix Corp.	(809)	(6 761)	(2 224)	
Weyco Group Inc.	(109)	(3 658)	(4 507)	
Workhorse Group Inc.	(1 429)	(1 560)	(678)	
XPEL Inc.	(99)	(8 450)	(7 030)	
		(1 099 826)	(1 072 794)	(4,55)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,23 %)				
Alico Inc.	(141)	(5 446)	(5 407)	
Andersons Inc.	(130)	(9 329)	(9 863)	
B&G Foods Inc.	(56)	(804)	(775)	
BRC Inc.	(554)	(3 235)	(2 652)	
Calavo Growers Inc.	(59)	(3 052)	(2 288)	
Clorox Co.	(35)	(6 769)	(6 581)	
Dollar General Corp.	(78)	(13 800)	(13 983)	
Grocery Outlet Holding Corp.	(165)	(6 335)	(5 866)	
Ingredion Inc.	(319)	(44 515)	(45 651)	
J M Smucker Co.	(195)	(32 738)	(32 496)	
Kraft Heinz Co.	(2 353)	(113 886)	(114 737)	
Lamb Weston Holdings Inc.	(127)	(17 307)	(18 101)	
Lancaster Colony Corp.	(7)	(1 681)	(1 536)	
Lifecore Biomedical Inc.	(710)	(5 792)	(5 795)	
Limoneira Co.	(50)	(1 117)	(1 360)	
Mission Produce Inc.	(516)	(8 122)	(6 865)	
Performance Food Group Co.	(197)	(17 223)	(17 963)	
Universal Corp.	(64)	(5 610)	(5 681)	
Utz Brands Inc.	(106)	(1 921)	(2 270)	
Veru Inc.	(791)	(980)	(751)	
Walgreens Boots Alliance Inc.	(202)	(6 714)	(6 955)	
Whole Earth Brands Inc.	(235)	(2 648)	(1 057)	
		(309 024)	(308 633)	(1,31)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Soins de santé (31 décembre 2022 : -2,67 %)				
10X Genomics Inc.	(351)	(21 614)	(25 900)	
2seventy bio Inc.	(227)	(3 687)	(1 278)	
89bio Inc.	(215)	(2 754)	(3 167)	
AdaptHealth Corp.	(783)	(12 662)	(7 527)	
Adaptive Biotechnologies Corp.	(318)	(2 272)	(2 055)	
Agenus Inc.	(1 583)	(3 584)	(1 728)	
Agilon health Inc.	(1 142)	(20 990)	(18 898)	
Aldeyra Therapeutics Inc.	(493)	(1 590)	(2 282)	
Alector Inc.	(335)	(2 831)	(3 525)	
Allakos Inc.	(764)	(5 595)	(2 750)	
Allogene Therapeutics Inc.	(913)	(8 796)	(3 864)	
Allovir Inc.	(838)	(5 001)	(751)	
American Well Corp.	(164)	(721)	(322)	
AnaptysBio Inc.	(73)	(1 863)	(2 062)	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	(403)	(28 089)	(31 809)	
Apollo Medical Holdings Inc.	(55)	(2 301)	(2 778)	
Arcus Biosciences Inc.	(660)	(16 697)	(16 622)	
Ardelyx Inc.	(369)	(3 047)	(3 017)	
ARS Pharmaceuticals Inc.	(175)	(880)	(1 265)	
Artivion Inc.	(41)	(797)	(967)	
Arvinas Inc.	(268)	(8 894)	(14 545)	
Asensus Surgical Inc.	(1 965)	(2 663)	(826)	
Avid Bioservices Inc.	(139)	(2 116)	(1 191)	
Avidity Biosciences Inc.	(602)	(8 967)	(7 184)	
Beam Therapeutics Inc.	(796)	(34 523)	(28 570)	
BioLife Solutions Inc.	(525)	(15 009)	(11 249)	
BioMarin Pharmaceutical Inc.	(257)	(33 389)	(32 675)	
Bionano Genomics Inc.	(600)	(22 917)	(1 495)	
Bio-Techne Corp.	(1 013)	(100 689)	(103 066)	
Bioventus Inc.	(425)	(871)	(2 953)	
Bluebird Bio Inc.	(966)	(8 493)	(1 758)	
Bridgebio Pharma Inc.	(1 905)	(63 705)	(101 407)	
Butterfly Network Inc.	(1 809)	(6 735)	(2 576)	
Cano Health Inc.	(31)	(5 755)	(240)	
Caribou Biosciences Inc.	(239)	(2 093)	(1 806)	
Carisma Therapeutics Inc.	(13)	(315)	(50)	
Catalent Inc.	(1 210)	(74 086)	(71 686)	
Catalyst Pharmaceuticals Inc.	(121)	(2 292)	(2 682)	
Certara Inc.	(2 221)	(67 706)	(51 514)	
Codexis Inc.	(320)	(1 342)	(1 287)	
Coherus Biosciences Inc.	(1 147)	(8 297)	(5 036)	
Community Health Systems Inc.	(352)	(1 896)	(1 453)	
CorVel Corp.	(6)	(1 905)	(1 956)	
Cross Country Healthcare Inc.	(126)	(3 554)	(3 761)	
Cue Biopharma Inc.	(185)	(783)	(644)	
CVS Health Corp.	(87)	(8 145)	(9 058)	
Denali Therapeutics Inc.	(1 456)	(42 448)	(41 201)	
Dexcom Inc.	(8)	(1 239)	(1 309)	
DocGo Inc.	(707)	(7 902)	(5 211)	
Doximity Inc.	(1 097)	(35 335)	(40 560)	
Dyne Therapeutics Inc.	(31)	(387)	(544)	
Enzo Biochem Inc.	(2 526)	(8 064)	(4 630)	
Epizyme Inc., droits	(249)	–	(328)	
Evolent Health Inc.	(115)	(4 522)	(5 009)	
Fate Therapeutics Inc.	(154)	(498)	(759)	
Fulcrum Therapeutics Inc.	(238)	(2 515)	(2 118)	
Fulgent Genetics Inc.	(606)	(30 097)	(23 101)	
GE HealthCare Technologies Inc.	(123)	(11 747)	(12 540)	
Geron Corp.	(1 834)	(6 453)	(5 103)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(29 192)	(59 847)	(65 052)	
Gossamer Bio Inc.	(595)	(513)	(716)	
Guardant Health Inc.	(24)	(879)	(856)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Humacyte Inc.	(228)	(1 135)	(854)	
IDEXX Laboratories Inc.	(2)	(1 421)	(1 464)	
IGM Biosciences Inc.	(421)	(4 803)	(4 613)	
ImmunityBio Inc.	(2 641)	(7 373)	(17 482)	
Immune Bio Inc.	(178)	(2 039)	(2 643)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(2 416)	(5 944)	(1 625)	
Inozyme Pharma Inc.	(178)	(1 160)	(1 000)	
Intellia Therapeutics Inc.	(513)	(25 291)	(20 625)	
Invitae Corp.	(1 889)	(15 497)	(1 561)	
Iovance Biotherapeutics Inc.	(3 106)	(26 139)	(33 297)	
iRhythm Technologies Inc.	(63)	(7 638)	(8 892)	
iTeos Therapeutics Inc.	(105)	(2 517)	(1 516)	
Maravai LifeSciences Holdings Inc.	(346)	(6 606)	(2 988)	
MiNK Therapeutics Inc.	(13)	(38)	(18)	
Moderna Inc.	(317)	(44 312)	(41 570)	
Neogen Corp.	(1 532)	(37 419)	(40 624)	
NeoGenomics Inc.	(38)	(1 004)	(811)	
Ocugen Inc.	(1 965)	(1 212)	(1 490)	
Ocular Therapeutix Inc.	(754)	(3 838)	(4 434)	
Omeros Corp.	(176)	(622)	(759)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(2 302)	(33 442)	(29 777)	
Paragon 28 Inc.	(39)	(483)	(639)	
PROCEPT BioRobotics Corp.	(220)	(10 277)	(12 158)	
ProPhase Labs Inc.	(100)	(1 083)	(596)	
PTC Therapeutics Inc.	(559)	(22 266)	(20 314)	
Quantum-Si Inc.	(646)	(2 631)	(1 712)	
QuidelOrtho Corp.	(23)	(2 667)	(2 235)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(258)	(804)	(493)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(794)	(22 343)	(31 378)	
Sana Biotechnology Inc.	(95)	(591)	(511)	
Sangamo Therapeutics Inc.	(690)	(1 109)	(494)	
Schrodinger Inc.	(760)	(36 905)	(35 876)	
Scilex Holding Co.	(243)	(3 432)	(654)	
Senseonics Holdings Inc.	(1 115)	(1 107)	(838)	
Seres Therapeutics Inc.	(1 570)	(11 300)	(2 898)	
SIGA Technologies Inc.	(89)	(632)	(657)	
Sight Sciences Inc.	(352)	(1 948)	(2 395)	
Simulations Plus Inc.	(128)	(7 374)	(7 553)	
Sotera Health Co.	(928)	(21 015)	(20 619)	
SpringWorks Therapeutics Inc.	(618)	(24 521)	(29 744)	
Stereotaxis Inc.	(471)	(1 278)	(1 087)	
Syndax Pharmaceuticals Inc.	(90)	(2 427)	(2 565)	
Tenet Healthcare Corp.	(73)	(6 699)	(7 274)	
UFP Technologies Inc.	(9)	(2 070)	(2 042)	
Vaxart Inc.	(205)	(386)	(155)	
Vaxcyte Inc.	(9)	(592)	(745)	
Vera Therapeutics Inc.	(194)	(3 149)	(3 934)	
Veradigm Inc.	(183)	(2 473)	(2 531)	
Verastem Inc.	(25)	(341)	(268)	
Verve Therapeutics Inc.	(1 182)	(22 460)	(21 727)	
Viatis Inc.	(4 861)	(65 057)	(69 417)	
Vir Biotechnology Inc.	(1 212)	(39 049)	(16 077)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(2 148)	(5 014)	(2 375)	
Xencor Inc.	(442)	(16 806)	(12 373)	
Xeris Biopharma Holdings Inc.	(227)	(349)	(703)	
XOMA Corp.	(67)	(1 473)	(1 634)	
Zevra Therapeutics Inc.	(326)	(2 066)	(2 816)	
Zimvie Inc.	(24)	(542)	(562)	
		(1 419 526)	(1 340 364)	(5,69)
Services financiers (31 décembre 2022 : -1,31 %)				
Acacia Research Corp.	(711)	(3 888)	(3 675)	
ACNB Corp.	(50)	(2 204)	(2 951)	
AGNC Investment Corp.	(1 696)	(19 060)	(21 939)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ally Financial Inc.	(679)	(27 394)	(31 265)	
American Express Co.	(329)	(79 578)	(81 272)	
Annaly Capital Management Inc.	(2 040)	(53 135)	(52 104)	
Atlantius Holdings Corp.	(100)	(3 778)	(5 099)	
Axos Financial Inc.	(43)	(3 124)	(3 096)	
Bank First Corp.	(103)	(10 817)	(11 770)	
Bank of Hawaii Corp.	(37)	(2 964)	(3 535)	
Bank of New York Mellon Corp.	(3)	(177)	(206)	
Brighthouse Financial Inc.	(599)	(36 104)	(41 798)	
BRP Group Inc.	(72)	(2 281)	(2 280)	
Cadence Bank	(274)	(10 141)	(10 691)	
Capital City Bank Group Inc.	(229)	(9 358)	(8 887)	
Capital One Financial Corp.	(113)	(18 239)	(19 537)	
Charles Schwab Corp.	(298)	(26 610)	(27 034)	
Cherry Hill Mortgage Investment Corp.	(116)	(795)	(618)	
Citizens & Northern Corp.	(227)	(6 865)	(6 714)	
City Holding Co.	(191)	(23 643)	(27 769)	
Cohen & Steers Inc.	(11)	(1 065)	(1 098)	
Columbia Financial Inc.	(151)	(3 529)	(3 839)	
Dime Community Bancshares Inc.	(32)	(1 180)	(1 136)	
Discover Financial Services	(483)	(67 672)	(71 586)	
Eagle Bancorp Montana Inc.	(49)	(1 258)	(1 020)	
East West Bancorp Inc.	(52)	(4 305)	(4 933)	
Ellington Financial Inc.	(177)	(3 137)	(2 966)	
Equitable Holdings Inc.	(56)	(2 216)	(2 459)	
Equity Bancshares Inc.	(16)	(544)	(715)	
Esquire Financial Holdings Inc.	(100)	(5 515)	(6 588)	
Farmers & Merchants Bancorp Inc.	(100)	(3 115)	(3 270)	
Federal Agricultural Mortgage Corp., cat. C	(15)	(2 701)	(3 782)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(3 826)	
Fidelity National Information Services Inc.	(407)	(32 337)	(32 238)	
First Bancorp Inc.	(150)	(5 698)	(5 582)	
First Bancorp/Southern Pines NC	(126)	(5 677)	(6 149)	
First Commonwealth Financial Corp.	(320)	(5 229)	(6 515)	
First Financial Northwest Inc.	(151)	(2 891)	(2 684)	
First Foundation Inc.	(594)	(6 225)	(7 582)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(200)	(6 122)	(2 933)	
First Internet Bancorp	(100)	(4 961)	(3 190)	
First Northwest Bancorp	(200)	(4 295)	(4 204)	
First Savings Financial Group Inc.	(250)	(6 342)	(5 538)	
First Western Financial Inc.	(300)	(10 379)	(7 844)	
FleetCor Technologies Inc.	(36)	(13 377)	(13 415)	
Flywire Corp.	(550)	(20 689)	(16 789)	
FVCBankcorp Inc.	(73)	(1 155)	(1 367)	
Glacier Bancorp Inc.	(140)	(7 636)	(7 628)	
GoHealth Inc.	(20)	(428)	(352)	
Great Southern Bancorp Inc.	(50)	(4 177)	(3 913)	
Greene County Bancorp Inc.	(100)	(3 180)	(3 718)	
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc.	(396)	(10 480)	(14 401)	
HarborOne Bancorp Inc.	(77)	(1 195)	(1 216)	
Hilltop Holdings Inc.	(31)	(1 241)	(1 439)	
Hingham Institution For Savings The	(50)	(16 464)	(12 817)	
Independent Bank Corp., MA	(9)	(793)	(781)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(88)	(1 193)	(1 028)	
Jackson Financial Inc.	(359)	(16 886)	(24 237)	
Live Oak Bancshares Inc.	(90)	(2 960)	(5 400)	
Lument Finance Trust Inc.	(101)	(364)	(310)	
M&T Bank Corp.	(47)	(8 509)	(8 495)	
Markel Group Inc.	(5)	(9 377)	(9 361)	
MarketAxess Holdings Inc.	(23)	(8 324)	(8 882)	
MBIA Inc.	(90)	(1 201)	(726)	
Metrocity Bankshares Inc.	(50)	(1 126)	(1 584)	
Metropolitan Bank Holding Corp.	(44)	(2 084)	(3 213)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Morningstar Inc.	(8)	(2 743)	(3 019)	
MVB Financial Corp.	(162)	(5 082)	(4 819)	
NBT Bancorp Inc.	(211)	(9 948)	(11 660)	
NCR Atleos Corp.	(537)	(15 016)	(17 199)	
New York Mortgage Trust Inc.	(140)	(2 020)	(1 575)	
Open Lending Corp.	(344)	(3 610)	(3 860)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(1 343)	(41 106)	(51 550)	
PennyMac Financial Services Inc.	(427)	(34 402)	(49 756)	
Piper Sandler Cos	(29)	(5 362)	(6 687)	
PRA Group Inc.	(19)	(424)	(656)	
ProAssurance Corp.	(91)	(1 665)	(1 655)	
Provident Financial Holdings Inc.	(18)	(349)	(299)	
RBB Bancorp	(50)	(1 332)	(1 255)	
Reinsurance Group of America Inc.	(13)	(2 819)	(2 773)	
RLI Corp.	(123)	(22 006)	(21 590)	
Seacoast Banking Corp. of Florida	(28)	(1 095)	(1 051)	
Selective Insurance Group Inc.	(15)	(2 108)	(1 968)	
ServisFirst Bancshares Inc.	(77)	(5 164)	(6 765)	
Simmons First National Corp.	(5)	(123)	(131)	
SLM Corp.	(653)	(13 054)	(16 463)	
Southern First Bancshares Inc.	(100)	(5 607)	(4 892)	
StepStone Group Inc.	(242)	(8 933)	(10 157)	
Sterling Bancorp Inc.	(429)	(3 443)	(3 264)	
Stifel Financial Corp.	(42)	(3 538)	(3 830)	
Synchrony Financial	(940)	(44 441)	(47 336)	
Synovus Financial Corp.	(62)	(2 591)	(3 078)	
Texas Capital Bancshares Inc.	(23)	(1 938)	(1 960)	
Tompkins Financial Corp.	(119)	(10 491)	(9 451)	
Towne Bank	(9)	(360)	(353)	
TriCo Bancshares	(228)	(13 271)	(12 919)	
Triumph Financial Inc.	(52)	(4 046)	(5 498)	
Trupanion Inc.	(36)	(1 559)	(1 448)	
Two Harbors Investment Corp.	(281)	(4 026)	(5 161)	
United Community Banks Inc.	(54)	(2 138)	(2 083)	
Valley National Bancorp	(2 509)	(29 191)	(35 929)	
Virtus Investment Partners Inc.	(4)	(1 294)	(1 275)	
WaFd Inc.	(326)	(13 397)	(14 168)	
West BanCorp Inc.	(197)	(5 948)	(5 507)	
Western Alliance Bancorp	(1 616)	(87 904)	(140 189)	
World Acceptance Corp.	(11)	(1 695)	(1 893)	
		(1 077 738)	(1 210 111)	(5,13)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -1,49 %)				
908 Devices Inc.	(124)	(1 434)	(1 835)	
ACM Research Inc.	(252)	(4 706)	(6 493)	
Adobe Inc.	(74)	(56 216)	(58 214)	
Aehr Test Systems	(165)	(8 462)	(5 772)	
Alteryx Inc.	(19)	(1 199)	(1 182)	
Amkor Technology Inc.	(1 096)	(38 528)	(48 081)	
Analog Devices Inc.	(329)	(81 668)	(86 139)	
AppLovin Corp.	(197)	(10 130)	(10 352)	
Arista Networks Inc.	(239)	(72 602)	(74 220)	
Aspen Technology Inc.	(97)	(24 436)	(28 158)	
Belden Inc.	(80)	(8 516)	(8 149)	
Broadcom Inc.	(107)	(134 630)	(157 492)	
CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	(198)	(3 232)	(2 974)	
Ceridian HCM Holding Inc.	(700)	(66 944)	(62 209)	
Clearfield Inc.	(102)	(5 652)	(3 911)	
Cognex Corp.	(66)	(3 830)	(3 633)	
Cognizant Technology Solutions Corp.	(312)	(30 173)	(31 073)	
Comtech Telecommunications Corp.	(64)	(668)	(711)	
CTS Corp.	(39)	(1 944)	(2 249)	
Digimarc Corp.	(290)	(8 603)	(13 812)	
Digital Turbine Inc.	(932)	(43 890)	(8 431)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Invendaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
E2open Parent Holdings Inc.	(1 888)	(10 612)	(10 929)	
Enphase Energy Inc.	(298)	(55 012)	(51 923)	
Entegris Inc.	(134)	(19 845)	(21 171)	
Fair Isaac Corp.	(49)	(52 507)	(75 208)	
FARO Technologies Inc.	(5)	(357)	(149)	
First Solar Inc.	(299)	(62 404)	(67 923)	
Five9 Inc.	(327)	(32 024)	(33 930)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(87)	(1 130)	(1 529)	
Hut 8 Corp.	(4 740)	(76 427)	(83 803)	
IonQ Inc.	(1 985)	(14 785)	(32 404)	
IPG Photonics Corp.	(172)	(26 861)	(24 617)	
Jabil Inc.	(91)	(15 946)	(15 287)	
Lam Research Corp.	(27)	(27 312)	(27 886)	
Lightwave Logic Inc.	(57)	(431)	(374)	
Littelfuse Inc.	(3)	(1 063)	(1 058)	
Luna Innovations Inc.	(84)	(827)	(737)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(146)	(14 580)	(17 894)	
Matterport Inc.	(1 009)	(4 606)	(3 579)	
MicroStrategy Inc.	(154)	(79 878)	(128 260)	
Mirion Technologies Inc.	(1 225)	(13 664)	(16 557)	
MKS Instruments Inc.	(632)	(76 828)	(85 727)	
MongoDB Inc.	(4)	(1 792)	(2 156)	
Monolithic Power Systems Inc.	(54)	(42 728)	(44 914)	
Napco Security Technologies Inc.	(33)	(1 105)	(1 490)	
Navitas Semiconductor Corp.	(825)	(8 391)	(8 779)	
NCR Voyix Corp.	(1 693)	(57 760)	(37 750)	
OSI Systems Inc.	(3)	(357)	(511)	
Palantir Technologies Inc.	(2 068)	(50 373)	(46 820)	
PAR Technology Corp.	(130)	(5 804)	(7 464)	
Samsara Inc.	(464)	(18 571)	(20 423)	
SiTime Corp.	(200)	(35 400)	(32 195)	
Skyworks Solutions Inc.	(496)	(64 856)	(73 526)	
SolarEdge Technologies Inc.	(42)	(6 879)	(5 184)	
SoundHound AI Inc.	(811)	(2 368)	(2 267)	
SPS Commerce Inc.	(26)	(6 206)	(6 646)	
Teradata Corp.	(111)	(6 740)	(6 368)	
Tucows Inc., NASD	(10)	(358)	(356)	
Tyler Technologies Inc.	(42)	(21 786)	(23 156)	
Ubiquiti Inc.	(15)	(2 486)	(2 760)	
Universal Display Corp.	(407)	(84 848)	(102 644)	
Viasat Inc.	(1 408)	(61 148)	(51 892)	
Viavi Solutions Inc.	(287)	(3 742)	(3 811)	
Xerox Holdings Corp.	(96)	(2 323)	(2 320)	
Zebra Technologies Corp.	(141)	(52 621)	(50 818)	
		(1 733 204)	(1 850 285)	(7,85)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,45 %)				
AMC Networks Inc.	(103)	(2 066)	(2 552)	
Anterix Inc.	(72)	(3 389)	(3 163)	
ATN International Inc.	(139)	(7 792)	(7 143)	
Cable One Inc.	(22)	(20 240)	(16 146)	
Cardlytics Inc.	(326)	(10 171)	(3 959)	
Cars.com Inc.	(263)	(4 748)	(6 579)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(756)	(2 914)	(1 814)	
Consolidated Communications Holdings Inc.	(871)	(4 359)	(4 996)	
Emerald Holding Inc.	(172)	(829)	(1 356)	
Entravision Communications Corp.	(218)	(1 361)	(1 199)	
EverQuote Inc.	(558)	(8 807)	(9 006)	
EW Scripps Co.	(436)	(7 800)	(4 594)	
FuboTV Inc.	(2 636)	(7 807)	(11 053)	
Globalstar Inc.	(519)	(800)	(1 328)	
Gogo Inc.	(142)	(2 089)	(1 897)	
IAC Inc.	(695)	(51 315)	(48 002)	
Madison Square Garden Entertainment Corp.	(38)	(1 693)	(1 593)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Match Group Inc.	(125)	(5 631)	(6 016)	
MediaAlpha Inc.	(37)	(568)	(544)	
New York Times Co.	(255)	(16 105)	(16 473)	
News Corp., NAS	(323)	(9 553)	(10 456)	
Omnicom Group Inc	(50)	(5 751)	(5 704)	
PubMatic Inc.	(174)	(3 670)	(3 742)	
Reading International Inc.	(168)	(882)	(423)	
Scholastic Corp.	(62)	(3 154)	(3 082)	
Sinclair Inc.	(427)	(10 050)	(7 336)	
Sphere Entertainment Co.	(190)	(8 064)	(8 508)	
TechTarget Inc.	(71)	(3 538)	(3 264)	
Trade Desk Inc.	(177)	(17 743)	(16 795)	
Ziff Davis Inc.	(299)	(28 383)	(26 490)	
ZipRecruiter Inc.	(773)	(16 575)	(14 168)	
		(267 847)	(249 381)	(1,06)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,10 %)				
Atmos Energy Corp.	(196)	(30 396)	(29 954)	
Cadiz Inc.	(961)	(6 016)	(3 548)	
California Water Service Group	(120)	(8 485)	(8 207)	
Chesapeake Utilities Corp.	(37)	(4 939)	(5 154)	
Clearway Energy Inc., cat. C	(160)	(5 317)	(5 787)	
MGE Energy Inc.	(50)	(4 925)	(4 767)	
Middlesex Water Co.	(22)	(2 212)	(1 904)	
New Jersey Resources Corp.	(419)	(24 166)	(24 630)	
NextEra Energy Inc.	(356)	(26 053)	(28 513)	
NextEra Energy Partners LP	(1 099)	(37 993)	(44 068)	
SJW Group	(75)	(6 527)	(6 463)	
Southwest Gas Holdings Inc.	(87)	(7 068)	(7 267)	
Spruce Power Holding Corp.	(239)	(15 926)	(1 393)	
Unitil Corp.	(105)	(7 212)	(7 278)	
Vistra Corp.	(208)	(10 314)	(10 565)	
		(197 549)	(189 498)	(0,80)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,53 %)				
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(443)	(69 101)	(74 051)	
American Tower Corp.	(66)	(18 059)	(18 788)	
Americold Realty Trust Inc.	(30)	(1 127)	(1 197)	
Apartment Investment and Management Co.	(675)	(6 569)	(6 969)	
Armada Hoffler Properties Inc.	(96)	(1 637)	(1 566)	
Boston Properties Inc.	(54)	(4 648)	(4 996)	
CBRE Group Inc.	(468)	(53 467)	(57 446)	
Community Healthcare Trust Inc.	(156)	(7 553)	(5 480)	
Compass Inc.	(1 038)	(4 364)	(5 146)	
COPT Defense Properties	(298)	(10 732)	(10 071)	
Crown Castle Inc.	(371)	(56 479)	(56 351)	
Douglas Elliman Inc.	(9)	(115)	(35)	
Easterly Government Properties Inc.	(1 313)	(24 671)	(23 269)	
EastGroup Properties Inc.	(14)	(3 134)	(3 388)	
Empire State Realty Trust Inc.	(1 568)	(13 855)	(20 035)	
Equity Commonwealth	(782)	(21 314)	(19 798)	
Essex Property Trust Inc.	(8)	(2 474)	(2 615)	
eXp World Holdings Inc.	(1 086)	(42 253)	(22 225)	
Farmland Partners Inc.	(478)	(8 134)	(7 866)	
First Industrial Realty Trust Inc.	(51)	(3 406)	(3 542)	
FRP Holdings Inc.	(100)	(7 345)	(8 291)	
Gladstone Commercial Corp.	(400)	(6 676)	(6 983)	
Gladstone Land Corp.	(117)	(2 859)	(2 229)	
Howard Hughes Holdings Inc.	(424)	(43 170)	(47 830)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(423)	(86 942)	(105 346)	
Kilroy Realty Corp.	(40)	(2 025)	(2 101)	
Macerich Co.	(386)	(8 074)	(7 854)	
Marcus & Millichap Inc.	(268)	(11 837)	(15 436)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(33)	(480)	(691)	
Newmark Group Inc.	(678)	(6 464)	(9 798)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NNN REIT Inc.	(135)	(7 447)	(7 672)	
Opendoor Technologies Inc.	(2 430)	(6 153)	(14 355)	
Phillips Edison & Co Inc.	(220)	(10 649)	(10 583)	
Postal Realty Trust Inc.	(267)	(5 603)	(5 126)	
Prologis Inc.	(96)	(17 118)	(16 874)	
RLJ Lodging Trust	(579)	(7 860)	(8 948)	
Sabra Health Care REIT Inc.	(190)	(3 610)	(3 575)	
SBA Communications Corp.	(71)	(21 776)	(23 751)	
SL Green Realty Corp.	(7)	(313)	(417)	
St Joe Co.	(72)	(3 952)	(5 713)	
Stratus Properties Inc.	(17)	(918)	(647)	
Tejon Ranch Co.	(327)	(8 242)	(7 416)	
Veris Residential Inc.	(82)	(1 569)	(1 701)	
Vornado Realty Trust	(1 550)	(47 814)	(57 738)	
WP Carey Inc.	(356)	(30 047)	(30 423)	
		(702 035)	(746 332)	(3,17)
Total des actions américaines – position vendeur		(8 453 572)	(8 650 995)	(36,71)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 2,32 %)				
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	16 500	3 274	3 363	
Aker Solutions ASA	4 477	12 120	24 426	
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	28 000	1 973	1 915	
Ardmore Shipping Corp.	1 234	21 962	22 927	
Avance Gas Holding Ltd.	501	8 786	9 731	
Borr Drilling Ltd.	287	1 417	2 826	
Boss Energy Ltd.	1 202	4 663	4 358	
BP Castrol KK	300	2 832	2 438	
BW Energy Ltd.	682	2 327	2 391	
BW LPG Ltd.	1 135	13 276	22 297	
BW Offshore Ltd.	307	1 399	894	
Carnarvon Energy Ltd.	4 147	767	858	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	290	361	351	
Dayang Enterprise Holdings Bhd	36 300	18 636	16 667	
Dorian LPG Ltd.	334	12 338	19 321	
Dyna-Mac Holdings Ltd.	9 600	3 826	3 215	
Elnusa Tbk PT	193 000	6 493	6 413	
ENEOS Holdings Inc.	6 100	29 253	31 973	
Établissements Maurel et Prom SA	9	49	80	
FLEX LNG Ltd.	422	15 346	16 350	
Frontline PLC, NYSE	219	4 270	5 790	
Frontline PLC, OSL	2 142	46 470	56 429	
Hafnia Ltd.	710	5 391	6 471	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	4 500	28 576	32 303	
Koninklijke Vopak NV	306	14 535	13 568	
Magnora ASA	202	810	866	
Medco Energi Internasional Tbk PT	110 800	14 931	10 960	
MMA Offshore Ltd.	688	707	1 158	
Modec Inc.	100	1 349	2 168	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription	32	–	443	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	1 900	1 667	2 079	
Nordic American Tankers Ltd.	3 243	11 637	17 960	
Oil Refineries Ltd.	30 457	13 141	13 629	
PetroChina Co., Ltd.	2 000	1 835	1 726	
Petron Malaysia Refining & Marketing Bhd	2 900	3 974	3 762	
San-Ai Obbli Co., Ltd.	100	1 379	1 502	
Saras SpA	6 518	7 664	15 343	
Semirara Mining & Power Corp.	23 300	18 993	16 783	
SFL Corp. Ltd.	1 204	13 837	17 908	
Sinopec Oilfield Service Corp.	14 000	1 496	1 147	
Star Petroleum Refining PCL	1 000	363	319	
Subsea 7 SA	1 874	31 176	36 060	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
TechnipFMC PLC	3 432	98 475	91 142	
Teekay Corp.	399	2 891	3 762	
Terracom Ltd.	7 148	3 702	2 701	
Thai Oil PCL	400	753	831	
Transocean Ltd.	2 940	30 687	24 617	
United Tractors Tbk PT	8 700	19 938	16 857	
Velesto Energy Bhd	27 000	1 802	1 782	
Viva Energy Group Ltd.	497	1 235	1 561	
Wasco Bhd	14 600	4 205	4 169	
Whitehaven Coal Ltd.	6 772	43 127	45 333	
Yancoal Australia Ltd.	425	1 844	1 893	
YPF SA	6 571	152 745	148 943	
		746 703	794 759	3,37
Matières premières (31 décembre 2022 : 4,61 %)				
Aica Kogyo Co., Ltd.	200	5 785	6 383	
Aichi Steel Corp.	300	7 911	8 909	
Air Water Inc.	400	6 789	7 208	
Akcansa Cimento AS	199	1 239	1 264	
Alkane Resources Ltd.	5 351	3 309	3 154	
Alleima AB	1 709	11 174	17 133	
Asia Pile Holdings Corp.	300	1 675	1 973	
Aurelia Metals Ltd.	925	729	92	
Aurubis AG	23	2 561	2 488	
Barito Pacific Tbk PT	5 200	676	592	
Bellevue Gold Ltd.	532	805	802	
Borregaard ASA	675	13 261	15 022	
C Uyemura & Co., Ltd.	100	6 239	10 345	
Carlit Holdings Co., Ltd.	100	697	869	
Cementir Holding NV	428	5 012	5 947	
Centamin PLC	1 483	2 497	2 485	
China BlueChemical Ltd.	4 000	1 282	1 331	
China Hongqiao Group Ltd.	15 000	17 425	16 186	
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	1 000	706	866	
Chuetsu Pulp & Paper Co., Ltd.	100	1 412	1 726	
CI Takiron Corp.	200	1 036	1 227	
Covestro AG	953	68 126	73 127	
Daicel Corp.	300	3 874	3 833	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	300	5 533	7 088	
Deterra Royalties Ltd.	848	3 536	4 021	
Dottikon Es Holding AG	8	2 739	2 870	
DRDGOLD Ltd.	6 705	85 012	70 288	
Elkem ASA	6 758	19 846	18 567	
Emerald Resources NL	3 718	8 546	10 069	
EMS-Chemie Holding AG	1	921	1 067	
Evonik Industries AG	1 148	30 304	30 935	
Firefinch Ltd.	2 091	2 355	224	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	800	4 310	3 203	
Geostr Corp.	100	427	277	
Gerdau SA, CAAE	218	1 527	1 394	
Gold Road Resources Ltd.	5 392	8 807	9 533	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	200	5 351	5 808	
Harima Chemicals Group Inc.	200	1 798	1 523	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	200	1 746	2 009	
Huhtamaki Oyj	66	2 903	3 531	
JSP Corp.	200	3 212	3 427	
Jupiter Mines Ltd.	1 930	423	287	
K+S AG	1 649	37 265	34 372	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	400	2 808	3 318	
Konoshima Chemical Co., Ltd.	100	1 703	1 308	
Koza Anadolu Metal Madencilik Isletmeleri AS	4 638	9 163	8 784	
Krakatau Steel Persero Tbk PT	142 700	4 035	1 735	
Kunimine Industries Co., Ltd.	200	2 056	1 861	
Kureha Corp.	300	8 483	8 081	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kurimoto Ltd.	600	13 011	17 228	
Kuriyama Holdings Corp.	100	878	843	
LANXESS AG	874	30 340	36 117	
Loma Negra Cia Industrial Argentina SA	2 007	17 891	18 763	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	431	
Malayan Cement Bhd	600	723	728	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	800	3 631	4 138	
Mitsubishi Steel Manufacturing Co., Ltd.	300	3 942	4 153	
Moriroku Holdings Co., Ltd.	100	1 906	2 602	
Neturen Co., Ltd.	700	4 937	6 298	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	300	3 103	3 193	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	500	6 697	6 692	
Nippon Kayaku Co., Ltd.	200	2 475	2 517	
Nippon Steel Corp.	100	2 967	3 021	
Nippon Yakin Kogyo Co., Ltd.	400	16 198	15 769	
Nitto Denko Corp.	200	17 509	19 735	
Norsk Hydro ASA	1 055	8 543	9 369	
Northern Star Resources Ltd.	620	6 802	7 615	
Okamoto Industries Inc.	100	3 912	4 653	
Ora Banda Mining Ltd.	3 289	379	710	
Orora Ltd.	2 741	7 820	6 412	
Osaka Steel Co., Ltd.	100	1 310	2 316	
Outokumpu Oyj	6 934	42 815	45 289	
Oyak Cimento Fabrikalari AS	1 940	4 900	4 803	
Perimeter Solutions SA	307	1 343	1 862	
POSCO Holdings Inc., NYSE	1 249	147 934	156 640	
Ramelius Resources Ltd.	11 463	16 005	17 379	
Riken Technos Corp.	200	1 205	1 583	
Sakata INX Corp.	300	3 658	3 810	
Salzgitter AG	226	11 223	9 217	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	200	8 244	7 922	
Sasol Ltd., CAAE	885	12 187	11 600	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	600	2 437	2 727	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	100	1 394	1 679	
Silver Lake Resources Ltd.	7 402	6 548	7 925	
Solvay SA	125	4 967	5 049	
Stalprodukt SA	100	9 588	8 081	
Stanmore Resources Ltd.	3 620	11 332	13 061	
STO SE & Co KGaA	24	6 457	4 887	
Sumitomo Seika Chemicals Co., Ltd.	100	4 303	4 667	
Takasago International Corp.	200	5 689	6 528	
Tayca Corp.	100	1 204	1 280	
Ten Sixty Four Ltd.	825	457	212	
Thyssenkrupp AG	7 760	79 032	71 346	
Tokuyama Corp.	100	2 063	2 236	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	2 700	41 169	43 663	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	100	1 878	3 858	
Topy Industries Ltd.	200	4 022	4 779	
Trinseo PLC	185	2 076	2 042	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	3 000	690	517	
TYK Corp.	200	686	799	
Vertex Corp.	400	5 451	5 971	
Vetropack Holding AG	183	10 383	11 210	
Wacker Chemie AG	283	52 260	47 117	
West African Resources Ltd.	571	465	486	
Westgold Resources Ltd.	995	1 820	1 952	
Wienerberger AG	1 341	51 047	59 029	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	100	863	1 534	
Zignago Vetro SpA	25	617	519	
		1 132 769	1 165 104	4,94
Industries (31 décembre 2022 : 7,25 %)				
2020 Bulkers Ltd.	33	523	521	
AddTech AB	700	6 490	20 278	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Advan Group Co., Ltd.	200	1 866	2 005	
AerCap Holdings NV	676	64 599	66 247	
AFRY AB	68	987	1 243	
AG Anadolu Grubu Holding AS	79	689	709	
Aida Engineering Ltd.	100	849	772	
Ajis Co., Ltd.	100	2 406	2 140	
Alinco Inc.	500	5 323	4 686	
Alstom SA	6	168	106	
Amadeus Fire AG	1	277	179	
AMSC ASA	114	385	398	
ANE Cayman Inc.	5 000	5 604	4 720	
Anest Iwata Corp.	300	3 117	3 112	
APM Human Services International Ltd.	878	919	968	
AQ Group AB	106	4 837	7 032	
Arcadis NV	256	17 393	18 212	
Aspo Oyj	300	3 954	2 613	
Austal Ltd.	7 603	12 847	13 887	
Babcock International Group PLC	3 971	21 436	26 367	
Bando Chemical Industries Ltd.	500	5 696	7 253	
Befesa SA	160	11 367	8 204	
Beijer Alma AB	198	5 442	4 922	
Beijing Urban Construction Design & Development Group Co., Ltd.	7 000	2 721	2 340	
Benefit Systems SA	18	6 357	11 770	
Bertrandt AG	221	15 689	16 546	
Bilfinger SE	39	2 245	1 978	
Blue Bird Tbk PT	89 000	15 441	13 643	
Bodycote PLC	142	2 193	1 419	
Bunka Shutter Co., Ltd.	200	2 246	2 623	
Burckhardt Compression Holding AG	13	9 703	10 326	
Burkhalter Holding AG	62	7 251	9 004	
Cargotec Oyj	147	8 840	11 284	
Cebu Air Inc.	800	773	619	
Central Glass Co., Ltd.	100	2 623	2 493	
Central Security Patrols Co., Ltd.	200	4 563	4 766	
Cewe Stiftung & Co KGAA	4	695	590	
Chilled & Frozen Logistics Holdings Co., Ltd.	100	1 300	1 353	
Chin Hin Group Bhd	3 400	4 391	3 444	
China Lesso Group Holdings Ltd.	1 000	731	689	
China Yuchai International Ltd.	474	6 595	5 238	
Chiyoda Corp.	700	2 788	2 233	
Chiyoda Integre Co., Ltd.	100	2 336	2 617	
CIMC Vehicles Group Co., Ltd.	3 000	3 455	3 511	
Cimpress PLC	104	6 305	10 978	
CK Hutchison Holdings Ltd.	1 000	6 950	7 067	
Corp America Airports SA	2 987	30 092	63 255	
Cosel Co., Ltd.	300	3 414	3 858	
Costamare Inc.	387	5 436	5 312	
CTS Co., Ltd.	300	1 950	1 824	
D/S Norden A/S	306	18 744	19 193	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	100	576	921	
Dai-Ichi Cutter Kogyo KK	600	7 188	7 408	
Daiseki Eco. Solution Co., Ltd.	100	935	1 016	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	247	6 758	7 807	
Denyo Co., Ltd.	100	1 736	2 170	
Derichebourg SA	1 214	14 865	8 983	
Deutz AG	1 223	9 342	8 551	
Dfds A/S	31	1 359	1 351	
DiscoverIE Group PLC	17	351	226	
DO & CO AG	3	566	587	
Dormakaba Holding AG	1	730	711	
Duerr AG	55	1 864	1 713	
Elanders AB	83	2 028	1 043	
Emeco Holdings Ltd.	1 670	998	1 007	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
En Japan Inc.	100	3 871	2 549	
Enka Insaat ve Sanayi AS	–	–	–	
Eolus Vind AB	207	2 310	2 402	
ERI Holdings Co., Ltd.	200	2 790	3 203	
Eurogroup Laminations SpA	4	32	23	
EVA Precision Industrial Holdings Ltd.	34 000	6 017	4 536	
F&M Co., Ltd.	300	6 175	5 592	
Fagerhult Group AB	50	380	432	
FANUC Corp.	700	25 051	27 151	
Firstgroup PLC	757	1 229	2 227	
Fiverr International Ltd.	364	14 552	13 065	
Forbo Holding AG	1	2 000	1 651	
Frencken Group Ltd.	2 400	2 419	3 239	
Fudo Tetra Corp.	100	1 661	2 115	
Fugro NV	498	11 810	12 578	
Fujitec Co., Ltd.	100	3 051	3 345	
Fukushima Galilei Co., Ltd.	100	5 194	4 564	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	100	2 407	1 714	
Furukawa Co., Ltd.	100	1 338	1 784	
Furukawa Electric Co., Ltd.	700	16 192	14 515	
Gecoss Corp.	300	2 665	2 971	
Genco Shipping & Trading Ltd.	42	885	919	
Grab Holdings Ltd.	839	3 875	3 728	
GS Yuasa Corp.	100	1 881	1 857	
GT Capital Holdings Inc.	80	1 122	1 124	
Harbin Electric Co., Ltd.	2 000	1 275	699	
Heidelberger Druckmaschinen AG	2 695	7 085	4 864	
Hino Motors Ltd.	2 400	12 014	10 402	
Hirakawa Hewtech Corp.	300	4 602	3 712	
Hitachi Zosen Corp.	1 300	9 401	11 393	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	300	2 294	2 868	
Horizon Construction Development Ltd.	518	389	402	
Huber + Suhner AG	3	350	320	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	100	1 302	1 463	
IHI Corp.	1 300	35 129	33 571	
IJM Corp. Bhd	11 800	5 195	6 366	
Implenia AG	11	680	526	
Inaba Seisakusho Co., Ltd.	100	1 460	1 372	
Instalco AB	97	537	519	
Itoki Corp.	100	834	1 260	
Iveco Group NV	1 242	15 739	14 737	
Iwaki Co., Ltd.	100	1 282	1 943	
Japan Transcity Corp.	100	748	574	
JK Holdings Co., Ltd.	400	4 016	3 880	
Johnson Controls International PLC	420	30 479	31 922	
Kamei Corp.	100	1 306	1 599	
Kanamoto Co., Ltd.	200	4 580	5 473	
Kardex Holding AG	10	3 276	3 415	
Kato Works Co., Ltd.	400	4 328	4 733	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	200	7 259	12 215	
Keihin Co., Ltd.	100	1 679	1 640	
Keppel Ltd.	2 500	17 283	17 668	
Kimura Unity Co., Ltd.	100	1 025	1 252	
Kinki Sharyo Co., Ltd.	100	1 915	1 635	
KION Group AG	488	23 834	27 487	
Kitano Construction Corp.	100	3 135	2 965	
Kokuyo Co., Ltd.	300	6 449	6 437	
Komatsu Ltd.	300	10 508	10 348	
Kondotec Inc.	100	1 011	1 082	
Konecranes Oyj	448	22 366	26 611	
Kongsberg Gruppen ASA	759	42 208	45 864	
Koninklijke BAM Groep NV	3 324	13 109	11 707	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	1 700	12 642	10 860	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
KRS Corp.	200	1 853	1 691	
Kurita Water Industries Ltd.	400	17 349	20 652	
Kyodo Printing Co., Ltd.	100	2 839	3 021	
Lindab International AB	518	12 974	13 494	
Lonking Holdings Ltd.	27 000	9 083	5 562	
Luxfer Holdings PLC	44	533	519	
Mader Group Ltd.	170	1 126	1 048	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	300	3 033	3 718	
Makita Corp.	100	3 423	3 638	
MARUKA FURUSATO Corp.	100	2 784	2 463	
Matsui Construction Co., Ltd.	300	2 046	2 351	
McMillan Shakespeare Ltd.	302	4 478	4 337	
Meier Tobler Group AG	147	5 916	8 510	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	100	1 080	1 309	
Metso Oyj	2 940	38 374	39 270	
Mirai Industry Co., Ltd.	200	3 831	6 098	
MISUMI Group Inc.	2 300	51 376	51 403	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	1 400	4 440	4 400	
Mitie Group PLC	1 698	1 979	2 834	
Mitsubishi Kakoki Kaisha Ltd.	300	7 140	9 133	
Mitsui OSK Lines Ltd.	500	18 535	21 124	
Monadelphous Group Ltd.	434	4 982	5 795	
Montana Aerospace AG	170	3 944	4 704	
Mota-Engil SGPS SA	1 073	6 094	6 189	
MPC Container Ships ASA	3 100	7 191	5 363	
Muhibbah Engineering M Bhd	10 000	2 068	2 224	
Multiconsult ASA	51	956	821	
Nabtesco Corp.	900	22 204	24 222	
Nachi-Fujikoshi Corp.	100	3 868	3 437	
Nakabayashi Co., Ltd.	300	1 473	1 543	
Nakano Corp.	500	1 901	2 203	
NEL ASA	8 282	12 112	7 409	
NGK Insulators Ltd.	200	3 191	3 153	
Nibe Industrier AB	567	6 716	5 252	
Nice Corp.	300	4 168	4 773	
Nichireki Co., Ltd.	100	1 520	2 260	
NIDEC Corp.	800	52 114	42 613	
Nihon M&A Center Holdings Inc.	1 400	9 278	10 183	
Nikkiso Co., Ltd.	1 200	11 115	11 560	
Nilfisk Holding A/S	277	7 347	6 398	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 527	
Nippon Dry-Chemical Co., Ltd.	500	9 075	13 076	
Nippon Sharyo Ltd.	86	1 783	1 655	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	800	4 850	4 295	
Nippon Thompson Co., Ltd.	800	4 784	4 220	
Nissin Corp.	100	1 840	2 245	
Nitta Corp.	49	1 779	1 684	
Nitto Kogyo Corp.	600	15 077	20 203	
Nitto Kohki Co., Ltd.	200	3 380	3 492	
Nitto Seiko Co., Ltd.	500	2 960	2 460	
Nitto Construction Co., Ltd.	100	1 010	992	
NKT A/S	150	10 766	13 594	
Nordex SE	1 303	22 794	19 739	
NRW Holdings Ltd.	536	1 168	1 437	
NTN Corp.	3 900	10 813	9 484	
Ochi Holdings Co., Ltd.	200	2 446	2 724	
Okabe Co., Ltd.	100	775	685	
Okamura Corp.	200	3 885	4 078	
Pacific Basin Shipping Ltd.	1 008	455	437	
Pegasus Co., Ltd.	400	2 152	1 672	
Pegasus Hava Tasimaciligi AS	169	5 418	4 901	
People Dreams & Technologies Group Co., Ltd.	300	4 576	4 851	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	63	2 864	3 970	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Persol Holdings Co., Ltd.	12 600	27 486	28 531	
PKP Cargo SA	1 331	6 727	6 507	
Pronexus Inc.	100	1 007	1 232	
Prysmian SpA	61	3 229	3 658	
PS Mitsubishi Construction Co., Ltd.	600	4 376	4 961	
Punch Industry Co., Ltd.	300	1 534	1 150	
Qinhuangdao Port Co., Ltd., HKG	6 500	1 150	1 471	
Quick Co., Ltd.	300	5 646	7 234	
Raito Kogyo Co., Ltd.	200	3 717	3 535	
Rejlers AB	51	1 047	817	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	321	1 021	1 279	
Renewi PLC	92	1 251	988	
Rix Corp.	100	2 817	3 175	
Safe Bulkers Inc.	1 261	6 650	6 535	
Sakai Moving Service Co., Ltd.	400	8 928	10 176	
Salcef Group SpA	86	1 957	3 088	
Sanko Gosei Ltd.	700	3 867	3 234	
Sankyo Tateyama Inc.	200	1 348	1 465	
Sansei Technologies Inc.	100	843	1 077	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	1 000	10 467	12 384	
Sanyo Denki Co., Ltd.	100	6 926	5 864	
Sanyo Electric Railway Co., Ltd.	200	4 263	4 072	
Sanyo Trading Co., Ltd.	700	8 085	7 830	
Sato Shoji Corp.	200	2 506	2 725	
Sdiptech AB	168	5 188	5 931	
Seikitokyu Kogyo Co., Ltd.	200	1 669	3 087	
Seiko Electric Co., Ltd.	400	4 087	4 123	
Seino Holdings Co., Ltd.	200	3 814	3 999	
Senior PLC	264	710	788	
Sensata Technologies Holding PLC	2 189	110 768	108 443	
SG Fleet Group Ltd.	194	357	410	
SGL Carbon SE	1 092	10 755	10 355	
Shibaura Machine Co., Ltd.	300	11 531	9 709	
Shibusawa Warehouse Co., Ltd.	100	2 289	2 724	
Shibuya Corp.	200	5 036	4 570	
Shimojima Co., Ltd.	100	1 068	1 205	
Shin Nippon Air Technologies Co., Ltd.	100	1 936	2 231	
Siemens Energy AG	9 094	209 021	158 956	
SIG PLC	441	358	248	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	100	1 614	1 948	
Singapore Airlines Ltd.	1 400	9 904	9 181	
Sinko Industries Ltd.	200	4 626	4 995	
Sinotruk Hong Kong Ltd.	6 500	16 430	16 816	
Sintokogio Ltd.	100	845	997	
SmartGroup Corp. Ltd.	1 174	9 423	9 211	
Sodick Co., Ltd.	200	1 503	1 364	
Solar A/S	115	10 484	10 449	
Space Co., Ltd.	300	2 971	2 615	
Speedy Hire PLC	317	380	175	
SThree PLC	45	374	316	
Stolt-Nielsen Ltd.	59	1 396	2 386	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 737	4 177	
Sulzer AG	20	2 536	2 692	
Sumiseki Holdings Inc.	500	3 789	5 121	
Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	100	2 444	2 565	
Surya Semesta Internusa Tbk PT	185 200	7 843	6 883	
SWCC Corp.	100	1 866	2 674	
Takashima & Co., Ltd.	800	5 812	8 755	
Techtronic Industries Co., Ltd.	1 000	13 988	15 713	
Teikoku Electric Manufacturing Co., Ltd.	100	2 553	2 756	
Tekken Corp.	200	3 807	3 754	
Thoresen Thai Agencies PCL	5	1	1	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	25	3	2	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tobishima Corp.	100	1 046	1 225	
Toenec Corp.	100	3 599	4 274	
Tokyo Energy & Systems Inc.	300	2 745	2 935	
Tokyo Sangyo Co., Ltd.	300	2 329	2 349	
Toli Corp.	600	1 726	1 790	
Tonami Holdings Co., Ltd.	100	4 144	4 223	
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	400	6 352	8 440	
TOTO Ltd.	500	17 365	17 364	
Toyo Engineering Corp.	700	5 074	5 153	
Toyo Machinery & Metal Co., Ltd.	100	655	642	
Tsugami Corp.	1 000	11 772	11 364	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	100	812	1 256	
Turk Hava Yollari AO	11 248	125 879	114 800	
Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	352	11 523	11 190	
Union Tool Co.	100	3 316	3 124	
Valmet Oyj	1 293	52 958	49 175	
Ventia Services Group Pty Ltd.	1 366	3 263	3 859	
Volex PLC	63	416	338	
Volution Group PLC	50	356	364	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 686	13 024	19 483	
Wartsila OYJ Abp	1 657	25 629	31 678	
WDB Holdings Co., Ltd.	100	2 083	2 070	
Webuild SpA, bons de souscription	19	–	51	
Weichai Power Co., Ltd.	31 000	71 007	68 262	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	271	9 736	12 825	
Will Group Inc.	300	3 400	3 244	
Xinyi Glass Holdings Ltd.	1 000	1 469	1 479	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	300	4 250	4 801	
Yamaura Corp.	600	6 839	7 902	
Yasuda Logistics Corp.	100	964	1 097	
Yuasa Trading Co., Ltd.	100	3 972	4 433	
Yurtec Corp.	300	2 489	3 154	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	400	2 772	2 495	
Zehnder Group AG	18	1 943	1 509	
Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co., Ltd., HKG	1 000	1 338	1 445	
Zumtobel Group AG	71	649	649	
		2 307 252	2 348 962	9,97
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 6,58 %)				
888 Holdings PLC	80	368	128	
Accent Group Ltd.	720	1 319	1 257	
Ahresty Corp.	500	2 878	3 292	
Aisan Industry Co., Ltd.	300	2 855	3 303	
Alpha Corp.	200	2 197	2 563	
Aptiv PLC	128	13 434	15 143	
Arcos Dorados Holdings Inc.	3 268	42 396	54 684	
Aristocrat Leisure Ltd.	1	35	37	
Asics Corp.	400	17 533	16 529	
Astra Otoparts Tbk PT	25 700	6 848	5 194	
Auto1 Group SE	351	3 314	3 317	
Avantia Co., Ltd.	500	4 135	4 115	
Baroque Japan Ltd.	300	2 397	2 306	
Beneteau SACA	25	521	454	
Bermaz Auto Bhd	35 300	22 619	23 906	
Betsson AB	471	3 675	6 686	
Bijou Brigitte AG	100	4 622	5 841	
Bloomerry Resorts Corp.	58 100	9 515	13 614	
Bookoff Group Holdings Ltd.	100	1 279	1 066	
Boozt AB	232	3 278	4 107	
Breville Group Ltd.	66	1 415	1 617	
Bronco Billy Co., Ltd.	100	2 429	2 979	
Calida Holding AG	100	3 945	4 606	
Card Factory PLC	4 775	4 986	8 653	
Carnival Corp.	1 995	34 012	48 771	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CCC SA	119	2 454	2 441	
CECONOMY AG	1 231	5 076	4 440	
Central Automotive Products Ltd.	300	8 796	11 687	
Cettire Ltd.	2 351	6 261	6 134	
China Dongxiang Group Co., Ltd.	39	3	2	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	499	527	247	
CIR SpA-Compagnie Industriali	735	459	461	
Clas Ohlson AB	1 263	12 684	26 110	
Corona Corp.	100	921	891	
Corporate Travel Management Ltd.	582	10 043	10 243	
Crystal International Group Ltd.	1 000	279	490	
Currys PLC	374	842	317	
Dainichi Co., Ltd.	100	711	660	
DD GROUP Co., Ltd.	600	4 702	7 279	
Delivery Hero SE	83	2 939	3 024	
Despegar.com Corp.	306	2 351	3 817	
Dharma Polimetal Tbk PT	149 600	20 983	18 193	
D'ieteren Group	54	7 024	13 914	
Dor Alon Energy in Israel 1988 Ltd.	31	1 470	817	
Dynam Japan Holdings Co., Ltd.	4 000	5 369	2 580	
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 000	1 554	1 709	
Ferrari NV	173	70 245	76 908	
First Juken Co., Ltd.	200	2 112	1 949	
Fleetwood Ltd.	278	461	450	
Forvia SE	3	72	90	
F-Tech Inc.	300	2 374	1 790	
Fuji Corp. Ltd.	300	1 933	1 984	
FuKoKu Co., Ltd.	400	4 797	5 024	
Futaba Industrial Co., Ltd.	500	2 440	3 788	
G8 Education Ltd.	677	716	719	
Gajah Tunggal Tbk PT	34 600	2 417	3 067	
Gakkyusha Co., Ltd.	100	2 051	1 885	
Geely Automobile Holdings Ltd.	8 000	11 527	11 604	
Giordano International Ltd.	6 000	1 671	2 675	
Global Digital Niaga Tbk PT	156 546	6 197	6 462	
GLOBERIDE Inc.	200	4 961	3 754	
Great Wall Motor Co., Ltd.	8 500	16 550	14 555	
Greggs PLC	9	339	394	
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	44 000	28 842	26 971	
H & M Hennes & Mauritz AB	9 688	183 809	223 882	
Hagihara Industries Inc.	200	2 605	2 701	
Hard Off Corp. Co., Ltd.	100	1 303	1 569	
Hi-Lex Corp.	300	3 542	3 813	
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd., HKG	4 000	4 935	11 388	
H-One Co., Ltd.	300	2 088	2 211	
Hoteles City Express SAB de CV	9 059	5 433	4 183	
IBJ Inc.	100	707	664	
Ichikoh Industries Ltd.	700	3 229	3 313	
IJTT Co., Ltd.	200	1 154	1 609	
Imasen Electric Industrial	500	3 778	3 115	
JS Global Lifestyle Co., Ltd.	4 500	949	1 178	
Jumbo Interactive Ltd.	45	522	563	
KeyHolder Inc.	700	6 757	5 316	
Ki-Star Real Estate Co., Ltd.	200	5 764	5 883	
Koito Manufacturing Co., Ltd.	300	6 449	6 166	
Komatsu Matere Co., Ltd.	400	2 809	2 993	
Konaka Co., Ltd.	500	1 776	1 889	
Lastminute.com NV	249	9 693	9 089	
LPP SA	3	12 556	16 287	
Matas A/S	101	2 004	2 277	
Matsuoka Corp.	100	1 467	1 356	
MC Group PCL	1 000	381	510	
Meiwa Estate Co., Ltd.	300	3 154	3 412	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Mikuni Corp.	800	2 834	3 285	
MINISO Group Holding Ltd.	2 137	69 072	57 484	
Mitra Adiperkasa Tbk PT	28 400	4 196	4 354	
Mitra Pinasthika Mustika Tbk PT	181 300	17 662	16 303	
Mitsuba Corp.	400	2 533	3 666	
Morito Co., Ltd.	500	5 682	6 009	
MrMax Holdings Ltd.	300	2 048	1 754	
Musashi Seimitsu Industry Co., Ltd.	100	1 499	1 412	
Myer Holdings Ltd.	1 503	955	811	
Nexteer Automotive Group Ltd.	14 000	12 495	11 655	
Nichirin Co., Ltd.	100	2 420	3 058	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	200	1 916	2 248	
Nippon Seiki Co., Ltd.	100	832	1 073	
Nissan Motor Co., Ltd.	1 700	9 080	8 812	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	400	1 437	1 725	
Nobia AB	1 071	1 665	1 541	
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	609	13 026	16 093	
OneSpaWorld Holdings Ltd.	214	3 260	3 979	
Onward Holdings Co., Ltd.	200	1 001	900	
Open House Group Co., Ltd.	1 300	49 704	50 861	
OVS SpA	187	515	618	
Panasonic Holdings Corp.	1 400	18 100	18 286	
Pandora A/S	497	79 624	90 625	
Paris Miki Holdings Inc.	100	323	481	
Playtech PLC	1 661	17 936	12 525	
PRADA SpA	300	2 876	2 262	
Rakuten Group Inc.	7 200	35 587	42 291	
Reject Shop Ltd.	14	55	69	
Roland Corp.	100	3 956	4 120	
SAF-Holland SE	61	980	1 351	
Samsonite International SA	300	1 380	1 304	
San Holdings Inc.	200	2 306	2 076	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	300	1 581	2 020	
Sanlorenzo SpA	8	397	494	
Scandic Hotels Group AB	459	2 746	2 788	
Shikibo Ltd.	100	1 058	1 024	
Shoei Co., Ltd.	100	1 719	1 721	
Silver Life Co., Ltd.	100	1 263	835	
SISB PCL	10 400	8 545	14 263	
Skyworth Group Ltd.	12 000	5 016	6 039	
SNT Corp.	500	1 235	1 230	
Sogefi SpA	976	1 405	2 907	
SPK Corp.	200	3 493	3 455	
SSI Group Inc.	28 000	1 951	1 514	
Stella International Holdings Ltd.	6 000	12 962	9 332	
Step Co., Ltd.	200	3 864	3 524	
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	500	7 862	7 164	
Suncall Corp.	600	3 678	2 525	
Super Retail Group Ltd.	992	10 911	14 076	
Synsam AB	448	2 420	2 685	
Tachikawa Corp.	200	2 301	2 604	
Tachi-S Co., Ltd.	600	9 569	10 090	
Teknosa Ic Ve Dis Ticaret AS	7 021	11 954	9 310	
Texwinca Holdings Ltd.	8 011	1 855	1 299	
Toa Corp. /Hyogo	100	855	967	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	500	2 276	2 081	
Topre Corp.	500	7 574	8 783	
Topsports International Holdings Ltd.	1 000	1 088	1 027	
TPR Co., Ltd.	300	4 122	4 781	
Tsukada Global Holdings Inc.	500	2 083	1 772	
Tsutsumi Jewelry Co., Ltd.	200	4 263	4 276	
Valeo SE	685	22 984	13 884	
Van de Velde NV	21	1 029	1 032	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Vestel Beyaz Esya Sanayi ve Ticaret AS	1 593	1 154	1 138	
Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret AS	545	1 243	1 125	
Volkswagen AG, actions priv.	690	123 495	112 365	
Watches of Switzerland Group PLC	480	10 711	5 717	
Webjet Ltd.	6 532	41 561	43 138	
Xingda International Holdings Ltd.	2 000	550	490	
Yamaha Corp.	1 000	36 319	30 463	
Yokohama Rubber Co., Ltd.	200	5 811	6 048	
Yossix Holdings Co., Ltd.	100	2 281	2 542	
Zalando SE	47	1 530	1 468	
		1 449 691	1 546 087	6,56
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 2,39 %)				
111 Inc.	1 226	4 676	2 506	
Adecoagro SA	2 975	40 478	43 543	
Agthia Group PJSC	3 084	6 388	5 403	
Albis Co., Ltd.	200	4 856	4 912	
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	920	5 392	5 648	
Artnature Inc.	800	6 316	5 993	
Aryzta AG	8 525	13 176	20 729	
Asahi Group Holdings Ltd.	200	9 941	9 836	
Axial Retailing Inc.	100	3 487	3 886	
Bahvest Resources Bhd	2 900	408	416	
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	1	15 901	15 808	
Colruyt Group N.V	126	7 434	7 488	
Create SD Holdings Co., Ltd.	100	3 514	2 867	
DocMorris AG	54	4 796	6 239	
Eco's Co., Ltd.	200	3 844	4 512	
Eurocash SA	1 487	6 681	8 302	
Grupo Herdez SAB de CV	500	1 849	1 795	
Haad Thip PCL	600	380	382	
Halows Co., Ltd.	200	6 405	8 025	
Herbalife Ltd.	1 652	32 427	33 241	
Inghams Group Ltd.	1 756	5 471	6 257	
Kenko Mayonnaise Co., Ltd.	100	1 343	1 589	
Kobayashi Pharmaceutical Co., Ltd.	100	5 993	6 351	
Lacto Japan Co., Ltd.	100	1 843	1 795	
Medical System Network Co., Ltd.	200	816	1 214	
Mitsui DM Sugar Holdings Co., Ltd.	300	6 264	8 336	
Ontex Group NV	2 484	26 188	27 516	
Orior AG	75	8 971	8 472	
Redcare Pharmacy NV	67	10 429	12 843	
Sappe PCL	1 500	2 252	5 012	
Shinnihonseyaku Co., Ltd.	200	2 995	3 219	
Shiseido Co., Ltd.	2 000	80 479	79 539	
Sok Marketler Ticaret AS	1 839	5 301	4 430	
ST Corp.	100	1 626	1 428	
Taokaenoi Food & Marketing PCL	800	391	294	
Torigoe Co., Ltd.	100	616	611	
Transaction Co., Ltd.	300	4 381	5 991	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	88	164	106	
		343 872	366 534	1,56
Soins de santé (31 décembre 2022 : 5,89 %)				
AddLife AB	300	4 243	4 294	
Alkermes PLC	730	25 735	26 702	
Alphamab Oncology	1 000	1 168	1 121	
Ambea AB	1 069	5 680	7 357	
Ambu A/S	641	11 995	13 176	
Arjo AB	1 033	5 525	5 325	
Ascom Holding AG	152	2 452	1 957	
Attendo AB	200	560	945	
Austar Lifesciences Ltd.	1 003	341	264	
Basilea Pharmaceutica AG	13	816	719	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Bayer AG	2 807	135 849	137 502	
BeiGene Ltd.	75	18 130	17 837	
Biotage AB	583	10 327	10 199	
BoneSupport Holding AB	321	7 098	7 904	
Calliditas Therapeutics AB	55	956	915	
Camurus AB	300	17 775	21 118	
Carna Biosciences Inc.	200	1 520	976	
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	7 000	8 864	8 594	
Consun Pharmaceutical Group Ltd.	6 000	4 243	4 833	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	200	7 231	7 243	
Daiken Medical Co., Ltd.	400	1 983	1 919	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	110	2 543	1 960	
Eisai Co., Ltd.	900	68 727	59 362	
El.En. SpA	225	3 766	3 195	
Elekta AB	3 602	35 325	38 797	
FALCO Holdings Co., Ltd.	200	4 075	3 906	
FINDEX Inc.	100	623	963	
Frontage Holdings Corp.	2 000	712	784	
Galenica AG	10	1 145	1 140	
Gerresheimer AG	54	6 979	7 421	
Grifols SA	885	12 469	13 490	
H Lundbeck A/S, cat. B	5 416	32 791	34 669	
Hartalega Holdings Bhd	600	473	465	
Humana AB	220	795	810	
HUTCHMED China Ltd., NASD	95	1 990	2 269	
Innovent Biologics Inc.	5 500	42 325	39 705	
Ion Beam Applications	122	3 202	2 051	
Japan Medical Dynamic Marketing Inc.	100	1 037	710	
JMS Co., Ltd.	200	1 043	941	
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	100	3 157	3 138	
Kiniksa Pharmaceuticals Ltd.	748	16 227	17 300	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	200	1 470	1 369	
Koninklijke Philips NV	5 482	141 890	168 366	
Koninklijke Philips NV, NYSE	1 773	46 022	54 543	
Kossan Rubber Industries Bhd	2 900	1 514	1 540	
Kyowa Kirin Co., Ltd.	1 700	38 734	37 684	
Linical Co., Ltd.	400	2 737	1 983	
LivaNova PLC	559	33 505	38 137	
M3 Inc.	500	10 434	10 910	
Medtecs International Corp. Ltd.	2 900	582	538	
Menicon Co., Ltd.	400	11 516	8 788	
Merck KGaA	17	3 511	3 568	
Metall Zug AG	7	18 014	16 724	
Modern Dental Group Ltd.	4 000	1 008	2 905	
MoonLake Immunotherapeutics	21	1 193	1 672	
MorphoSys AG	294	12 015	14 560	
Mural Oncology PLC	88	2 019	687	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	771	13 538	17 322	
Nipro Corp.	500	5 126	5 177	
Novartis AG	106	14 014	14 113	
Novo Nordisk A/S	1 449	169 505	197 652	
Novo Nordisk A/S, CAAE	200	27 103	27 282	
Novocure Ltd.	1 397	55 438	27 502	
Olympus Corp.	2 500	44 818	47 713	
Opthea Ltd.	2 960	1 717	1 518	
Perrigo Co PLC	380	15 913	16 124	
Pharming Group NV	6 725	10 647	10 099	
Pro Medicus Ltd.	705	45 168	60 787	
Prothena Corp. PLC	194	14 089	9 296	
RaySearch Laboratories AB	77	764	910	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	151	10 192	10 740	
Rion Co., Ltd.	100	1 998	2 281	
Roivant Sciences Ltd.	2 688	39 829	39 804	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Seed Co., Ltd.	300	1 710	2 292	
Siegfried Holding AG	14	16 655	18 852	
SKAN Group AG	32	4 003	4 051	
Software Service Inc.	100	9 041	9 194	
Solasto Corp.	800	5 357	4 609	
Sosei Group Corp.	700	10 125	9 304	
St-Care Holding Corp.	200	1 549	1 865	
StemRIM Inc.	200	2 032	1 081	
Telix Pharmaceuticals Ltd.	3 180	28 814	28 841	
Tokai Corp.	100	1 933	1 955	
Top Glove Corp. Bhd	3 300	879	852	
UroGen Pharma Ltd.	104	1 831	2 057	
Vital KSK Holdings Inc.	200	1 821	1 953	
Volpara Health Technologies Ltd.	584	350	581	
Zai Lab Ltd.	225	8 226	8 108	
Zealand Pharma A/S	57	4 111	4 157	
		1 406 355	1 466 022	6,22
Services financiers (31 décembre 2022 : 6,87 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	2 464	2 207	2 175	
AEON Credit Service M Bhd	2 000	3 258	3 197	
Aizawa Securities Group Co., Ltd.	300	2 270	3 275	
Akbank TAS	16 840	27 767	27 458	
Akita Bank Ltd.	200	3 451	3 556	
Alior Bank SA	1 145	26 099	29 311	
Alliance International Education Leasing Holdings Ltd.	12 000	2 449	2 270	
Anadolu Anonim Turk Sigorta Sirketi	2 358	3 726	6 327	
Anadolu Hayat Emeklilik AS	3 960	9 249	6 736	
Anima Holding SpA	928	5 224	5 415	
Aozora Bank Ltd.	100	2 714	2 865	
Ashmore Group PLC	21	81	79	
Avanza Bank Holding AB	1 089	29 070	33 271	
B2 Impact ASA	5 091	5 313	4 858	
Banca Generali SpA	524	24 968	25 676	
Banca IFIS SpA	647	13 728	14 796	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	17 049	57 713	75 643	
Banco BPM SpA	7 257	44 209	50 538	
Banco Comercial Portugues SA	95 286	33 890	38 085	
Bank Hapoalim BM	1 825	20 663	21 726	
Bank Leumi Le-Israel BM	2 070	20 834	22 066	
Bank Millennium SA	1 947	4 946	5 455	
Bank of Georgia Group PLC	30	704	2 005	
Bank of Iwate Ltd.	200	4 418	4 678	
Bank of Nagoya Ltd.	100	3 202	5 088	
Bank of Queensland Ltd.	3 467	17 824	18 966	
Bank of Saga Ltd.	500	8 435	8 647	
Bank of the Ryukyus Ltd.	200	1 902	2 069	
Bank Polska Kasa Opieki SA	907	39 356	46 245	
Banque Cantonale Vaudoise	144	19 124	24 478	
BAWAG Group AG	822	54 559	57 448	
Berner Kantonalbank AG	45	13 690	16 638	
BPER Banca	413	1 851	1 820	
Cembra Money Bank AG	21	2 132	2 158	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	1 100	5 604	8 148	
China Life Insurance Co., Ltd., HKG	2 000	3 643	3 418	
China Pacific Insurance Group Co., Ltd.	10 000	33 193	26 613	
Credito Emiliano SpA	2 779	25 611	32 545	
Dah Sing Banking Group Ltd.	4 800	4 354	4 085	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 400	7 862	6 484	
Daishi Hokuetsu Financial Group Inc.	100	3 456	3 587	
Ehime Bank Ltd.	100	890	943	
Entrust Inc.	200	1 677	1 482	
EQT Holdings Ltd.	174	4 249	3 992	
EVERTEC Inc.	23	1 025	1 242	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Far East Horizon Ltd.	14 000	13 519	14 516	
FIBI Holdings Ltd.	22	1 312	1 269	
FIDEA Holdings Co., Ltd.	600	8 168	8 474	
First Bank of Toyama Ltd.	600	4 885	4 321	
FlatexDEGIRO AG	1 226	28 031	19 947	
Fukui Bank Ltd.	100	1 430	1 541	
Fukuoka Financial Group Inc.	100	3 169	3 112	
Futu Holdings Ltd.	443	35 601	31 912	
Genera SAB de CV	23 100	33 745	42 413	
Haitong UniTrust International Leasing Co., Ltd.	10 000	1 419	1 385	
Hargreaves Lansdown PLC	83	1 841	1 024	
Helia Group Ltd.	1 424	3 684	5 573	
Helvetia Holding AG	14	2 722	2 542	
Hi Sun Technology China Ltd.	6 000	1 374	527	
Hiscox Ltd.	28	428	496	
Hoist Finance AB	676	2 494	3 286	
HS Holdings Co., Ltd.	300	2 766	2 831	
HUB24 Ltd.	357	10 233	11 560	
Hyakugo Bank Ltd.	400	1 529	1 998	
Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	700	4 519	4 629	
iFAST Corp. Ltd.	1 700	13 116	13 952	
Impax Asset Management Group PLC	6	123	55	
Insurance Australia Group Ltd.	709	3 566	3 611	
International Personal Finance PLC	387	1 030	774	
Intesa Sanpaolo SpA	26 937	101 088	103 722	
Invesco Ltd.	5 853	110 107	137 685	
Investec PLC	41	309	367	
Is Yatirim Menkul Degerler AS	1 252	1 786	1 789	
ISX Financial EU Ltd.	45	–	–	
James River Group Holdings Ltd.	137	3 487	1 669	
Japan Post Insurance Co., Ltd.	1 200	26 511	28 104	
KB Financial Group Inc.	137	7 817	7 473	
Keiyo Bank Ltd.	1 400	7 592	8 917	
Kita-Nippon Bank Ltd.	200	3 836	3 958	
KRUK SA	65	10 186	10 397	
Krung Thai Bank PCL	1 600	898	1 137	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	400	2 574	3 797	
Luzerner Kantonalbank AG	15	1 819	1 692	
Matsui Securities Co., Ltd.	1 200	8 406	8 216	
mBank SA	35	5 871	6 279	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1 552	27 014	25 331	
Menora Mivtachim Holdings Ltd.	61	1 890	2 077	
Miyazaki Bank Ltd.	300	7 204	7 349	
Muangthai Capital PCL	1 400	2 325	2 434	
Musashino Bank Ltd.	100	2 461	2 494	
MyState Ltd.	1 739	5 160	4 913	
Navigator Global Investments Ltd.	1 524	1 707	1 741	
Netwealth Group Ltd.	788	8 941	10 919	
Ngern Tid Lor PCL	900	799	782	
Nib holdings Ltd.	2 094	14 489	13 923	
Ninety One PLC	442	1 629	1 363	
North Pacific Bank Ltd.	200	574	664	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	300	5 491	5 292	
Okinawa Financial Group Inc.	300	6 368	6 583	
OSB Group PLC	40	379	312	
Pacific Current Group Ltd.	100	723	791	
Ping An Insurance Group Co of China Ltd.	5 000	33 863	29 830	
Polar Capital Holdings PLC	23	352	180	
Poste Italiane SpA	268	4 054	4 011	
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	747	11 446	12 605	
Powszechny Zaklad Ubezpiezen SA	3 684	55 148	58 395	
Protector Forsikring ASA	755	15 501	17 645	
Raiffeisen Bank International AG	1 634	29 602	44 436	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Regional SAB de CV	900	9 094	11 372	
Resona Holdings Inc.	200	1 334	1 340	
Resurs Holding AB	299	945	934	
Ringkjoebing Landbobank A/S	90	16 948	17 436	
San ju San Financial Group Inc.	100	1 579	1 698	
Santander Bank Polska SA	162	22 976	26 608	
SBI Global Asset Management Co., Ltd.	500	2 579	2 853	
SBI Insurance Group Co., Ltd.	100	971	965	
Sekerbank Turk AS	6 378	2 073	1 224	
Sompo Holdings Inc.	1 200	71 751	77 399	
Spar Nord Bank A/S	598	12 279	12 456	
SpareBank 1 SMN	875	14 962	16 110	
Sparebanken Vest	921	10 884	13 082	
Sparx Group Co., Ltd.	200	2 671	3 015	
Srisawad Corp. PCL	1 700	2 752	2 660	
St Galler Kantonalbank AG	1	738	770	
Steadfast Group Ltd.	3 664	18 167	19 187	
Swissquote Group Holding SA	30	6 604	9 616	
Syarikat Takaful Malaysia Keluarga Bhd	3 500	3 755	3 716	
Sydbank AS	703	43 125	40 330	
Talanx AG	258	22 753	24 296	
Tamburi Investment Partners SpA	770	9 709	10 431	
TBC Bank Group PLC	324	9 231	15 413	
Thurgauer Kantonalbank	57	9 107	10 671	
Tochigi Bank Ltd.	200	558	580	
TOMONY Holdings Inc.	3 100	11 252	11 337	
Towa Bank Ltd.	300	1 615	1 700	
Traders Holdings Co., Ltd.	200	1 035	999	
Turkiye Sigorta AS	3 108	5 215	5 628	
UnipolSai Assicurazioni SpA	500	1 695	1 646	
UNIQA Insurance Group AG	65	725	706	
Valiant Holding AG	78	11 173	11 658	
Vaudoise Assurances Holding SA	4	2 320	2 757	
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	115	4 200	4 439	
VZ Holding AG	23	2 469	3 539	
Wuestenrot & Wuerttembergische AG	148	3 387	2 876	
Yamagata Bank Ltd.	200	2 246	1 998	
Yamanashi Chuo Bank Ltd.	100	1 341	1 572	
		1 658 919	1 803 594	7,65
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 5,79 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	400	5 071	6 742	
AAC Technologies Holdings Inc.	2 500	9 452	9 794	
Ai Holdings Corp.	300	6 366	6 563	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	100	1 518	2 193	
Alps Alpine Co., Ltd.	1 600	19 820	18 384	
Ambarella Inc.	599	55 592	48 409	
AOI Electronics Co., Ltd.	200	3 904	5 307	
Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	100	1 286	982	
ASM International NV	103	70 734	70 507	
Atled Corp.	200	2 999	2 686	
Atoss Software AG	12	2 790	3 653	
Audinate Group Ltd.	169	2 067	2 460	
Axell Corp.	100	1 739	2 018	
Barco NV	292	9 674	7 039	
BASE Inc.	100	313	228	
BE Semiconductor Industries NV	683	110 222	135 748	
Bechtle AG	418	26 629	27 636	
Bouvet ASA	1 143	8 890	9 038	
BrainPad Inc.	400	2 856	4 130	
Broadleaf Co., Ltd.	500	2 161	2 698	
Business Engineering Corp.	100	2 936	3 853	
BYD Electronic International Co., Ltd.	500	3 318	3 090	
CAC Holdings Corp.	200	3 196	3 253	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Camtek Ltd.	354	21 847	32 978	
cBrain A/S	91	3 050	4 783	
Cellebrite DI Ltd.	1 240	12 372	14 160	
China Electronics Huada Technology Co., Ltd.	12 000	3 151	2 736	
CMK Corp.	300	1 389	2 329	
Codan Ltd.	237	1 697	1 823	
Computer Engineering & Consulting Ltd.	300	3 981	4 397	
Computer Institute of Japan Ltd.	300	1 652	1 815	
Cresco Ltd.	200	3 581	3 590	
CyberArk Software Ltd.	359	71 361	103 693	
Daitron Co., Ltd.	100	2 743	2 620	
Data#3 Ltd.	90	545	683	
Datalogic SpA	234	2 625	2 304	
Delta Electronics Thailand PCL	400	1 242	1 360	
Ditto Thailand PCL	400	382	421	
Ebase Co., Ltd.	100	672	731	
Econocom Group SA	98	350	367	
Elastic NV	737	69 996	109 523	
Elmos Semiconductor SE	4	343	431	
Esker SA	35	12 860	8 137	
ESPEC Corp.	500	10 633	11 032	
FIT Hon Teng Ltd.	117 000	33 981	23 314	
Fortnox AB	93	707	734	
Forval Corp.	100	1 114	1 355	
Fujitsu Ltd.	300	51 256	59 696	
Fukui Computer Holdings Inc.	100	2 712	2 357	
GL Sciences Inc.	100	1 898	2 361	
Globetronics Technology BHD	11 700	4 203	5 439	
Hamamatsu Photonics KK	100	5 089	5 425	
Hana Microelectronics PCL	1 000	2 104	2 057	
Hochiki Corp.	200	3 178	3 268	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	200	2 857	2 550	
Hosiden Corp.	100	1 651	1 609	
Icom Inc.	100	2 960	3 367	
Indeks Bilgisayar Sistemleri Muhendislik Sanayi ve Ticaret	1 448	494	385	
I-Net Corp.	100	1 306	1 728	
Inficon Holding AG	3	4 889	5 668	
Infineon Technologies AG	258	14 471	14 205	
Infomedia Ltd.	2 932	3 878	3 799	
Innotech Corp.	300	4 326	4 717	
Intelligent Wave Inc.	200	1 440	1 953	
IRESS Ltd.	91	679	667	
Ituran Location and Control Ltd.	13	467	467	
Japan Electronic Materials Corp.	300	4 617	5 076	
JFrog Ltd.	89	3 278	4 062	
Kaga Electronics Co., Ltd.	100	3 495	5 733	
Kainos Group PLC	148	3 658	2 784	
KCE Electronics PCL	1 200	2 439	2 550	
Kingboard Holdings Ltd.	2 500	9 760	7 886	
Kitron ASA	620	2 945	2 697	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	200	876	883	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	400	1 896	1 508	
Lagercrantz Group AB	560	5 160	9 899	
LEM Holding SA	4	9 859	13 003	
LG Display Co., Ltd., CAAE	3 119	22 789	19 823	
LINK Mobility Group Holding ASA	4 778	6 074	11 266	
Macquarie Technology Group Ltd.	92	5 028	5 674	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	700	4 818	6 056	
Miraial Co., Ltd.	300	5 034	4 024	
Mycronic AB	64	1 956	2 407	
NCAB Group AB	246	2 541	2 358	
NCC Group PLC	98	493	212	
NEOJAPAN Inc.	500	4 609	4 770	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
NET One Systems Co., Ltd.	1 000	25 599	22 480	
Nihon Denkei Co., Ltd.	100	1 962	1 752	
Nippon Ceramic Co., Ltd.	100	2 759	2 624	
Nippon Chemi-Con Corp.	300	3 672	3 687	
Nova Ltd.	495	59 600	90 994	
NPC Inc.	200	1 398	1 399	
NSW Inc.	100	2 220	2 661	
NTT Data Group Corp.	700	12 066	13 088	
Oizumi Corp.	200	1 064	810	
Opton Co., Ltd.	300	6 233	4 576	
Osaki Electric Co., Ltd.	100	548	600	
Oxford Instruments PLC	9	270	347	
PAX Global Technology Ltd.	4 000	2 226	4 087	
Praemium Ltd.	7 884	4 724	2 767	
Proact IT Group AB	444	4 948	5 461	
Pro-Ship Inc.	100	1 328	1 282	
PVA TePla AG	29	774	862	
QT Group Oyj	48	4 221	4 510	
Radware Ltd.	638	22 376	14 032	
Renishaw PLC	47	3 518	2 827	
Restar Holdings Corp.	300	7 289	7 913	
Riskified Ltd.	368	2 304	2 271	
RPMGlobal Holdings Ltd.	1 698	2 162	2 674	
RYODEN Corp.	100	2 004	2 436	
SAES Getters SpA	24	1 198	1 190	
SB Technology Corp.	200	4 563	4 443	
Seagate Technology Holdings PLC	840	73 924	94 558	
Sensys Gatso Group AB	141	1 556	1 340	
Siltronic AG	121	13 405	15 589	
SMA Solar Technology AG	257	18 000	22 667	
Smart Eye AB	60	684	697	
Soliton Systems KK	200	2 167	2 604	
Southern Cross Payments Ltd.	1 850	1 362	–	
SUESS MicroTec SE	139	2 981	5 608	
SUMCO Corp.	1 200	23 388	23 733	
Sumida Corp.	100	1 245	1 078	
Sun Corp.	100	2 145	2 107	
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	2 400	29 047	28 714	
Sun-Wa Technos Corp.	100	2 071	2 054	
Suzuden Corp.	300	6 853	6 588	
Suzuki Co., Ltd.	700	7 184	7 182	
System Research Co., Ltd.	200	4 643	5 410	
System Support Inc.	100	1 915	1 802	
Tachibana Eletech Co., Ltd.	100	2 428	2 569	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	58	7 998	7 954	
Taiyo Yuden Co., Ltd.	1 500	52 876	52 331	
TAKEBISHI Corp.	100	1 756	1 792	
TeamViewer SE	528	12 202	10 813	
Technology One Ltd.	2 990	37 286	41 349	
Tecnos Japan Inc.	400	2 394	2 379	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	100	1 546	1 894	
Temenos AG	15	1 447	1 838	
TIS Inc.	1 400	41 868	40 684	
Tobii AB	1 295	6 846	998	
Tokyo Electron Ltd.	500	104 961	118 106	
Tomen Devices Corp.	100	5 476	5 013	
TomTom NV	325	3 598	3 023	
Tongda Group Holdings Ltd.	50 000	4 257	870	
Tower Semiconductor Ltd.	185	6 540	7 499	
Trend Micro Inc.	100	7 536	7 060	
Truly International Holdings Ltd.	14 000	1 913	1 891	
U-blox Holding AG	63	7 123	9 860	
Uchi Technologies Bhd	22 500	22 069	23 954	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Unisem M Bhd	3 800	3 316	3 609	
UNITED Inc.	200	1 253	1 684	
Venture Corp. Ltd.	500	6 974	6 802	
VINX Corp.	100	1 355	1 889	
Vista Group International Ltd.	565	708	778	
VTech Holdings Ltd.	100	851	796	
Wacom Co., Ltd.	100	629	615	
Wasion Holdings Ltd.	16 000	8 067	10 591	
Weimob Inc.	48 000	27 852	23 344	
WILLs Inc.	100	610	611	
Wix.com Ltd.	454	49 100	73 645	
Xero Ltd.	528	49 681	53 350	
Yashima Denki Co., Ltd.	100	1 307	1 238	
Yokowo Co., Ltd.	300	6 254	3 998	
		1 690 663	1 894 447	8,04
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,90 %)				
Alma Media Oyj	100	926	1 398	
Amuse Inc.	400	6 958	5 552	
APG SGA SA	29	7 232	8 314	
Asahi Net Inc.	500	2 976	2 881	
Ateam Inc.	100	806	537	
Aussie Broadband Ltd.	2 406	8 063	8 443	
Auto Trader Group PLC	48	562	582	
Avex Inc.	200	2 817	2 559	
Better Collective A/S	23	773	772	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	2 818	5 106	5 083	
Cairo Communication SpA	2 024	4 384	5 330	
CAR Group Ltd.	2 626	61 599	73 576	
Cellcom Israel Ltd.	100	443	542	
Chorus Ltd.	115	807	755	
Cloud Music Inc.	50	525	758	
Crazy Sports Group Ltd.	10 000	435	169	
Elisa Oyj	15	930	915	
G5 Entertainment AB	11	315	224	
Homeland Interactive Technology Ltd.	2 000	515	750	
Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd.	2 000	435	361	
IMAGICA Group Inc.	1 200	7 224	7 161	
IVE Group Ltd.	1 275	2 636	2 294	
Koninklijke KPN NV	24 225	113 301	110 022	
Liberty Global Ltd., cat. C	450	11 442	11 060	
Macromill Inc.	200	1 844	1 470	
Maoyan Entertainment	6 400	11 765	9 705	
Modern Times Group MTG AB	465	5 201	5 241	
Orange Polska SA	3 166	7 929	8 642	
Oricon Inc.	300	2 998	2 060	
Paradox Interactive AB	72	2 263	2 123	
Perion Network Ltd.	362	18 098	15 099	
Pico Far East Holdings Ltd.	18 000	4 556	4 681	
ProSiebenSat.1 Media SE	1 177	9 708	9 488	
Proto Corp.	200	2 297	2 529	
Reach PLC	106	717	133	
Sanoma Oyj	223	4 101	2 258	
Spark New Zealand Ltd.	1 618	6 763	6 997	
Storytel AB	73	415	385	
Taboola.com Ltd.	2 794	13 935	15 952	
Tele2 AB	691	7 100	7 824	
Telecom Italia SpA	30 220	11 253	12 950	
TPG Telecom Ltd.	564	2 637	2 629	
TX Group AG	53	9 180	10 031	
United Internet AG	495	11 194	16 612	
Zengame Technology Holding Ltd.	2 000	551	1 912	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Invendaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Zenrin Co., Ltd.	100	849	817	
		376 564	389 576	1,65
Services publics (31 décembre 2022 : 1,86 %)				
A2A SpA	1 505	4 376	4 075	
AGL Energy Ltd.	1 043	8 602	8 896	
Aygaz AS	321	2 204	1 935	
BKW AG	77	18 255	18 035	
Chubu Electric Power Co Inc.	1 100	18 568	18 740	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	293	696	896	
Encavis AG	587	13 657	13 330	
Enea SA	622	1 493	1 913	
Energa SA	691	1 695	2 169	
EVN AG	55	2 122	2 279	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	900	3 427	3 216	
Hokkaido Gas Co., Ltd.	100	1 995	2 060	
K&O Energy Group Inc.	300	6 453	6 226	
Kenon Holdings Ltd.	142	5 936	4 547	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 812	142	182	
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	6 150	17 790	17 896	
Scatec ASA	65	670	693	
Sembcorp Industries Ltd.	300	1 551	1 592	
Tauron Polska Energia SA	6 303	7 962	7 892	
Telecom Plus PLC	14	346	379	
Tohoku Electric Power Co Inc.	300	2 652	2 691	
Verbund AG	47	5 764	5 754	
YTL Corp. Bhd	26 600	11 131	14 427	
YTL Power International Bhd	24 500	13 282	17 858	
		150 769	157 681	0,67
Immobilier (31 décembre 2022 : 1,75 %)				
Aedifica SA	62	4 946	5 748	
Allreal Holding AG	49	11 344	11 546	
Amot Investments Ltd.	149	1 063	1 063	
AP Thailand PCL	2 300	963	1 004	
Aroundtown SA	20 277	34 954	73 100	
CA Immobilien Anlagen AG	753	35 249	35 592	
Catena AB	18	1 126	1 110	
Central Pattana PCL	500	1 286	1 352	
Citycon Oyj	87	686	659	
Concentradora Fibra Danhos SA de CV	4 400	7 530	7 181	
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	11 000	12 240	12 538	
Cushman & Wakefield PLC	682	8 034	9 712	
Eco World Development Group Bhd	24 100	6 481	7 262	
Fabege AB	1 041	10 446	14 737	
Fastighets AB Balder	1 469	7 613	13 747	
FastPartner AB	239	1 182	1 961	
G City Ltd.	89	404	388	
Grandy House Corp.	600	3 462	3 446	
Greentown China Holdings Ltd.	500	757	671	
Hammerson PLC	5 133	3 396	2 450	
HMC Capital Ltd.	109	580	604	
IMMOFINANZ AG	73	2 035	2 238	
Intershop Holding AG	1	975	964	
Investis Holding SA	76	7 010	11 621	
IOI Properties Group Bhd	11 100	4 492	5 574	
Katitas Co., Ltd.	300	5 995	6 142	
KE Holdings Inc., HKG	1 300	10 305	9 505	
Keihanshin Building Co., Ltd.	100	1 216	1 330	
Keppel DC REIT	800	1 464	1 559	
Keppel REIT	1 600	1 319	1 487	
Kojamo Oyj	208	3 273	3 605	
LBS Bina Group Bhd	14 600	2 430	2 409	
LEG Immobilien SE	22	2 325	2 542	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Lendlease Corp. Ltd.	2 393	15 243	16 084	
Leopalace21 Corp.	300	957	1 201	
Longfor Group Holdings Ltd.	13 500	31 745	28 496	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	3 200	1 656	1 657	
Mah Sing Group Bhd	52 700	11 092	12 552	
Meliron Ltd.	66	6 060	6 767	
Mivne Real Estate KD Ltd.	-	-	-	
NP3 Fastigheter AB	168	3 895	5 122	
NSI NV	62	1 858	1 694	
Origin Property PCLs	1 000	379	326	
OSK Holdings Bhd	11 500	3 704	4 092	
Peet Ltd.	88	90	100	
Property Perfect PCL	22 700	359	263	
PSP Swiss Property AG	202	32 064	37 217	
Rural Funds Group	4 475	7 445	8 536	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	200	7 831	7 267	
Seazen Group Ltd.	2 000	556	429	
Selvaag Bolig ASA	597	3 260	2 566	
Sirius Real Estate Ltd.	180	368	285	
SP Setia Bhd Group	3 100	813	712	
Stockland	1 874	6 764	7 503	
Summarecon Agung Tbk PT	51 800	3 270	2 551	
Swire Pacific Ltd.	4 000	30 719	44 648	
Swire Properties Ltd.	400	1 212	1 067	
Swiss Prime Site AG	103	13 301	14 499	
TAG Immobilien AG	546	8 539	10 494	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 959	
Torunlar Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	2 009	3 173	2 843	
Varia US Properties AG	156	10 154	9 287	
Wihlborgs Fastigheter AB	65	742	802	
		405 750	485 866	2,06
		11 669 307	12 418 632	52,69
Total des actions étrangères – position acheteur				
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -0,76 %)				
Aker BP ASA	(1 015)	(38 758)	(38 943)	
Beach Energy Ltd.	(1 522)	(2 024)	(2 191)	
BP PLC, CAAE	(1 029)	(49 599)	(48 032)	
Cooper Energy Ltd.	(26 011)	(4 164)	(3 042)	
CropEnergies AG	(1 410)	(25 083)	(23 619)	
Ecopetrol SA	(1 099)	(18 680)	(17 274)	
Eni SpA, MIL	(2 889)	(51 692)	(64 586)	
Eni SpA, NYSE	(1 601)	(62 562)	(71 798)	
Equital Ltd.	(643)	(22 482)	(26 136)	
OMV AG	(80)	(4 655)	(4 634)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(374)	(28 090)	(30 822)	
Scorpio Tankers Inc.	(7)	(537)	(561)	
Seadrill Ltd.	(20)	(1 200)	(1 243)	
Shell PLC, CAAE	(220)	(19 523)	(19 088)	
Strike Energy Ltd.	(928)	(367)	(401)	
Tenaris SA	(468)	(21 798)	(21 451)	
TGS ASA	(427)	(7 605)	(7 329)	
TotalEnergies SE	(1 330)	(121 802)	(118 167)	
Verbio Vereinigte Bioenergie AG	(394)	(24 627)	(17 148)	
		(505 248)	(516 465)	(2,19)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,42 %)				
Adbri Ltd.	(400)	(762)	(1 080)	
Aluflexpack AG	(189)	(5 365)	(2 650)	
Alumina Ltd.	(2 357)	(2 219)	(1 919)	
APERAM SA	(217)	(9 894)	(10 393)	
BASF SE	(2 953)	(195 482)	(209 819)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Capricorn Metals Ltd.	(1 622)	(6 269)	(6 874)	
Chalice Mining Ltd.	(3 270)	(10 884)	(4 987)	
Champion Iron Ltd.	(600)	(3 487)	(4 476)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(1 554)	(16 828)	(31 228)	
Constellium SE	(64)	(1 387)	(1 684)	
Core Lithium Ltd.	(6 928)	(4 716)	(1 558)	
Forterra PLC	(127)	(370)	(377)	
Hokutsu Corp.	(300)	(4 083)	(3 976)	
IGO Ltd.	(200)	(1 620)	(1 629)	
Kobe Steel Ltd.	(1 300)	(22 356)	(22 184)	
Kuraray Co., Ltd.	(100)	(1 613)	(1 333)	
Liontown Resources Ltd.	(8 509)	(13 222)	(12 632)	
Lynas Rare Earths Ltd.	(376)	(2 300)	(2 422)	
Mineral Resources Ltd.	(1 916)	(105 224)	(120 674)	
Nanofilm Technologies International Ltd.	(800)	(913)	(732)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(900)	(10 083)	(9 596)	
Nippon Paper Industries Co., Ltd.	(100)	(1 233)	(1 182)	
Pilbara Minerals Ltd.	(14 381)	(48 165)	(51 110)	
Sandfire Resources Ltd.	(2 729)	(14 539)	(18 023)	
Sayona Mining Ltd.	(7 664)	(371)	(490)	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	(500)	(26 182)	(27 671)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(150)	(1 367)	(1 074)	
SOL SpA	(162)	(4 284)	(6 560)	
Syrah Resources Ltd.	(5 074)	(6 312)	(2 945)	
Talga Group Ltd.	(2 468)	(2 953)	(1 743)	
		(524 483)	(563 021)	(2,39)
Industries (31 décembre 2022 : -2,87 %)				
Adecco Group AG	(25)	(1 611)	(1 616)	
AF Gruppen ASA	(346)	(6 995)	(5 580)	
Air New Zealand Ltd.	(1 093)	(789)	(579)	
Aker Carbon Capture ASA	(295)	(464)	(520)	
AP Moller - Maersk A/S	(10)	(23 162)	(23 721)	
Ashtrom Group Ltd.	(154)	(3 012)	(3 170)	
Assa Abloy AB	(15)	(464)	(570)	
Auckland International Airport Ltd.	(2 605)	(17 251)	(19 139)	
AutoStore Holdings Ltd.	(1 058)	(2 623)	(2 745)	
Beijer Ref AB	(2 401)	(35 655)	(42 379)	
Bpost SA	(275)	(2 580)	(1 868)	
Br Holdings Corp.	(400)	(1 557)	(1 328)	
Central Japan Railway Co.	(3 000)	(94 832)	(100 565)	
Chargeurs SA	(360)	(6 432)	(6 125)	
Clarivate PLC	(9 651)	(111 756)	(117 841)	
Cleanaway Waste Management Ltd.	(128)	(361)	(310)	
Copa Holdings SA	(30)	(4 148)	(4 205)	
Daimler Truck Holding AG	(1 872)	(85 349)	(92 764)	
Deme Group NV	(45)	(7 903)	(7 302)	
Deutsche Lufthansa AG	(1 100)	(11 950)	(12 895)	
Downer EDI Ltd.	(512)	(1 907)	(2 027)	
DSV A/S	(151)	(31 483)	(34 978)	
Elbit Systems Ltd.	(60)	(16 773)	(16 874)	
Elco Ltd.	(118)	(8 131)	(4 930)	
Enav SpA	(1 004)	(5 134)	(5 025)	
Ferrovial SE	(1)	(35)	(48)	
FREYR Battery SA	(227)	(618)	(560)	
GEA Group AG	(102)	(5 502)	(5 600)	
Genpact Ltd.	(390)	(18 222)	(17 850)	
Getlink SE	(63)	(1 408)	(1 520)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(337)	
Hankyu Hanshin Holdings Inc.	(700)	(30 875)	(29 390)	
Hensoldt AG	(72)	(2 787)	(2 559)	
Hexagon Composites ASA	(374)	(1 424)	(1 402)	
Hexagon Purus ASA	(182)	(434)	(263)	
Hutchison Port Holdings Trust	(3 200)	(770)	(624)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Japan Airlines Co., Ltd.	(400)	(10 374)	(10 382)	
Japan Airport Terminal Co., Ltd.	(100)	(6 695)	(5 809)	
Jungheinrich AG, actions priv.	(45)	(2 132)	(2 177)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(1 600)	(90 163)	(90 538)	
Keihan Holdings Co., Ltd.	(400)	(14 435)	(13 790)	
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	(500)	(24 204)	(31 165)	
Kornit Digital Ltd.	(578)	(20 770)	(14 603)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(1 000)	(1 814)	(7 108)	
Larsen & Toubro Ltd., CIAE	(11)	(558)	(618)	
Leonardo SpA	(713)	(11 630)	(15 511)	
Marlowe PLC	(59)	(403)	(426)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(3 793)	(1 972)	
MINEBEA MITSUMI Inc.	(100)	(2 543)	(2 711)	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	(1 800)	(134 122)	(138 742)	
MTU Aero Engines AG	(192)	(50 652)	(54 605)	
Nolato AB	(30)	(383)	(208)	
Norwegian Air Shuttle ASA	(2 364)	(2 466)	(3 290)	
NTG Nordic Transport Group A/S	(10)	(718)	(574)	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	(300)	(6 034)	(6 036)	
Pasona Group Inc.	(100)	(2 569)	(2 471)	
PNE AG	(361)	(4 469)	(7 278)	
Raksul Inc.	(100)	(1 350)	(1 186)	
Rational AG	(1)	(948)	(1 019)	
Recruit Holdings Co., Ltd.	(1 800)	(90 909)	(100 391)	
Seatrium Ltd.	(552 500)	(59 732)	(65 170)	
Service Stream Ltd.	(89 718)	(53 174)	(75 880)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(221)	(2 173)	(1 878)	
SIF Holding NV	(114)	(1 526)	(1 734)	
Sixt SE	(6)	(879)	(884)	
Tadano Ltd.	(300)	(3 169)	(3 308)	
Talenom Oyj	(76)	(1 161)	(686)	
TDCX Inc.	(33)	(370)	(211)	
Tinexta SpA	(100)	(3 155)	(2 954)	
TOMRA Systems ASA	(1 601)	(19 644)	(25 662)	
Toyota Industries Corp.	(200)	(21 170)	(21 512)	
Trane Technologies PLC	(144)	(43 652)	(46 311)	
Vestas Wind Systems A/S	(1 039)	(36 503)	(43 506)	
Vow ASA	(911)	(1 542)	(1 377)	
		(1 276 825)	(1 372 892)	(5,82)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,70 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(331)	
Aisin Corp.	(100)	(5 231)	(4 614)	
Avolta AG	(240)	(14 518)	(12 438)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(2 127)	(9 367)	(11 450)	
Baby Bunting Group Ltd.	(213)	(463)	(383)	
Cie Financière Richemont SA	(14)	(2 431)	(2 539)	
De' Longhi SpA	(521)	(15 386)	(23 161)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(994)	(45 021)	(52 713)	
Electra Consumer Products 1970 Ltd.	(200)	(7 719)	(5 275)	
ES-Con Japan Ltd.	(300)	(2 648)	(2 612)	
Fiskars OYJ Abp	(100)	(2 352)	(2 601)	
Flight Centre Travel Group Ltd.	(772)	(12 982)	(14 142)	
Fox Wixel Ltd.	(15)	(1 595)	(1 349)	
GN Store Nord AS	(1 928)	(58 827)	(64 721)	
Golf Digest Online Inc.	(200)	(2 394)	(1 276)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(82)	(409)	(407)	
Hella GmbH & Co KGaA	(224)	(18 020)	(26 918)	
IDP Education Ltd.	(2 555)	(51 064)	(46 046)	
InterContinental Hotels Group PLC	(8)	(889)	(962)	
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	(300)	(4 646)	(4 304)	
Istyle Inc.	(400)	(1 980)	(1 553)	
Just Eat Takeaway.com NV	(7)	(453)	(141)	
Kendrion NV	(172)	(3 784)	(3 026)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kindred Group PLC	(388)	(4 644)	(4 736)	
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	(13)	(13 268)	(13 891)	
Maytronics Ltd.	(137)	(2 072)	(2 058)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(2 675)	(30 332)	(31 287)	
Moncler SpA	(157)	(12 690)	(12 738)	
Nitori Holdings Co., Ltd.	(200)	(31 200)	(35 317)	
Nokian Renkaat Oyj	(437)	(4 862)	(5 257)	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	(3 299)	(224 008)	(222 583)	
Prosus NV	(44)	(1 746)	(1 729)	
Salvatore Ferragamo SpA	(93)	(1 662)	(1 654)	
Sharp Corp.	(900)	(8 605)	(8 464)	
Signet Jewelers Ltd.	(135)	(15 270)	(19 093)	
Sodexo SA	(5)	(708)	(726)	
Sony Group Corp., CAAE	(91)	(11 218)	(11 362)	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	(600)	(9 964)	(10 076)	
Tabcorp Holdings Ltd.	(1 835)	(1 476)	(1 379)	
Tadiran Group Ltd.	(55)	(6 604)	(5 402)	
Toyota Motor Corp.	(102)	(25 475)	(24 664)	
Tsuburaya Fields Holdings Inc.	(400)	(8 324)	(4 759)	
Zeal Network SE	(29)	(1 503)	(1 407)	
		(678 157)	(701 544)	(2,98)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -1,48 %)				
A2 Milk Co., Ltd.	(97)	(373)	(373)	
Aeon Co., Ltd.	(2 200)	(62 901)	(64 838)	
AG Barr PLC	(100)	(844)	(862)	
Agrana Beteiligungs AG	(102)	(2 613)	(2 095)	
Ajinomoto Co Inc.	(900)	(46 901)	(45 793)	
Anheuser-Busch InBev SA	(36)	(3 084)	(3 067)	
Anora Group Oyj	(215)	(2 221)	(1 365)	
Bega Cheese Ltd.	(399)	(1 142)	(1 271)	
Beiersdorf AG	(344)	(60 808)	(67 995)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(1 797)	(13 933)	(12 511)	
Cia Cervecerias Unidas SA	(162)	(2 896)	(2 679)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(166)	(10 123)	(14 609)	
DFI Retail Group Holdings Ltd.	(7 800)	(26 676)	(24 684)	
Diageo PLC	(393)	(76 671)	(75 482)	
Elders Ltd.	(245)	(1 647)	(1 660)	
Endeavour Group Ltd.	(1 583)	(7 061)	(7 421)	
Euglena Co., Ltd.	(700)	(5 915)	(4 563)	
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	(42)	(6 767)	(7 219)	
Fresh Del Monte Produce Inc.	(37)	(1 333)	(1 281)	
Grieg Seafood ASA	(567)	(4 721)	(5 028)	
H2O Retailing Corp.	(800)	(9 836)	(11 426)	
Haleon PLC	(219)	(2 613)	(2 377)	
Heineken NV	(12)	(1 567)	(1 607)	
HelloFresh SE	(328)	(7 054)	(6 837)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 477)	(2 765)	
Japan Tobacco Inc.	(2 000)	(64 639)	(68 184)	
Kansai Food Market Ltd.	(200)	(2 274)	(2 692)	
Kao Corp.	(300)	(16 372)	(16 274)	
Key Coffee Inc.	(500)	(10 184)	(9 755)	
KWS Saat SE & Co KGaA	(125)	(13 983)	(9 777)	
MARR SpA	(134)	(2 015)	(2 241)	
MatsukiyoCocokara & Co.	(500)	(11 929)	(11 677)	
Newlat Food SpA	(100)	(778)	(1 145)	
Pernod Ricard SA	(6)	(1 499)	(1 396)	
Raisio Oyj	(653)	(2 364)	(1 879)	
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	(500)	(16 420)	(13 295)	
Schouw & Co A/S	(96)	(9 688)	(10 373)	
Seven & i Holdings Co., Ltd.	(700)	(36 587)	(36 631)	
Strauss Group Ltd.	(94)	(2 614)	(2 341)	
Suedzucker AG	(145)	(3 355)	(2 997)	
Treasury Wine Estates Ltd.	(1 851)	(18 548)	(17 953)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Unicharm Corp.	(200)	(9 388)	(9 536)	
Unilever PLC	(781)	(53 109)	(49 926)	
Watahan & Co., Ltd.	(200)	(2 837)	(2 656)	
Wilmar International Ltd.	(700)	(2 593)	(2 498)	
		(644 353)	(643 034)	(2,73)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -1,59 %)				
ArcticZymes Technologies ASA	(344)	(3 203)	(1 876)	
AstraZeneca PLC, CAAE	(222)	(19 651)	(19 715)	
Atrys Health SA	(51)	(751)	(273)	
Bachem Holding AG	(3)	(422)	(306)	
Carl Zeiss Meditec AG	(17)	(2 420)	(2 448)	
Chemometec A/S	(189)	(16 263)	(14 329)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(4 300)	(163 998)	(214 846)	
Coloplast A/S	(1 343)	(209 080)	(202 586)	
CRISPR Therapeutics AG	(681)	(53 498)	(56 213)	
CSL Ltd.	(186)	(45 642)	(47 972)	
Demant A/S	(181)	(9 401)	(10 469)	
DiaSorin SpA	(855)	(122 143)	(116 120)	
EBOS Group Ltd.	(37)	(1 077)	(1 097)	
Eurobio Scientific SA	(50)	(1 391)	(1 199)	
Evotec SE	(577)	(14 908)	(17 885)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(186)	(3 269)	(3 665)	
Galapagos NV	(173)	(9 385)	(9 321)	
Galapagos NV, CAAE	(579)	(29 571)	(31 035)	
Genmab A/S	(125)	(58 011)	(52 635)	
GNI Group Ltd.	(200)	(5 713)	(5 294)	
Guerbet	(100)	(2 631)	(2 840)	
I-Mab	(2 009)	(7 647)	(5 033)	
Imugene Ltd.	(2 848)	(435)	(282)	
Jeol Ltd.	(100)	(4 402)	(5 790)	
JMDC Inc.	(100)	(4 287)	(3 987)	
Legend Biotech Corp.	(20)	(1 658)	(1 587)	
Medios AG	(290)	(11 945)	(6 699)	
MedPeer Inc.	(100)	(685)	(670)	
Merus NV	(210)	(6 526)	(7 615)	
Mesoblast Ltd.	(79)	(74)	(22)	
Mesoblast Ltd., CAAE	(553)	(1 397)	(802)	
Molecular Partners AG	(49)	(964)	(264)	
Nano-X Imaging Ltd.	(148)	(1 826)	(1 243)	
Orion Oyj	(40)	(2 194)	(2 288)	
PeptiDream Inc.	(300)	(4 144)	(4 171)	
PolyNovo Ltd.	(1 936)	(2 801)	(2 883)	
ProQR Therapeutics NV	(452)	(1 305)	(1 180)	
QIAGEN NV	(1 327)	(75 142)	(76 157)	
Ryman Healthcare Ltd.	(12 654)	(61 717)	(62 330)	
Sartorius AG	(66)	(23 629)	(32 032)	
Scancell Holdings PLC	(2 967)	(585)	(524)	
Scancell Holdings PLC, droits	(65)	-	-	
Sectra AB	(28)	(468)	(660)	
Shionogi & Co., Ltd.	(1 600)	(99 456)	(101 732)	
Siemens Healthineers AG	(999)	(68 191)	(76 541)	
STERIS PLC	(3)	(812)	(870)	
Sysmex Corp.	(900)	(71 879)	(66 147)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., CAAE	(995)	(13 199)	(13 697)	
Vetoquinol SA	(73)	(7 640)	(10 888)	
		(1 247 436)	(1 298 218)	(5,51)
Services financiers (31 décembre 2022 : -1,49 %)				
ABC arbitrage	(112)	(1 218)	(784)	
Aegon Ltd., AMS	(10 492)	(70 966)	(80 203)	
Aegon Ltd., NYSE	(869)	(5 221)	(6 600)	
Baloise Holding AG	(72)	(14 407)	(14 867)	
Banco Macro SA	(486)	(18 157)	(18 392)	
Banco Santander Chile	(1 366)	(32 169)	(35 106)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Banco Santander SA, CAAE	(5 707)	(28 577)	(31 155)	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	(3)	(27)	(26)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(200)	(4 686)	(4 224)	
Commercial International Bank - Egypt (CIB)	(312)	(535)	(527)	
Daiwa Securities Group Inc.	(2 800)	(20 040)	(24 856)	
Flow Traders Ltd.	(228)	(9 766)	(5 965)	
Grupo Financiero Galicia SA	(2 868)	(54 714)	(65 292)	
Grupo Supervielle SA	(1 298)	(2 957)	(6 949)	
HDFC Bank Ltd., CAAE	(7)	(615)	(619)	
HSBC Holdings PLC, CAAE	(157)	(7 890)	(8 393)	
Illimity Bank SpA	(596)	(8 577)	(4 736)	
Japan Post Bank Co., Ltd.	(2 300)	(31 609)	(30 891)	
Leonteq AG	(8)	(425)	(431)	
M&A Capital Partners Co., Ltd.	(200)	(8 110)	(4 549)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(17 600)	(192 148)	(199 431)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAE	(500)	(4 213)	(5 677)	
Nexi SpA	(10 102)	(122 044)	(108 976)	
Platinum Asset Management Ltd.	(5 754)	(11 558)	(6 886)	
Prudential PLC, CAAE	(476)	(15 997)	(14 091)	
Storebrand ASA	(1 106)	(12 944)	(12 930)	
Topdanmark AS	(165)	(11 307)	(10 394)	
Tryg A/S	(671)	(19 286)	(19 260)	
UBS Group AG	(862)	(24 211)	(35 248)	
Westpac Banking Corp.	(2 389)	(46 330)	(49 224)	
		(780 704)	(806 682)	(3,42)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -2,14 %)				
Advantest Corp.	(4 000)	(169 371)	(179 467)	
Appier Group Inc.	(1 000)	(15 323)	(17 303)	
Aurora Innovation Inc.	(686)	(3 980)	(3 953)	
Bit Digital Inc.	(481)	(2 047)	(2 683)	
Bittium Oyj	(136)	(1 291)	(953)	
BrainChip Holdings Ltd.	(2 142)	(1 080)	(328)	
Canaan Inc.	(848)	(2 067)	(2 583)	
Canon Inc.	(2 700)	(91 962)	(91 417)	
Change Holdings Inc.	(100)	(2 031)	(1 328)	
Crayon Group Holding ASA	(204)	(2 344)	(2 243)	
Credo Technology Group Holding Ltd.	(433)	(10 731)	(11 116)	
Cybozu Inc.	(100)	(1 984)	(2 039)	
Digital Value SpA	(100)	(8 897)	(9 002)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(1 800)	(143 643)	(142 648)	
Hexagon AB	(732)	(9 675)	(11 584)	
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd., CIAE	(168)	(1 397)	(1 511)	
Infosys Ltd.	(504)	(11 757)	(12 215)	
Innoviz Technologies Ltd.	(958)	(3 121)	(3 196)	
IVU Traffic Technologies AG	(104)	(2 522)	(2 112)	
Japan Cash Machine Co., Ltd.	(400)	(2 593)	(4 935)	
Japan Display Inc.	(1 000)	(372)	(196)	
Japan System Techniques Co., Ltd.	(100)	(1 689)	(2 815)	
JIG-SAW Inc.	(100)	(4 927)	(4 330)	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	(661)	(27 186)	(32 197)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(274)	
Keyence Corp.	(400)	(219 377)	(232 406)	
Lime Technologies AB	(148)	(4 873)	(5 742)	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	(1 250)	(8 247)	(11 818)	
Money Forward Inc.	(300)	(15 258)	(12 127)	
Murata Manufacturing Co., Ltd.	(200)	(5 587)	(5 599)	
Nano Dimension Ltd.	(512)	(1 817)	(1 620)	
NEC Corp.	(100)	(7 622)	(7 810)	
Netcompany Group A/S	(461)	(39 012)	(20 322)	
Nice Ltd.	(98)	(26 267)	(25 781)	
Nordic Semiconductor ASA	(3 695)	(50 174)	(60 449)	
Note AB	(40)	(751)	(777)	
NXP Semiconductors NV	(59)	(17 789)	(17 869)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Rakus Co., Ltd.	(400)	(10 571)	(9 774)	
REC Silicon ASA	(2 445)	(4 282)	(4 444)	
Renesas Electronics Corp.	(2 400)	(54 252)	(57 219)	
Ricoh Co., Ltd.	(1 300)	(14 693)	(13 168)	
Rohm Co., Ltd.	(1 000)	(25 267)	(25 277)	
Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	(5)	(9 092)	(9 876)	
Sanken Electric Co., Ltd.	(100)	(10 722)	(7 272)	
Secunet Security Networks AG	(6)	(3 816)	(1 276)	
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	(600)	(30 214)	(30 775)	
Silex Systems Ltd.	(412)	(1 315)	(1 613)	
Sinch AB	(172)	(2 631)	(844)	
SMART Global Holdings Inc.	(243)	(6 638)	(6 066)	
Softwareone Holding AG	(52)	(948)	(1 336)	
Technoprobe SpA	(51)	(515)	(642)	
Wipro Ltd.	(769)	(4 925)	(5 648)	
WiseTech Global Ltd.	(748)	(45 389)	(50 725)	
		(1 144 455)	(1 170 703)	(4,97)
Services de communication (31 décembre 2022 : -1,44 %)				
Adevinta ASA	(5 095)	(57 677)	(74 356)	
Adways Inc.	(200)	(1 102)	(945)	
Aiming Inc.	(1 100)	(4 101)	(2 572)	
America Movil SAB de CV	(492)	(12 330)	(12 015)	
Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	(730)	(3 896)	(3 828)	
Capcom Co., Ltd.	(200)	(8 526)	(8 523)	
Ceres Inc.	(200)	(2 040)	(2 284)	
COOKPAD Inc.	(100)	(285)	(110)	
CTS Eventim AG & Co KGaA	(243)	(21 185)	(22 158)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 071)	(11 004)	(12 637)	
Gurumavi Inc.	(1 300)	(5 142)	(3 319)	
Heroz Inc.	(300)	(4 735)	(4 742)	
Japan Communications Inc.	(800)	(1 747)	(1 706)	
Liberty Latin America Ltd., cat. C	(579)	(6 180)	(5 604)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., A	(826)	(2 184)	(2 837)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	(61)	(367)	(290)	
Mobile TeleSystems PJSC	(1 375)	(12 856)	-	
MTI Ltd.	(300)	(2 268)	(1 821)	
Nexon Co., Ltd.	(1 900)	(52 873)	(45 662)	
Nintendo Co., Ltd.	(800)	(51 922)	(55 064)	
NOS SGPS SA	(2 143)	(11 160)	(9 989)	
Partner Communications Co., Ltd.	(60)	(351)	(393)	
RTL Group SA	(123)	(6 985)	(6 264)	
SEEK Ltd.	(1 575)	(30 531)	(37 879)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(1 600)	(5 528)	(7 887)	
SoftBank Group Corp.	(2 800)	(163 045)	(164 805)	
Stillfront Group AB	(1 156)	(3 403)	(1 841)	
TBS Holdings Inc.	(300)	(4 688)	(8 415)	
Telecom Argentina SA	(4 501)	(30 137)	(42 435)	
Tow Co., Ltd.	(400)	(1 173)	(1 212)	
		(519 421)	(541 593)	(2,30)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,60 %)				
APA Group	(421)	(3 092)	(3 235)	
Ascopiave SpA	(567)	(3 076)	(1 858)	
Central Puerto SA	(4 517)	(40 868)	(54 201)	
Electric Power Development Co., Ltd.	(900)	(19 154)	(19 264)	
Elmera Group ASA	(559)	(1 673)	(2 192)	
Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte	(123)	(2 787)	(3 142)	
Fortum Oyj	(6)	(117)	(114)	
Genesis Energy Ltd.	(1 718)	(3 914)	(3 593)	
Italgas SpA	(2 550)	(18 926)	(19 240)	
OPC Energy Ltd.	(558)	(5 102)	(4 802)	
Orsted AS	(655)	(45 618)	(47 905)	
Pampa Energia SA	(71)	(4 753)	(4 636)	
		(149 080)	(164 182)	(0,70)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,21 %)				
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(323)	(3 465)	(3 502)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(122)	(1 652)	(573)	
Atenor	(14)	(125)	(152)	
BWP Trust	(1 369)	(4 943)	(4 348)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(682)	(2 969)	(3 062)	
Charter Hall Group	(5 929)	(62 909)	(64 229)	
Charter Hall Long Wale REIT	(2 488)	(9 830)	(8 417)	
Deutsche Wohnen SE	(283)	(12 929)	(9 869)	
Electra Real Estate Ltd.	(253)	(3 280)	(3 792)	
Goodman Property Trust	(1 197)	(2 155)	(2 279)	
Hamborner REIT AG	(554)	(6 314)	(5 495)	
Hongkong Land Holdings Ltd.	(1 300)	(6 291)	(5 965)	
Hulic Co., Ltd.	(400)	(4 826)	(5 524)	
Immobil SA	(233)	(24 574)	(10 114)	
Instone Real Estate Group SE	(100)	(1 102)	(1 063)	
Invincible Investment Corp.	(15)	(8 373)	(8 558)	
Isras Investment Co., Ltd.	(40)	(10 212)	(10 987)	
Japan Logistics Fund Inc.	(2)	(5 781)	(5 350)	
JINUSHI Co., Ltd.	(100)	(1 904)	(2 041)	
Kiwi Property Group Ltd.	(3 050)	(2 375)	(2 228)	
Mega Or Holdings Ltd.	(50)	(1 406)	(1 547)	
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	(1 000)	(28 157)	(32 343)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(200)	(1 754)	(2 022)	
Palace Capital PLC	(100)	(423)	(373)	
Region RE Ltd.	(2 385)	(5 264)	(4 850)	
Robot Home Inc.	(900)	(1 677)	(1 431)	
Stendorren Fastigheter AB	(104)	(2 280)	(2 496)	
Vital Healthcare Property Trust	(2 929)	(5 695)	(5 404)	
Wallenstam AB	(22)	(103)	(157)	
		<u>(222 768)</u>	<u>(208 171)</u>	(0,88)
Total des actions étrangères – position vendeur		<u>(7 692 930)</u>	<u>(7 986 505)</u>	(33,89)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		<u>(13 768)</u>		
Total des placements		<u>9 299 659</u>	<u>10 851 914</u>	<u>46,04</u>
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			664 638	2,82
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(85 685)	(0,36)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			410 450	1,74
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(1 036 133)	(4,40)
Autres actifs, moins les passifs			<u>12 765 552</u>	<u>54,16</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			<u>23 570 736</u>	<u>100,00</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Contrats de change à terme (Annexe 1)

Au 31 décembre 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
Banque Royale du Canada	USD	(671 838)	GBP	536 000	19 mars 2024	15 265
Banque Royale du Canada	USD	(129 276)	JPY	18 133 000	19 mars 2024	1 300
Banque Royale du Canada	USD	(17 078 947)	CAD	23 149 000	19 mars 2024	646 744
Banque Royale du Canada	USD	(110 586)	CAD	147 000	19 mars 2024	1 329
						664 638
Banque Royale du Canada	DKK	(1 462 000)	USD	212 762	19 mars 2024	(6 239)
Banque Royale du Canada	EUR	(449 000)	USD	486 637	19 mars 2024	(14 308)
Banque Royale du Canada	HKD	(3 316 000)	USD	425 111	19 mars 2024	(460)
Banque Royale du Canada	ILS	(503 000)	USD	136 293	19 mars 2024	(4 870)
Banque Royale du Canada	JPY	(24 798 000)	USD	173 448	19 mars 2024	(6 130)
Banque Royale du Canada	NOK	(2 871 000)	USD	263 473	19 mars 2024	(25 686)
Banque Royale du Canada	SEK	(3 700 000)	USD	355 747	19 mars 2024	(16 365)
Banque Royale du Canada	CHF	(198 000)	USD	228 306	19 mars 2024	(11 627)
						(85 685)
						578 953

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

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contreparties : La Banque de Nouvelle-Écosse, notation AA; JP Morgan, notation A				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
2 875	31 juill. 2024	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	517	63
466	31 juill. 2024	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	119	(120)
				<u>(57)</u>
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
257	31 juill. 2024	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	19 743	1 228
499	31 juill. 2024	888 Holdings Plc, swap sur rendement total	801	206
595	31 juill. 2024	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	3 131	428
615	31 juill. 2024	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	1 447	(104)
3 244	31 juill. 2024	Anglo American Plc, swap sur rendement total	107 457	(2 521)
185	31 juill. 2024	Ascential Plc, swap sur rendement total	912	49
1 198	31 juill. 2024	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	4 487	904
801	31 juill. 2024	Associated British Foods Plc, swap sur rendement total	32 487	361
2 614	31 juill. 2024	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	9 913	(104)
3 692	31 juill. 2024	Auto Trader Group Plc, swap sur rendement total	44 771	(141)
1 957	31 juill. 2024	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	13 050	14
1 592	31 juill. 2024	Bae Systems Plc, swap sur rendement total	29 718	1 519
857	31 juill. 2024	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 167	(54)
143	31 juill. 2024	Balfour Beatty Plc, swap sur rendement total	796	11
326	31 juill. 2024	Bank Of Cyprus Holdings Plc, swap sur rendement total	1 666	131
256	31 juill. 2024	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	17 105	2 204
147	31 juill. 2024	Barratt Developments Plc, swap sur rendement total	1 390	(4)
620	31 juill. 2024	Beazley Plc, swap sur rendement total	5 440	(178)
117	31 juill. 2024	Bellway Plc, swap sur rendement total	5 237	474
585	31 juill. 2024	Bodycote Plc, swap sur rendement total	5 846	175
333	31 juill. 2024	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	2 026	76
1 247	31 juill. 2024	British Land Co Plc, swap sur rendement total	8 631	1 210
846	31 juill. 2024	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	220	(22)
7 545	31 juill. 2024	Bt Group Plc, swap sur rendement total	15 969	275
1 132	31 juill. 2024	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	23 081	2 526
2 662	31 juill. 2024	Centamin Plc, swap sur rendement total	4 461	113
975	31 juill. 2024	Chemring Group Plc, swap sur rendement total	5 744	497
100	31 juill. 2024	Computacenter Plc, swap sur rendement total	4 693	142
50	31 juill. 2024	Craneware Plc, swap sur rendement total	1 471	92
1 241	31 juill. 2024	Currys Plc, swap sur rendement total	1 053	120
334	31 juill. 2024	Darktrace Plc, swap sur rendement total	2 059	101
215	31 juill. 2024	Derwent London Plc, swap sur rendement total	8 529	878
144	31 juill. 2024	Diploma Plc, swap sur rendement total	8 670	434
61	31 juill. 2024	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	814	173
1 364	31 juill. 2024	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	8 639	122
103	31 juill. 2024	Drax Group Plc, swap sur rendement total	848	30
3 297	31 juill. 2024	Enquest Plc, swap sur rendement total	836	57
598	31 juill. 2024	Equals Group Plc, swap sur rendement total	1 221	10
174	31 juill. 2024	Fdm Group Holdings Plc, swap sur rendement total	1 341	193
4 364	31 juill. 2024	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	12 947	1 130
1 267	31 juill. 2024	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	19 392	12
448	31 juill. 2024	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	1 694	43
43	31 juill. 2024	Genus Plc, swap sur rendement total	1 568	136
20 407	31 juill. 2024	Glencore Plc, swap sur rendement total	161 945	8 188
378	31 juill. 2024	Greggs Plc, swap sur rendement total	16 533	861
2 787	31 juill. 2024	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	9 477	633
16 553	31 juill. 2024	Hammerson Plc, swap sur rendement total	7 902	334
2 899	31 juill. 2024	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	35 768	631
159	31 juill. 2024	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	2 817	86
529	31 juill. 2024	Hollywood Bowl Group Plc, swap sur rendement total	2 721	324
496	31 juill. 2024	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	1 138	100
2 237	31 juill. 2024	Howden Joinery Group Plc, swap sur rendement total	30 594	2 479
767	31 juill. 2024	Hunting Plc, swap sur rendement total	3 810	445

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
652	31 juill. 2024	Ibstock Plc, swap sur rendement total	1 660	220
407	31 juill. 2024	Inchcape Plc, swap sur rendement total	4 895	538
2 563	31 juill. 2024	Informa Plc, swap sur rendement total	33 656	1 202
12 855	31 juill. 2024	Investec Plc, swap sur rendement total	114 915	3 691
2 221	31 juill. 2024	Iwg Plc, swap sur rendement total	7 067	1 665
13 069	31 juill. 2024	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	36 522	1 369
185	31 juill. 2024	Jet2 Plc, swap sur rendement total	3 897	138
502	31 juill. 2024	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	14 510	1 202
12 566	31 juill. 2024	Just Group Plc, swap sur rendement total	18 145	1 075
1 260	31 juill. 2024	Kainos Group Plc, swap sur rendement total	23 700	3 169
1 069	31 juill. 2024	Keller Group Plc, swap sur rendement total	15 813	1 114
2 558	31 juill. 2024	Kier Group Plc, swap sur rendement total	4 609	(86)
296	31 juill. 2024	Land Securities Group Plc, swap sur rendement total	3 553	391
1 435	31 juill. 2024	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	223 704	7 436
123	31 juill. 2024	M&C Saatchi Plc, swap sur rendement total	331	41
22 581	31 juill. 2024	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	103 776	7 659
1 028	31 juill. 2024	Marston'S Plc, swap sur rendement total	584	66
486	31 juill. 2024	Mears Group Plc, swap sur rendement total	2 533	273
12 244	31 juill. 2024	Melrose Industries Plc, swap sur rendement total	116 780	9 626
532	31 juill. 2024	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	2 305	300
3 576	31 juill. 2024	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	6 029	117
2 552	31 juill. 2024	Mobico Group Plc, swap sur rendement total	3 629	750
1 824	31 juill. 2024	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	8 591	205
1 785	31 juill. 2024	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	8 491	796
560	31 juill. 2024	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	20 851	1 620
3 378	31 juill. 2024	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	7 314	395
289	31 juill. 2024	Netcall Plc, swap sur rendement total	441	80
606	31 juill. 2024	Next Plc, swap sur rendement total	83 367	1 780
899	31 juill. 2024	Ninety One Plc, swap sur rendement total	2 773	164
299	31 juill. 2024	On The Beach Group Plc, swap sur rendement total	880	236
3 723	31 juill. 2024	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	29 076	5 454
501	31 juill. 2024	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	19 327	1 445
4 473	31 juill. 2024	Pan African Resources Plc, swap sur rendement total	1 268	16
1 132	31 juill. 2024	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	13 272	3 491
7 028	31 juill. 2024	Pendragon Plc, swap sur rendement total	3 816	43
1 490	31 juill. 2024	Persimmon Plc, swap sur rendement total	34 789	2 910
6 291	31 juill. 2024	Premier Foods Plc, swap sur rendement total	14 340	711
325	31 juill. 2024	Puretech Health Plc, swap sur rendement total	1 061	165
1 752	31 juill. 2024	Rank Group Plc, swap sur rendement total	2 209	(24)
581	31 juill. 2024	Reach Plc, swap sur rendement total	731	32
188	31 juill. 2024	Redde Plc, swap sur rendement total	1 175	28
186	31 juill. 2024	Redrow Plc, swap sur rendement total	1 924	164
986	31 juill. 2024	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	14 237	262
893	31 juill. 2024	Renewi Plc, swap sur rendement total	9 592	764
59	31 juill. 2024	Renishaw Plc, swap sur rendement total	3 549	274
7	31 juill. 2024	Rhi Magnesita Nv, swap sur rendement total	407	51
1 842	31 juill. 2024	Rightmove Plc, swap sur rendement total	17 822	810
40 386	31 juill. 2024	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	203 457	18 607
794	31 juill. 2024	Safestore Holdings Plc, swap sur rendement total	11 799	1 359
2 550	31 juill. 2024	Schroders Plc, swap sur rendement total	18 427	1 126
1 249	31 juill. 2024	Senior Plc, swap sur rendement total	3 729	125
6 626	31 juill. 2024	Sercio Group Plc, swap sur rendement total	18 055	562
293	31 juill. 2024	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	477	42
1 630	31 juill. 2024	Smith & Nephew Plc, swap sur rendement total	29 550	1 367
986	31 juill. 2024	Smiths News Plc, swap sur rendement total	885	95
763	31 juill. 2024	Somero Enterprises Inc, actions ord., swap sur rendement total	4 810	1 077
3 728	31 juill. 2024	Spirent Communications Plc, swap sur rendement total	7 727	537
1 102	31 juill. 2024	Sse Plc, swap sur rendement total	34 381	170
1 969	31 juill. 2024	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	4 867	180
312	31 juill. 2024	Tbc Bank Group Plc, swap sur rendement total	14 842	212
40	31 juill. 2024	Telecom Plus Plc, swap sur rendement total	1 084	49
50	31 juill. 2024	Ten Entertainment Group Plc, swap sur rendement total	347	1
85	31 juill. 2024	Trainline Plc, swap sur rendement total	460	51
2 372	31 juill. 2024	Tritax Big Box Reit Plc, swap sur rendement total	6 734	86
2 235	31 juill. 2024	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	5 579	661

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
6 574	31 juill. 2024	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	4 301	292
579	31 juill. 2024	Tyman Plc, swap sur rendement total	3 061	492
722	31 juill. 2024	Unite Group Plc/The, swap sur rendement total	12 670	538
895	31 juill. 2024	United Utilities Group Plc, swap sur rendement total	16 189	(293)
2 019	31 juill. 2024	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	2 438	(442)
989	31 juill. 2024	Victorian Plumbing Plc, swap sur rendement total	1 521	25
317	31 juill. 2024	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	4 889	675
356	31 juill. 2024	Volex Plc, swap sur rendement total	1 917	94
309	31 juill. 2024	Watches Of Switzerland Group, swap sur rendement total	3 680	258
504	31 juill. 2024	Wetherspoon (J.D.) Plc, swap sur rendement total	6 867	1 031
1 918	31 juill. 2024	Wincanton Plc, swap sur rendement total	10 059	611
103	31 juill. 2024	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	3 828	485
201	31 juill. 2024	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	4 582	469
				121 397
Euro – taux à court terme (ESTR)				
3 830	31 juill. 2024	Air France-Klm, swap sur rendement total	75 826	10 613
18	31 juill. 2024	Akwel, swap sur rendement total	424	16
4 298	31 juill. 2024	Alstom, swap sur rendement total	76 252	4 824
194	31 juill. 2024	Alten Sa, swap sur rendement total	38 035	2 470
278	31 juill. 2024	Assystem, swap sur rendement total	20 044	2 723
144	31 juill. 2024	Aubay, swap sur rendement total	8 736	1 031
116	31 juill. 2024	Axway Software Sa, swap sur rendement total	4 461	394
1	31 juill. 2024	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	70	–
331	31 juill. 2024	Beneteau, swap sur rendement total	6 017	582
1 156	31 juill. 2024	Bureau Veritas Sa, swap sur rendement total	38 509	982
1	31 juill. 2024	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	77	9
4 197	31 juill. 2024	Carrefour Sa, swap sur rendement total	101 267	(4 786)
3 666	31 juill. 2024	Cgg Sa, swap sur rendement total	3 193	(60)
274	31 juill. 2024	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	5 635	(8)
306	31 juill. 2024	Covivio, swap sur rendement total	21 697	1 651
3 428	31 juill. 2024	Crédit Agricole Sa, swap sur rendement total	64 173	2 824
50	31 juill. 2024	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	13 051	(273)
247	31 juill. 2024	Derichebourg, swap sur rendement total	1 828	104
6	31 juill. 2024	Duerr Ag, swap sur rendement total	187	9
67	31 juill. 2024	Eiffage, swap sur rendement total	9 468	360
86	31 juill. 2024	Elior Group, swap sur rendement total	367	28
641	31 juill. 2024	Elis Sa, swap sur rendement total	17 637	972
23	31 juill. 2024	Esker Sa, swap sur rendement total	5 347	390
445	31 juill. 2024	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	38 230	3 205
54	31 juill. 2024	Euronext Nv, swap sur rendement total	6 186	167
72	31 juill. 2024	Eutelsat Communications, swap sur rendement total	446	47
28	31 juill. 2024	Flatex Ag, swap sur rendement total	456	18
281	31 juill. 2024	Forvia, swap sur rendement total	8 358	755
606	31 juill. 2024	F-Secure Corp, swap sur rendement total	1 796	170
28	31 juill. 2024	Gecina Sa, swap sur rendement total	4 490	272
43	31 juill. 2024	Groupe Crit, swap sur rendement total	4 923	627
6	31 juill. 2024	Ipsen, swap sur rendement total	943	36
88	31 juill. 2024	Jacquet Métal Service Sa, swap sur rendement total	2 512	162
298	31 juill. 2024	Kering, swap sur rendement total	173 192	1 680
409	31 juill. 2024	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	46 706	2 581
693	31 juill. 2024	Klepierre, swap sur rendement total	24 912	1 338
338	31 juill. 2024	Legrand Sa, swap sur rendement total	46 328	1 867
345	31 juill. 2024	Lisi, swap sur rendement total	11 860	569
169	31 juill. 2024	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	1 499	(88)
63	31 juill. 2024	Mersen, swap sur rendement total	3 230	154
31	31 juill. 2024	Metso Oyj, swap sur rendement total	414	5
50	31 juill. 2024	Mip Se, swap sur rendement total	403	37
100	31 juill. 2024	Nexans Sa, swap sur rendement total	11 543	931
69	31 juill. 2024	Nexity, swap sur rendement total	1 694	294
15	31 juill. 2024	Nordex Se, swap sur rendement total	227	5
4 111	31 juill. 2024	Orange, swap sur rendement total	61 701	(3 934)
968	31 juill. 2024	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	4 850	(49)
487	31 juill. 2024	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	1 206	14
12	31 juill. 2024	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	326	58
95	31 juill. 2024	Rexel Sa, swap sur rendement total	3 428	(21)
36	31 juill. 2024	Rubis, swap sur rendement total	1 180	7

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
36	31 juill. 2024	Ses Imagotag, swap sur rendement total	7 121	1 566
4 316	31 juill. 2024	Société Générale Sa, swap sur rendement total	151 037	5 104
21	31 juill. 2024	Société Pour L'Informatique, swap sur rendement total	2 135	420
165	31 juill. 2024	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	47 539	1 882
16	31 juill. 2024	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	646	24
12	31 juill. 2024	Synergie Sa, swap sur rendement total	615	82
23	31 juill. 2024	Teperformance, swap sur rendement total	4 424	(60)
32	31 juill. 2024	Tomtom, swap sur rendement total	298	13
596	31 juill. 2024	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	20 062	(2 683)
2 760	31 juill. 2024	Valeo Sa, swap sur rendement total	55 941	2 408
327	31 juill. 2024	Vallourec Sa, swap sur rendement total	6 680	195
2 617	31 juill. 2024	Veolia Environnement, swap sur rendement total	108 868	(1 711)
36	31 juill. 2024	Verallia, swap sur rendement total	1 828	109
1 422	31 juill. 2024	Worldline Sa, swap sur rendement total	32 457	2 669
293	31 juill. 2024	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	4 345	(151)
				45 629
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
431	31 juill. 2024	Afrimat Ltd, swap sur rendement total	1 958	193
1 055	31 juill. 2024	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	502	62
1 190	31 juill. 2024	Arcelormittal South Africa, swap sur rendement total	141	35
6 955	31 juill. 2024	Arrowhead Properties Ltd, B, swap sur rendement total	1 725	(17)
86	31 juill. 2024	Bid Corp Ltd, swap sur rendement total	2 646	68
56	31 juill. 2024	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	1 019	63
916	31 juill. 2024	Exxaro Resources Ltd, swap sur rendement total	13 505	1 029
1 835	31 juill. 2024	Growthpoint Properties Ltd, swap sur rendement total	1 545	77
100	31 juill. 2024	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	1 461	61
586	31 juill. 2024	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 856	668
926	31 juill. 2024	Jse Ltd, swap sur rendement total	6 172	242
150	31 juill. 2024	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	465	14
7 914	31 juill. 2024	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	742	47
175	31 juill. 2024	Nepi Rockcastle Plc, swap sur rendement total	1 595	118
2 156	31 juill. 2024	Ppe Ltd, swap sur rendement total	620	50
446	31 juill. 2024	Psg Konsult Ltd, swap sur rendement total	494	4
1 511	31 juill. 2024	Sanlam Ltd, swap sur rendement total	7 931	484
1 006	31 juill. 2024	Sun International Ltd, swap sur rendement total	2 974	64
145	31 juill. 2024	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	1 608	90
418	31 juill. 2024	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	369	(1)
				3 351
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
485	31 juill. 2024	Addtech, actions, B, swap sur rendement total	14 050	1 455
188	31 juill. 2024	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	2 020	57
100	31 juill. 2024	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	2 486	100
255	31 juill. 2024	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	6 279	435
10	31 juill. 2024	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	108	–
4	31 juill. 2024	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	92	4
720	31 juill. 2024	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	12 727	1 407
317	31 juill. 2024	Lindab International Ab, swap sur rendement total	8 258	280
19	31 juill. 2024	Nibe Industrier Ab, actions, B, swap sur rendement total	176	16
66	31 juill. 2024	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	2 012	282
8	31 juill. 2024	Paradox Interactive Ab, swap sur rendement total	236	15
133	31 juill. 2024	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	1 636	102
600	31 juill. 2024	Systemair Ab, swap sur rendement total	6 178	761
54	31 juill. 2024	Tobii Ab, swap sur rendement total	42	(9)
156	31 juill. 2024	Volati Ab, swap sur rendement total	2 266	244
				5 149
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
73	31 juill. 2024	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	940	(151)
13	31 juill. 2024	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	4 807	35
4	31 juill. 2024	Lem Holding Sa, actions ord., swap sur rendement total	13 003	1 219
1	31 juill. 2024	Swissquote Group Holding, actions ord., swap sur rendement total	321	10
47	31 juill. 2024	Thurgauer Kantonalbank, certificat, swap sur rendement total	8 799	(232)
12	31 juill. 2024	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	1 878	136
100	31 juill. 2024	Varia Us Properties Ag, swap sur rendement total	5 953	133
				1 150

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
977	31 juill. 2024	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	2 035	268
1 188	31 juill. 2024	Al Khaleej Training And Educ, swap sur rendement total	10 276	330
9	31 juill. 2024	Alkhorayef Water & Power Tec, swap sur rendement total	614	115
115	31 juill. 2024	Anapass Inc, swap sur rendement total	2 519	14
2 200	31 juill. 2024	Anhui Kouzi Distillery Co, A, swap sur rendement total	18 508	241
220	31 juill. 2024	Aps Holdings Corp, swap sur rendement total	1 505	58
13	31 juill. 2024	Arabian Pipes Co, swap sur rendement total	590	81
1 000	31 juill. 2024	Au Optronics Corp, swap sur rendement total	782	16
17 344	31 juill. 2024	Bank Alfalah Ltd, swap sur rendement total	3 935	282
100	31 juill. 2024	Beijing Zuojiang Technolog, A, swap sur rendement total	535	(4)
2 700	31 juill. 2024	Betta Pharmaceuticals Co L, A, swap sur rendement total	25 849	(2 948)
4 500	31 juill. 2024	Bingshan Refrigeration & H, A, swap sur rendement total	4 463	(247)
600	31 juill. 2024	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	3 564	555
200	31 juill. 2024	Brf Sa, swap sur rendement total	751	7
268	31 juill. 2024	Bubang Co Ltd, swap sur rendement total	853	(69)
6 222	31 juill. 2024	Byucksan Corporation, swap sur rendement total	16 680	(943)
700	31 juill. 2024	C&A Modas Ltda, swap sur rendement total	1 489	(37)
841	31 juill. 2024	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	847	180
1 109	31 juill. 2024	Cementos Argos Sa	2 306	287
200	31 juill. 2024	Changzhou Kaidi Electrical, A, swap sur rendement total	1 750	57
4 300	31 juill. 2024	China Coal Xinji Energy Co, A, swap sur rendement total	4 209	12
25	31 juill. 2024	Chong Kun Dang Pharma, swap sur rendement total	3 342	295
1 700	31 juill. 2024	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	1 876	346
1 044	31 juill. 2024	Cia Energetica Minas Ger, action priv., swap sur rendement total	3 477	375
7 200	31 juill. 2024	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	40 511	3 725
3 300	31 juill. 2024	Cia Siderurgica Naciona Sa, swap sur rendement total	17 630	2 403
189 713	31 juill. 2024	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	15 487	873
949	31 juill. 2024	Coasia Corp, swap sur rendement total	7 249	(17)
5 600	31 juill. 2024	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	5 311	418
13	31 juill. 2024	Cosmecca Korea Co Ltd, swap sur rendement total	482	(16)
2 100	31 juill. 2024	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	3 024	441
1 500	31 juill. 2024	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	7 977	390
666	31 juill. 2024	D.I Corporation, swap sur rendement total	4 285	214
125	31 juill. 2024	Daesang Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	1 702	64
85	31 juill. 2024	Danal Co Ltd, swap sur rendement total	405	(15)
2 418	31 juill. 2024	Db Inc, swap sur rendement total	4 279	(29)
300	31 juill. 2024	Dexco Sa, swap sur rendement total	675	90
71	31 juill. 2024	Dgb Financial Group Inc, swap sur rendement total	616	(3)
300	31 juill. 2024	Dimed Sa Distribuidora De Me, swap sur rendement total	1 104	99
29	31 juill. 2024	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	1 493	137
4 400	31 juill. 2024	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	11 263	1 039
17 970	31 juill. 2024	Electrical Industries Co, swap sur rendement total	17 692	1 843
172	31 juill. 2024	Empresas Cmpe Sa, swap sur rendement total	441	–
4 900	31 juill. 2024	Eternit Sa, swap sur rendement total	11 666	213
500	31 juill. 2024	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	2 282	143
1 000	31 juill. 2024	Evergreen Marine Corp Ltd, swap sur rendement total	6 187	(164)
3 000	31 juill. 2024	Focaltech Systems Co Ltd, swap sur rendement total	14 551	(1 814)
4 700	31 juill. 2024	Fras-Le Sa, swap sur rendement total	21 989	2 166
2 100	31 juill. 2024	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	2 545	167
27 400	31 juill. 2024	Gentera Sab De Cv, swap sur rendement total	50 175	8 226
900	31 juill. 2024	Gerdau Sa, actions priv., swap sur rendement total	5 811	338
2 000	31 juill. 2024	Gigabyte Technology Co Ltd, swap sur rendement total	22 936	1 777
900	31 juill. 2024	Giti Tire Corp, A, swap sur rendement total	2 477	(43)
84	31 juill. 2024	Global Standard Technology, swap sur rendement total	2 363	314
900	31 juill. 2024	Grupo Sbf Sa, swap sur rendement total	2 869	128
2 700	31 juill. 2024	Guangdong Topstrong Living, A, swap sur rendement total	4 648	(92)
9 200	31 juill. 2024	Guangzhou Guangri Stock Co, A, swap sur rendement total	12 558	(294)
500	31 juill. 2024	Guangzhou Tech-Long Packag, A, swap sur rendement total	1 021	42
7 800	31 juill. 2024	Guararapes Confecoos Sa, swap sur rendement total	13 862	967
49 354	31 juill. 2024	Habib Bank Ltd, swap sur rendement total	25 584	(61)
6	31 juill. 2024	Hana Tour Service Inc, swap sur rendement total	319	(15)
33	31 juill. 2024	Hankook Tire & Technology Co, swap sur rendement total	1 530	3
509	31 juill. 2024	Hanmi Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	32 073	607
56	31 juill. 2024	Hanwha Aerospace Co Ltd, swap sur rendement total	7 120	(105)
42	31 juill. 2024	Hanwha Systems Co Ltd, swap sur rendement total	745	52

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
24	31 juill. 2024	Hdc Hyundai Development Co, E, swap sur rendement total	358	(19)
2 700	31 juill. 2024	Henglin Home Furnishings C, A, swap sur rendement total	22 349	6 774
6 200	31 juill. 2024	Hidrovias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	6 638	578
2 500	31 juill. 2024	Hongda Xingye Co Ltd, A, swap sur rendement total	404	(18)
9 100	31 juill. 2024	Huayi Compressor Co Ltd, A, swap sur rendement total	9 954	(125)
21 750	31 juill. 2024	Hub Power Company, swap sur rendement total	11 911	(455)
3	31 juill. 2024	Hyosung Heavy Industries Cor, swap sur rendement total	496	(141)
4	31 juill. 2024	Hyosung Tnc Co, swap sur rendement total	1 491	(70)
1 482	31 juill. 2024	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	5 509	(262)
6 700	31 juill. 2024	Ife Elevators Co Ltd, A, swap sur rendement total	10 328	(89)
5 500	31 juill. 2024	Impulse Qingdao Health Tec, A, swap sur rendement total	16 905	(665)
216	31 juill. 2024	Innocean Worldwide Inc, swap sur rendement total	4 721	237
4 000	31 juill. 2024	Inpaq Technology Co Ltd, swap sur rendement total	14 400	(196)
5 909	31 juill. 2024	Interloop Ltd, swap sur rendement total	1 990	145
2 000	31 juill. 2024	Inventec Corp, swap sur rendement total	4 553	943
420	31 juill. 2024	Inversiones Aguas Metropol, swap sur rendement total	465	36
42	31 juill. 2024	Inzi Controls Co Ltd, swap sur rendement total	347	3
5 300	31 juill. 2024	Iochpe-Maxion S.A., swap sur rendement total	18 565	1 575
1 500	31 juill. 2024	Irani Sa, swap sur rendement total	4 451	307
2 300	31 juill. 2024	Jiangsu Liba Enterprise Js, A, swap sur rendement total	5 570	(133)
800	31 juill. 2024	Jiangsu Maysta Chemical Co, A, swap sur rendement total	2 000	38
89	31 juill. 2024	Jusung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	3 108	(107)
1 200	31 juill. 2024	Keeson Technology Corp Ltd, A, swap sur rendement total	2 656	(51)
123	31 juill. 2024	Komico Ltd, swap sur rendement total	8 102	488
352	31 juill. 2024	Korea Line Corp, swap sur rendement total	775	11
2 883 677	31 juill. 2024	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	41 553	4 114
520	31 juill. 2024	Lb Semicon Inc, swap sur rendement total	4 105	27
21	31 juill. 2024	Leejam Sports Co Jsc, swap sur rendement total	1 493	269
4	31 juill. 2024	Lg Innotek Co Ltd, swap sur rendement total	978	3
2 000	31 juill. 2024	Lingsen Precision Industries, swap sur rendement total	1 975	(18)
2 100	31 juill. 2024	Loctek Ergonomic Technolog, A, swap sur rendement total	6 985	1 113
5 000	31 juill. 2024	Lojas Renner S.A., swap sur rendement total	24 119	2 167
1 031	31 juill. 2024	Lotte Non-Life Insurance Co, swap sur rendement total	2 516	51
300	31 juill. 2024	Luzhou Laojiao Co Ltd, A, swap sur rendement total	9 996	310
400	31 juill. 2024	M Dias Branco Sa, swap sur rendement total	4 242	457
40 500	31 juill. 2024	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	78 690	13 249
2 900	31 juill. 2024	Marfrig Global Foods Sa, swap sur rendement total	7 644	93
20 802	31 juill. 2024	Masisa Sa, swap sur rendement total	557	17
19 930	31 juill. 2024	Mcb Bank Ltd, swap sur rendement total	16 083	524
966	31 juill. 2024	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	58 304	3 333
7 500	31 juill. 2024	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	22 133	1 431
949	31 juill. 2024	Middle East Healthcare Co, swap sur rendement total	29 564	3 303
47	31 juill. 2024	Multicampus Co Ltd, swap sur rendement total	1 637	94
400	31 juill. 2024	Multilaser Industrial Sa, swap sur rendement total	227	(11)
1 000	31 juill. 2024	Nak Sealing Technologies Cor, swap sur rendement total	5 799	(60)
39	31 juill. 2024	National Co For Learning & E, swap sur rendement total	1 665	159
33	31 juill. 2024	National Medical Care Co, swap sur rendement total	2 024	373
67	31 juill. 2024	Oci Co Ltd, swap sur rendement total	7 267	482
448	31 juill. 2024	Pan Ocean Co Ltd, swap sur rendement total	1 709	(126)
1 166	31 juill. 2024	Parque Arauco S.A., swap sur rendement total	2 498	274
194	31 juill. 2024	Peptron Inc, swap sur rendement total	7 974	1 132
1 000	31 juill. 2024	Pixart Imaging Inc, swap sur rendement total	6 639	(194)
292	31 juill. 2024	Poongsan Corp, swap sur rendement total	11 690	1 000
6 900	31 juill. 2024	Positivo Tecnologia Sa, swap sur rendement total	13 050	628
3 900	31 juill. 2024	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	6 465	730
20 500	31 juill. 2024	Puyang Refractories Group, A, swap sur rendement total	14 391	(97)
1 400	31 juill. 2024	Qinhuangdao Port Co Ltd, A, swap sur rendement total	741	(6)
7 500	31 juill. 2024	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	26 820	4 287
77	31 juill. 2024	Riyad Bank, swap sur rendement total	773	41
386	31 juill. 2024	Rsupport Co Ltd, swap sur rendement total	1 453	5
197	31 juill. 2024	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	2 897	(75)
2 934	31 juill. 2024	Salfacorp Sa, swap sur rendement total	1 977	124
149	31 juill. 2024	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	2 540	(27)
51	31 juill. 2024	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	1 510	190
137	31 juill. 2024	Satrec Initiative Co Ltd, swap sur rendement total	4 330	143
40	31 juill. 2024	Saudi Co For Hardware Llc, swap sur rendement total	539	74

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
77	31 juill. 2024	Saudi Pharmaceutical Industr, swap sur rendement total	1 021	(5)
8	31 juill. 2024	Saudia Dairy & Foodstuff Co, swap sur rendement total	937	36
1 700	31 juill. 2024	Ser Educacional Sa, swap sur rendement total	3 631	784
900	31 juill. 2024	Shandong Swan Cotton Indus, A, swap sur rendement total	3 410	(110)
2 147	31 juill. 2024	Shanghai Allist Pharmaceut, A, swap sur rendement total	16 611	1 571
1 200	31 juill. 2024	Shanghai Shuixing Home Tex, A, swap sur rendement total	3 205	(140)
40	31 juill. 2024	Shanghai Zhenhua Heavy Ind, A, swap sur rendement total	25	-
700	31 juill. 2024	Shede Spirits Co Ltd, A, swap sur rendement total	12 571	1 106
13 700	31 juill. 2024	Shell Pakistan Ltd (Pbs), swap sur rendement total	9 641	(893)
800	31 juill. 2024	Shenyang Huitian Thermal, A, swap sur rendement total	487	82
2 358	31 juill. 2024	Shinsung Tongsang Co Ltd, swap sur rendement total	4 433	(175)
5 000	31 juill. 2024	Silicon Integrated Systems, swap sur rendement total	9 830	(431)
182	31 juill. 2024	Sk Hynix Inc, swap sur rendement total	26 300	1 939
22	31 juill. 2024	Sm Entertainment Co, swap sur rendement total	2 069	114
25 880	31 juill. 2024	Smu Sa, swap sur rendement total	6 318	(22)
3 015	31 juill. 2024	Sonda Sa, swap sur rendement total	1 746	24
500	31 juill. 2024	Stanley Agricultural Grou, A, swap sur rendement total	592	7
23 507	31 juill. 2024	Sui Northern Gas Pipelines, swap sur rendement total	8 083	1 123
9 000	31 juill. 2024	Sunplus Technology Co Ltd, swap sur rendement total	13 328	(393)
1 300	31 juill. 2024	Sunyard Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 320	(56)
836	31 juill. 2024	Tailim Packaging Co Ltd, swap sur rendement total	2 058	21
2 000	31 juill. 2024	Taiwan Navigation Co Ltd, swap sur rendement total	2 845	16
40	31 juill. 2024	Tesna Inc, swap sur rendement total	2 394	(205)
703	31 juill. 2024	The National Agriculture Dev, swap sur rendement total	6 897	764
2 400	31 juill. 2024	Tianjin Guifaxiang 18Th St, A, swap sur rendement total	5 090	(162)
595	31 juill. 2024	Tongyang Life Insurance, swap sur rendement total	2 753	37
1 000	31 juill. 2024	Tripod Technology Corp, swap sur rendement total	8 407	241
4 000	31 juill. 2024	Truelight Corp, swap sur rendement total	4 734	(152)
183	31 juill. 2024	Uniquet Corp, swap sur rendement total	1 136	153
7 992	31 juill. 2024	United Bank Ltd, swap sur rendement total	6 647	(102)
800	31 juill. 2024	Usinas Sider Minas Ger, actions priv., A, swap sur rendement total	2 020	318
4 600	31 juill. 2024	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	25 625	476
7 600	31 juill. 2024	Wangli Security&Surveillan, A, swap sur rendement total	13 747	(667)
361	31 juill. 2024	Wisol Co Ltd, swap sur rendement total	2 865	141
11 300	31 juill. 2024	Wiz Co, swap sur rendement total	22 262	4 282
492	31 juill. 2024	Wooree Bio Co Ltd, swap sur rendement total	1 661	344
1 100	31 juill. 2024	Xinjiang Torch Gas Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 403	(273)
1 000	31 juill. 2024	Yang Ming Marine Transport, swap sur rendement total	2 212	15
4 900	31 juill. 2024	Yduqs Part, swap sur rendement total	29 853	3 221
283	31 juill. 2024	Yest Co Ltd, swap sur rendement total	4 795	(416)
200	31 juill. 2024	Yingkou Jinchun Machinery, A, swap sur rendement total	2 030	265
1 776	31 juill. 2024	Yuanta Securities Korea, swap sur rendement total	4 625	(75)
160	31 juill. 2024	Zamil Industrial Investment, swap sur rendement total	1 494	350
12 200	31 juill. 2024	Zamp Sa, swap sur rendement total	18 897	(155)
470	31 juill. 2024	Zeus Co Ltd, swap sur rendement total	22 487	(369)
800	31 juill. 2024	Zhejiang Tengen Electrics Co, swap sur rendement total	1 364	14
2 300	31 juill. 2024	Zhejiang Zhengyuan Zhihui, A, swap sur rendement total	7 770	(207)
700	31 juill. 2024	Zoy Home Furnishing Co Ltd, A, swap sur rendement total	2 340	13
				84 318
				260 937
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		

Swaps d'actions – position vendeur

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

(2 131)	31 juill. 2024	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(597)	2
(220)	31 juill. 2024	Ab Dynamics Plc, swap sur rendement total	(6 620)	(89)
(292)	31 juill. 2024	Antofagasta Plc, swap sur rendement total	(8 244)	(1 200)
(618)	31 juill. 2024	Ashtead Group Plc, swap sur rendement total	(56 741)	(6 268)
(12 655)	31 juill. 2024	Aviva Plc, swap sur rendement total	(92 471)	(2 800)
(1 402)	31 juill. 2024	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(477)	18
(624)	31 juill. 2024	Berkeley Group Holdings/The, swap sur rendement total	(49 173)	(195)
(12 789)	31 juill. 2024	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(8 816)	(1 909)
(72)	31 juill. 2024	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(252)	(28)
(1 238)	31 juill. 2024	Bunzl Plc, swap sur rendement total	(66 763)	(3 958)
(2 125)	31 juill. 2024	C&C Group Plc, swap sur rendement total	(5 451)	(630)
(455)	31 juill. 2024	Cairn Energy Plc, swap sur rendement total	(1 297)	(158)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(186)	31 juill. 2024	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(818)	(17)
(234)	31 juill. 2024	Compass Group Plc, swap sur rendement total	(8 441)	(84)
(400)	31 juill. 2024	Crest Nicholson Holdings, swap sur rendement total	(1 460)	(195)
(1 794)	31 juill. 2024	Croda International Plc, swap sur rendement total	(152 289)	(15 749)
(24)	31 juill. 2024	Cvs Group Plc, swap sur rendement total	(679)	(65)
(107)	31 juill. 2024	Dcc Plc, swap sur rendement total	(10 392)	(744)
(2 301)	31 juill. 2024	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(3 338)	(721)
(381)	31 juill. 2024	Diageo Plc, swap sur rendement total	(18 291)	(528)
(14)	31 juill. 2024	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(262)	47
(622)	31 juill. 2024	Ekf Diagnostics Holdings Plc, swap sur rendement total	(331)	(43)
(1 273)	31 juill. 2024	Energear Plc, swap sur rendement total	(22 340)	(706)
(904)	31 juill. 2024	Essentra Plc, swap sur rendement total	(2 577)	(262)
(336)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(78 733)	(8 233)
(100)	31 juill. 2024	Fresnillo Plc, swap sur rendement total	(999)	(17)
(402)	31 juill. 2024	Future Plc, swap sur rendement total	(5 376)	388
(15)	31 juill. 2024	Games Workshop Group Plc, swap sur rendement total	(2 489)	(22)
(20)	31 juill. 2024	Gamma Communications Plc, swap sur rendement total	(379)	(22)
(328)	31 juill. 2024	Gb Group Plc, swap sur rendement total	(1 511)	(221)
(700)	31 juill. 2024	Globaldata Plc, swap sur rendement total	(2 306)	(509)
(2 768)	31 juill. 2024	Grainger Plc, swap sur rendement total	(12 506)	(638)
(9 800)	31 juill. 2024	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(1 624)	190
(705)	31 juill. 2024	Gulf Keystone Petroleum Ltd, swap sur rendement total	(1 530)	(34)
(6 747)	31 juill. 2024	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(12 045)	(752)
(31 544)	31 juill. 2024	Haleon Plc, swap sur rendement total	(170 551)	4 916
(100)	31 juill. 2024	Hargreaves Services Plc, swap sur rendement total	(698)	78
(27)	31 juill. 2024	Headlam Group Plc, swap sur rendement total	(98)	(11)
(2 150)	31 juill. 2024	Helical Plc, swap sur rendement total	(8 115)	(371)
(790)	31 juill. 2024	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(23 757)	(783)
(392)	31 juill. 2024	Hill & Smith Holdings Plc, swap sur rendement total	(12 671)	(757)
(287)	31 juill. 2024	Hilton Food Group Plc, swap sur rendement total	(3 859)	(291)
(223)	31 juill. 2024	Indivior Plc, swap sur rendement total	(4 442)	371
(7 206)	31 juill. 2024	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(7 195)	(896)
(51)	31 juill. 2024	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(264)	(19)
(3 966)	31 juill. 2024	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(11 473)	(2 136)
(21)	31 juill. 2024	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	(587)	(103)
(62)	31 juill. 2024	Lancashire Holdings Ltd, swap sur rendement total	(650)	(14)
(315)	31 juill. 2024	Learning Technologies Group, swap sur rendement total	(429)	(43)
(8 937)	31 juill. 2024	Lloyds Banking Group Plc, swap sur rendement total	(7 167)	(116)
(1 788)	31 juill. 2024	M&G Plc, swap sur rendement total	(6 684)	(289)
(60)	31 juill. 2024	Mondi Plc, swap sur rendement total	(1 551)	(79)
(50)	31 juill. 2024	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(689)	(92)
(36)	31 juill. 2024	Next Fifteen Communications, swap sur rendement total	(503)	(51)
(3 105)	31 juill. 2024	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(39 584)	(8 134)
(920)	31 juill. 2024	Pets At Home Group Plc, swap sur rendement total	(4 990)	(16)
(14 005)	31 juill. 2024	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(125 995)	(16 084)
(629)	31 juill. 2024	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(1 803)	(190)
(496)	31 juill. 2024	Picton Property Income Ltd, swap sur rendement total	(577)	(42)
(71)	31 juill. 2024	Plus500 Ltd, swap sur rendement total	(1 985)	(259)
(362)	31 juill. 2024	Primary Health Properties, swap sur rendement total	(632)	(33)
(432)	31 juill. 2024	Provident Financial Plc, swap sur rendement total	(938)	(128)
(1 573)	31 juill. 2024	Prudential Plc, swap sur rendement total	(23 459)	(558)
(4 311)	31 juill. 2024	Quilter Plc, swap sur rendement total	(7 449)	(700)
(1 208)	31 juill. 2024	Reckitt Benckiser Group Plc, swap sur rendement total	(10 058)	(15)
(1 188)	31 juill. 2024	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(727)	(131)
(401)	31 juill. 2024	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(2 971)	(40)
(412)	31 juill. 2024	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(1 737)	(65)
(726)	31 juill. 2024	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(652)	(90)
(451)	31 juill. 2024	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 741)	(5)
(1 952)	31 juill. 2024	Shaftesbury Capital Plc, swap sur rendement total	(4 531)	(540)
(86)	31 juill. 2024	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	(15 186)	(1 030)
(101)	31 juill. 2024	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	(385)	(5)
(1 907)	31 juill. 2024	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(21 913)	(1 047)
(2 731)	31 juill. 2024	Standard Chartered Plc, swap sur rendement total	(30 601)	(493)
(503)	31 juill. 2024	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(631)	(21)
(2 427)	31 juill. 2024	Supermarket Income Reit Plc, swap sur rendement total	(3 545)	(216)
(1 227)	31 juill. 2024	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(13 720)	(768)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(7 160)	31 juill. 2024	Thg Plc, swap sur rendement total	(10 250)	(1 047)
(76)	31 juill. 2024	Travis Perkins Plc, swap sur rendement total	(1 059)	(83)
(200)	31 juill. 2024	Treatt Plc, swap sur rendement total	(1 691)	(146)
(323)	31 juill. 2024	Tremor International Ltd, swap sur rendement total	(1 108)	(326)
(904)	31 juill. 2024	Tritax Eurobox Plc, swap sur rendement total	(925)	(80)
(841)	31 juill. 2024	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(8 030)	(534)
(3 565)	31 juill. 2024	Wpp Plc, swap sur rendement total	(45 124)	(2 584)
				<u>(82 248)</u>
Euro – taux à court terme (€STR)				
(7)	31 juill. 2024	Ackermans & Van Haaren, swap sur rendement total	(1 619)	(68)
(189)	31 juill. 2024	Adp, swap sur rendement total	(32 265)	(996)
(66)	31 juill. 2024	Adyen Nv, swap sur rendement total	(112 151)	(8 579)
(17 933)	31 juill. 2024	Aegon Nv, swap sur rendement total	(137 083)	(5 332)
(485)	31 juill. 2024	Agfa-Gevaert Nv, swap sur rendement total	(1 038)	(76)
(1 223)	31 juill. 2024	Aib Group Plc, swap sur rendement total	(6 912)	345
(420)	31 juill. 2024	Alfen Nv, swap sur rendement total	(36 877)	(8 421)
(41)	31 juill. 2024	Alteara, swap sur rendement total	(4 778)	(670)
(539)	31 juill. 2024	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	(17 916)	(704)
(1 161)	31 juill. 2024	Amper Sa, swap sur rendement total	(141)	25
(39)	31 juill. 2024	Asr Nederland Nv, swap sur rendement total	(2 426)	8
(457)	31 juill. 2024	B&S Group Sarl, swap sur rendement total	(2 460)	(14)
(811)	31 juill. 2024	Bank Of Ireland Group Plc, swap sur rendement total	(9 708)	133
(100)	31 juill. 2024	Biomérieux, swap sur rendement total	(14 653)	(226)
(1 284)	31 juill. 2024	Bpost Sa, swap sur rendement total	(8 723)	(75)
(300)	31 juill. 2024	Carmila, swap sur rendement total	(6 808)	(569)
(4 231)	31 juill. 2024	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(219 767)	(3 227)
(385)	31 juill. 2024	Corticeira Amorim Sa, swap sur rendement total	(5 126)	(33)
(939)	31 juill. 2024	Dalata Hotel Group Plc, swap sur rendement total	(6 319)	(664)
(919)	31 juill. 2024	Danone, swap sur rendement total	(78 549)	620
(1 273)	31 juill. 2024	Dassault Systèmes Sa, swap sur rendement total	(82 022)	(1 189)
(4)	31 juill. 2024	Dredging Environmental, swap sur rendement total	(649)	(81)
(23)	31 juill. 2024	Edenred, swap sur rendement total	(1 814)	(7)
(721)	31 juill. 2024	Edp Renovaveis Sa, swap sur rendement total	(19 455)	(1 756)
(47)	31 juill. 2024	Elia Group Sa/Nv, swap sur rendement total	(7 756)	(927)
(176)	31 juill. 2024	Essilorluxottica, swap sur rendement total	(46 555)	(1 448)
(92)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(21 441)	(1 422)
(201)	31 juill. 2024	Forfarmers Nv, swap sur rendement total	(697)	11
(4 518)	31 juill. 2024	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(85 946)	(895)
(141)	31 juill. 2024	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(24 625)	830
(100)	31 juill. 2024	Harvia Oyj, swap sur rendement total	(3 962)	(289)
(64)	31 juill. 2024	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(7 141)	(472)
(1 663)	31 juill. 2024	Heineken Nv, swap sur rendement total	(222 707)	(18 887)
(266)	31 juill. 2024	Icade, swap sur rendement total	(13 770)	(837)
(1 678)	31 juill. 2024	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(33 685)	1 427
(628)	31 juill. 2024	Kapsch Trafficom Ag, swap sur rendement total	(8 196)	252
(57)	31 juill. 2024	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(2 499)	(126)
(507)	31 juill. 2024	Kerry Group Plc, A, swap sur rendement total	(58 090)	(2 920)
(370)	31 juill. 2024	Kesko Oyj, actions, B, swap sur rendement total	(9 660)	(168)
(92)	31 juill. 2024	Kinepolis, swap sur rendement total	(5 990)	100
(85)	31 juill. 2024	Kone Oyj, B, swap sur rendement total	(5 591)	(100)
(335)	31 juill. 2024	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(4 782)	(116)
(134)	31 juill. 2024	Lectra, swap sur rendement total	(6 099)	(582)
(121)	31 juill. 2024	Lvmh Moët Hennessy Louis Vui, swap sur rendement total	(129 295)	(1 463)
(598)	31 juill. 2024	M6-Métropole Télévision, swap sur rendement total	(11 271)	(324)
(187)	31 juill. 2024	Maisons Du Monde Sa, swap sur rendement total	(1 544)	(267)
(250)	31 juill. 2024	Manitou Bf, swap sur rendement total	(8 448)	(706)
(31)	31 juill. 2024	Mayr-Melnhof Karton Ag, swap sur rendement total	(5 717)	(618)
(131)	31 juill. 2024	Mephy Energy Sa, swap sur rendement total	(642)	40
(692)	31 juill. 2024	Mercialys, swap sur rendement total	(10 024)	(861)
(187)	31 juill. 2024	Navigator Co Sa/The, swap sur rendement total	(966)	63
(218)	31 juill. 2024	Neoen Sa, swap sur rendement total	(9 615)	(678)
(192)	31 juill. 2024	Neste Oyj, swap sur rendement total	(9 008)	56
(33)	31 juill. 2024	Oeneo, swap sur rendement total	(620)	21
(18)	31 juill. 2024	Orange Belgium, swap sur rendement total	(354)	-
(1 325)	31 juill. 2024	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(2 100)	(79)
(1 041)	31 juill. 2024	Orion Oyj, cat. B, swap sur rendement total	(59 546)	(4 109)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(130)	31 juill. 2024	Pernod Ricard Sa, swap sur rendement total	(30 250)	67
(2 763)	31 juill. 2024	Prosus Nv, swap sur rendement total	(108 603)	12 005
(161)	31 juill. 2024	Publicis Groupe, swap sur rendement total	(19 699)	(1 248)
(190)	31 juill. 2024	Raisio Oyj, actions, V, swap sur rendement total	(547)	(1)
(134)	31 juill. 2024	Randstad Nv, swap sur rendement total	(11 071)	(368)
(413)	31 juill. 2024	Recticel, swap sur rendement total	(6 377)	(296)
(364)	31 juill. 2024	Redes Energeticas Nacionais, swap sur rendement total	(1 233)	58
(6)	31 juill. 2024	Rémy Cointreau, swap sur rendement total	(1 005)	(12)
(1)	31 juill. 2024	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 209)	(90)
(47)	31 juill. 2024	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(16 396)	(2 146)
(64)	31 juill. 2024	Seb Sa, swap sur rendement total	(10 534)	(757)
(1 504)	31 juill. 2024	Ses, swap sur rendement total	(13 057)	(1 072)
(430)	31 juill. 2024	Shell Plc, swap sur rendement total	(18 665)	275
(354)	31 juill. 2024	Signify Nv, swap sur rendement total	(15 634)	(1 720)
(200)	31 juill. 2024	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(4 620)	(63)
(13)	31 juill. 2024	Société Bic Sa, swap sur rendement total	(1 190)	(17)
(410)	31 juill. 2024	Sodexo Sa, swap sur rendement total	(59 493)	(475)
(16)	31 juill. 2024	Syensqo Sa, swap sur rendement total	(2 197)	(2 197)
(686)	31 juill. 2024	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(21 144)	213
(121)	31 juill. 2024	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(1 364)	(79)
(1 247)	31 juill. 2024	Universal Music Group Nv, swap sur rendement total	(46 880)	(2 328)
(2)	31 juill. 2024	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(40)	(4)
(1 463)	31 juill. 2024	Vivendi, swap sur rendement total	(20 619)	(673)
(652)	31 juill. 2024	Volitalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(9 896)	(690)
(186)	31 juill. 2024	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(6 895)	(818)
				(69 486)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(6)	31 juill. 2024	Wuxi Xdc Cayman Inc, swap sur rendement total	(32)	(3)
(8 500)	31 juill. 2024	Anhui Conch Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(25 894)	421
(12 000)	31 juill. 2024	Beijing Capital Intl Airpo, H, swap sur rendement total	(4 640)	681
(500)	31 juill. 2024	Budweiser Brewing Co Apac Lt, swap sur rendement total	(1 234)	(46)
(3 000)	31 juill. 2024	Canvest Environmental Protec, swap sur rendement total	(1 890)	(60)
(5 000)	31 juill. 2024	Cgn Mining Co Ltd, swap sur rendement total	(1 452)	(73)
(21 000)	31 juill. 2024	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	(15 142)	1 067
(3 200)	31 juill. 2024	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 166)	(285)
(2 000)	31 juill. 2024	China Meidong Auto Holdings, swap sur rendement total	(1 604)	16
(16 000)	31 juill. 2024	China National Building Ma, H, swap sur rendement total	(9 024)	118
(4 006)	31 juill. 2024	China Traditional Chinese Me, swap sur rendement total	(2 659)	54
(9 000)	31 juill. 2024	Cosco Shipping Holdings Co, H, swap sur rendement total	(11 930)	(937)
(9 000)	31 juill. 2024	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(20 031)	(563)
(500)	31 juill. 2024	Fosun International Ltd, swap sur rendement total	(388)	(21)
(4 000)	31 juill. 2024	Galaxy Entertainment Group L, swap sur rendement total	(29 552)	(1 605)
(20 400)	31 juill. 2024	Ganfeng Lithium Co Ltd, H, swap sur rendement total	(101 624)	(14 644)
(20 000)	31 juill. 2024	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(49 106)	378
(700)	31 juill. 2024	Hangzhou Tigermed Consulti, H, swap sur rendement total	(4 179)	618
(1 400)	31 juill. 2024	Hygeia Healthcare Holdings C, swap sur rendement total	(8 345)	595
(2 000)	31 juill. 2024	Melco International Develop., swap sur rendement total	(1 847)	(104)
(10 800)	31 juill. 2024	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(41 673)	(5 897)
(3 000)	31 juill. 2024	Shanghai Fosun Pharmaceuti, H, swap sur rendement total	(8 612)	168
(1 500)	31 juill. 2024	Shanghai Pharmaceuticals, H, swap sur rendement total	(2 893)	(67)
(2 800)	31 juill. 2024	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(9 669)	(523)
(11 000)	31 juill. 2024	Sjm Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 588)	(277)
(1 000)	31 juill. 2024	Smoores International Holding, swap sur rendement total	(1 098)	56
(6 000)	31 juill. 2024	Tingyi (Cayman Isln) Hldg Co, swap sur rendement total	(9 646)	(480)
(4 000)	31 juill. 2024	Tsingtao Brewery Co Ltd, H, swap sur rendement total	(35 394)	(918)
(7 000)	31 juill. 2024	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(5 579)	(191)
(6 500)	31 juill. 2024	Wh Group Ltd, swap sur rendement total	(5 532)	(5)
(4 000)	31 juill. 2024	Wharf Holdings Ltd, swap sur rendement total	(16 988)	(2 764)
(100 000)	31 juill. 2024	Wheelock & Co Ltd, swap sur rendement total	(19 588)	3 070
(1 300)	31 juill. 2024	Wuxi Apptec Co Ltd, H, swap sur rendement total	(17 441)	2 711
(20 500)	31 juill. 2024	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	(102 468)	1 715
(4 800)	31 juill. 2024	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(5 212)	(509)
(2 000)	31 juill. 2024	Xiabuxiabu Catering Manageme, swap sur rendement total	(831)	51
(500)	31 juill. 2024	Yangtze Optical Fibre And, H, swap sur rendement total	(706)	39
				(18 214)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(188)	31 juill. 2024	Astral Foods Ltd, swap sur rendement total	(1 987)	190
(696)	31 juill. 2024	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(463)	(26)
(945)	31 juill. 2024	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(179)	(12)
(52)	31 juill. 2024	Lighthouse Properties Plc, swap sur rendement total	(28)	(5)
(1 050)	31 juill. 2024	Pick N Pay Stores Ltd, swap sur rendement total	(1 762)	49
(100)	31 juill. 2024	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(319)	(29)
				167
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(861)	31 juill. 2024	Assa Abloy Ab, B, swap sur rendement total	(32 703)	(2 171)
(2 886)	31 juill. 2024	Atlas Copco Ab, actions, A, swap sur rendement total	(65 534)	(1 887)
(324)	31 juill. 2024	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(9 801)	(1 247)
(299)	31 juill. 2024	Axfood Ab, swap sur rendement total	(10 680)	(375)
(837)	31 juill. 2024	Billerudkorsnas Ab, swap sur rendement total	(11 214)	57
(391)	31 juill. 2024	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	(13 700)	(1 776)
(888)	31 juill. 2024	Boliden Ab, swap sur rendement total	(36 541)	(2 994)
(671)	31 juill. 2024	Bonava Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 153)	31
(1 653)	31 juill. 2024	Bygghem Group Ab, swap sur rendement total	(8 206)	(1 526)
(413)	31 juill. 2024	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(11 456)	(1 854)
(723)	31 juill. 2024	Coor Service Management, swap sur rendement total	(4 126)	(390)
(906)	31 juill. 2024	Corem Property Group, actions, B, swap sur rendement total	(1 259)	(208)
(17 074)	31 juill. 2024	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(61 111)	(6 410)
(343)	31 juill. 2024	Epiroc Ab, A, swap sur rendement total	(9 074)	(62)
(5 860)	31 juill. 2024	Ericsson Lm, actions, B, swap sur rendement total	(48 388)	(1 533)
(45)	31 juill. 2024	Evolution Gaming Group, swap sur rendement total	(7 078)	(20)
(301)	31 juill. 2024	Garco Ab, swap sur rendement total	(1 714)	(326)
(1 312)	31 juill. 2024	Getinge Ab, actions, B, swap sur rendement total	(38 504)	28
(4 102)	31 juill. 2024	Hexagon Ab, actions, B, swap sur rendement total	(64 915)	(6 186)
(2 003)	31 juill. 2024	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	(7 160)	(1 696)
(37)	31 juill. 2024	Hms Networks Ab, swap sur rendement total	(2 408)	(265)
(142)	31 juill. 2024	Investment Ab Latour, actions, B, swap sur rendement total	(4 873)	(459)
(371)	31 juill. 2024	Jm Ab, swap sur rendement total	(8 616)	(1 485)
(544)	31 juill. 2024	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(1 707)	(593)
(100)	31 juill. 2024	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(3 879)	(35)
(1 695)	31 juill. 2024	Nolato Ab, actions, B, swap sur rendement total	(11 732)	(198)
(903)	31 juill. 2024	Ox2 Ab, swap sur rendement total	(6 480)	(651)
(1 740)	31 juill. 2024	Pandox Ab, swap sur rendement total	(34 241)	(5 131)
(154)	31 juill. 2024	Peab Ab, cat. B, swap sur rendement total	(1 151)	(153)
(258)	31 juill. 2024	Platzer Fastigheter Hold, B, swap sur rendement total	(2 842)	(287)
(422)	31 juill. 2024	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(2 555)	(241)
(714)	31 juill. 2024	Sedana Medical Ab, swap sur rendement total	(2 164)	(264)
(9 537)	31 juill. 2024	Sinch Ab, swap sur rendement total	(46 806)	(9 498)
(99)	31 juill. 2024	Skanska Ab, actions, B, swap sur rendement total	(2 362)	(149)
(2 223)	31 juill. 2024	Skf Ab, actions, B, swap sur rendement total	(58 550)	(99)
(503)	31 juill. 2024	Skistar Ab, swap sur rendement total	(7 878)	(458)
(188)	31 juill. 2024	Ssab Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 896)	35
(141)	31 juill. 2024	Troax Group Ab, swap sur rendement total	(4 568)	(789)
(692)	31 juill. 2024	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(17 629)	(1 060)
(1 898)	31 juill. 2024	Volvo Ab, actions, B, swap sur rendement total	(64 990)	(2 615)
(7 100)	31 juill. 2024	Volvo Car Ab, B, swap sur rendement total	(30 247)	1 397
(3 141)	31 juill. 2024	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(22 480)	(3 647)
				(57 190)
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(372)	31 juill. 2024	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(24 052)	496
(286)	31 juill. 2024	Arbonia Ag, swap sur rendement total	(4 315)	(472)
(4)	31 juill. 2024	Autoneum Holding Ag, swap sur rendement total	(855)	(101)
(374)	31 juill. 2024	Avolta Ag, swap sur rendement total	(19 383)	(1 230)
(57)	31 juill. 2024	Bachem Holding Ag, actions ord., B, swap sur rendement total	(5 805)	6
(135)	31 juill. 2024	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(27 876)	476
(20)	31 juill. 2024	Barry Callebaut Ag, actions ord., swap sur rendement total	(44 462)	1 033
(10)	31 juill. 2024	Bystronic Ag, swap sur rendement total	(7 465)	439
(1 160)	31 juill. 2024	Cie Financière Richemont, actions ord., swap sur rendement total	(210 359)	(7 136)
(119)	31 juill. 2024	Cosmo Pharmaceuticals Nv, swap sur rendement total	(9 490)	(1 392)
(21)	31 juill. 2024	Daetwyler Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(6 422)	114
(31)	31 juill. 2024	Efg International Ag, swap sur rendement total	(525)	(12)
(18)	31 juill. 2024	Givaudan, actions ord., swap sur rendement total	(98 250)	(5 869)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(14)	31 juill. 2024	Holcim Ltd, swap sur rendement total	(1 448)	(34)
(8)	31 juill. 2024	Komax Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(2 513)	(92)
(190)	31 juill. 2024	Lonza Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(105 286)	(4 462)
(3)	31 juill. 2024	Medacta Group Sa, swap sur rendement total	(590)	(36)
(39 270)	31 juill. 2024	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(12 028)	867
(104)	31 juill. 2024	Polypeptide Group Ag, swap sur rendement total	(2 855)	166
(502)	31 juill. 2024	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(12 898)	1 118
(232)	31 juill. 2024	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(49 287)	(4 999)
(3 084)	31 juill. 2024	Ubs Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(126 106)	(6 960)
(3)	31 juill. 2024	Vat Group Ag, swap sur rendement total	(1 981)	(85)
(107)	31 juill. 2024	Zurich Insurance Group Ag, swap sur rendement total	(73 692)	647
				<u>(27 518)</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(471)	31 juill. 2024	10X Genomics Inc, cat. A, swap sur rendement total	(34 755)	(3 733)
(3 300)	31 juill. 2024	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(23 567)	2 955
(1 203)	31 juill. 2024	89Bio Inc, swap sur rendement total	(17 719)	(2 905)
(96)	31 juill. 2024	Academy Sports & Outdoors In, swap sur rendement total	(8 366)	(403)
(87)	31 juill. 2024	Accenture Plc, cat. A, swap sur rendement total	(40 256)	(520)
(374)	31 juill. 2024	Acm Research Inc, cat. A, swap sur rendement total	(9 636)	(1 536)
(251)	31 juill. 2024	Adaptive Biotechnologies, swap sur rendement total	(1 622)	(153)
(209)	31 juill. 2024	Adobe Inc, swap sur rendement total	(164 415)	3 199
(431)	31 juill. 2024	Aemetis Inc, swap sur rendement total	(2 978)	(445)
(11)	31 juill. 2024	Aerovironment Inc, swap sur rendement total	(1 828)	154
(494)	31 juill. 2024	Aersale Corp, swap sur rendement total	(8 269)	555
(1 282)	31 juill. 2024	Agilon Health Inc, swap sur rendement total	(21 215)	(309)
(287)	31 juill. 2024	Agree Realty Corp, swap sur rendement total	(23 916)	(910)
(2)	31 juill. 2024	Al Masane Al Kobra Mining Co, swap sur rendement total	(38)	(2)
(13)	31 juill. 2024	Al Moammar Information Syste, swap sur rendement total	(608)	(36)
(2 000)	31 juill. 2024	Alfa S.A.B., A, swap sur rendement total	(2 119)	(156)
(185)	31 juill. 2024	Allegheny Technologies Inc, swap sur rendement total	(11 092)	(79)
(2 745)	31 juill. 2024	Allegro.Eu Sa, swap sur rendement total	(30 656)	(3 386)
(2 600)	31 juill. 2024	Alpargatas Sa, actions priv., swap sur rendement total	(7 150)	(478)
(35)	31 juill. 2024	Alteogen Inc, swap sur rendement total	(3 521)	(651)
(169)	31 juill. 2024	Altus Power Inc, swap sur rendement total	(1 522)	(84)
(3 084)	31 juill. 2024	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(26 486)	(2 631)
(1 300)	31 juill. 2024	Ambev Sa, swap sur rendement total	(4 850)	197
(729)	31 juill. 2024	America Movil, CAAE parrainé, cat. L, swap sur rendement total	(17 803)	(272)
(181)	31 juill. 2024	American Express Co, swap sur rendement total	(44 712)	(413)
(221)	31 juill. 2024	American Tower Corp, swap sur rendement total	(63 405)	(1 790)
(77)	31 juill. 2024	Analog Devices Inc, swap sur rendement total	(20 160)	(133)
(1 034)	31 juill. 2024	Anglogold Ashanti, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(25 483)	861
(242)	31 juill. 2024	Anheuser-Busch Inbev, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(20 620)	(384)
(45)	31 juill. 2024	Ansys Inc, swap sur rendement total	(21 532)	(90)
(1 130)	31 juill. 2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(89 192)	(7 139)
(896)	31 juill. 2024	Applovin Corp, cat. A, swap sur rendement total	(47 081)	(2 215)
(900)	31 juill. 2024	Arca Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	(12 959)	(795)
(846)	31 juill. 2024	Arcutis Biotherapeutics Inc, swap sur rendement total	(3 603)	(1 543)
(37)	31 juill. 2024	Arista Networks Inc, swap sur rendement total	(11 490)	(361)
(709)	31 juill. 2024	Armour Residential Reit Inc, swap sur rendement total	(18 062)	(1 546)
(1 897)	31 juill. 2024	Array Technologies Inc, swap sur rendement total	(42 023)	(3 184)
(818)	31 juill. 2024	Ars Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(5 911)	(682)
(100)	31 juill. 2024	Arvinas Inc, swap sur rendement total	(5 427)	(2 512)
(2)	31 juill. 2024	Ash-Sharqiyah Development Co, swap sur rendement total	(13)	-
(3 000)	31 juill. 2024	Asia Cement Corp, swap sur rendement total	(5 361)	(59)
(1 994)	31 juill. 2024	Astrazeneca Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(177 083)	(6 097)
(60)	31 juill. 2024	Atmos Energy Corp, swap sur rendement total	(9 170)	(187)
(1 426)	31 juill. 2024	Aurinia Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(16 904)	(596)
(3 588)	31 juill. 2024	Aurora Innovation Inc, swap sur rendement total	(20 675)	(3 261)
(33)	31 juill. 2024	Autozone Inc, swap sur rendement total	(112 510)	1 479
(94)	31 juill. 2024	Avis Budget Group Inc, swap sur rendement total	(21 971)	777
(530)	31 juill. 2024	Azenta Inc, swap sur rendement total	(45 524)	(4 194)
(87)	31 juill. 2024	Banco Bradesco, CAAE, swap sur rendement total	(418)	(34)
(1 077)	31 juill. 2024	Bank Al-Jazira, swap sur rendement total	(7 082)	(629)
(107)	31 juill. 2024	Bank Of Hawaii Corp, swap sur rendement total	(10 223)	(126)
(1 897)	31 juill. 2024	Bank Of New York Mellon Corp, swap sur rendement total	(130 197)	(8 637)
(79)	31 juill. 2024	BankUnited Inc, swap sur rendement total	(3 378)	36

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(822)	31 juill. 2024	Beauty Health Co/The, swap sur rendement total	(3 371)	(586)
(30 200)	31 juill. 2024	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(78 028)	(9 463)
(2 539)	31 juill. 2024	Bit Digital Inc, swap sur rendement total	(14 162)	(5 492)
(63)	31 juill. 2024	Boston Properties Inc, swap sur rendement total	(5 911)	(693)
(3 010)	31 juill. 2024	Bp Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(140 502)	(1)
(43)	31 juill. 2024	Bristow Group Inc, swap sur rendement total	(1 603)	(72)
(44)	31 juill. 2024	Broadcom Inc, swap sur rendement total	(64 763)	(7 914)
(46)	31 juill. 2024	Brunswick Corp, swap sur rendement total	(5 868)	(168)
(43 500)	31 juill. 2024	Bts Group Holdings Pcl, swap sur rendement total	(12 083)	(212)
(71)	31 juill. 2024	Bumble Inc, A, swap sur rendement total	(1 380)	(36)
(190)	31 juill. 2024	Cambium Networks Corp, swap sur rendement total	(1 503)	(329)
(17)	31 juill. 2024	Campbell Soup Co, swap sur rendement total	(969)	(13)
(1 523)	31 juill. 2024	Canadian Solar Inc, swap sur rendement total	(52 676)	(10 286)
(493)	31 juill. 2024	Caribou Biosciences Inc, swap sur rendement total	(3 725)	282
(28)	31 juill. 2024	Carlisle Cos Inc, swap sur rendement total	(11 535)	(1 035)
(374)	31 juill. 2024	Carrier Global Corp, swap sur rendement total	(28 426)	(890)
(1 113)	31 juill. 2024	Carvana Co, swap sur rendement total	(77 695)	(31 362)
(52)	31 juill. 2024	Casella Waste Systems Inc, A, swap sur rendement total	(5 860)	(269)
(1 177)	31 juill. 2024	Catalyst Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(26 089)	(3 778)
(3 000)	31 juill. 2024	Catcher Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(25 738)	(1 380)
(81)	31 juill. 2024	Chefs' Warehouse Inc/The, swap sur rendement total	(3 143)	(94)
(16)	31 juill. 2024	Chunbo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 801)	(33)
(1 837)	31 juill. 2024	Cia De Minas Buenaventur, CAAE, swap sur rendement total	(36 915)	(13 721)
(100)	31 juill. 2024	Cia Ferro Ligas Da Bahia, Fe, swap sur rendement total	(1 263)	(23)
(619)	31 juill. 2024	Cinemark Holdings Inc, swap sur rendement total	(11 500)	277
(2)	31 juill. 2024	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(662)	(28)
(1 000)	31 juill. 2024	Clear Sale Sa, swap sur rendement total	(1 019)	(94)
(279)	31 juill. 2024	Clearway Energy Inc, C, swap sur rendement total	(10 091)	(299)
(166)	31 juill. 2024	Clorox Company, swap sur rendement total	(31 211)	-
(121)	31 juill. 2024	Coastal Financial Corp/Wa, swap sur rendement total	(7 086)	(829)
(25)	31 juill. 2024	Cognex Corp, swap sur rendement total	(1 376)	(88)
(1 664)	31 juill. 2024	Cognizant Tech Solutions, A, swap sur rendement total	(165 724)	(10 666)
(250)	31 juill. 2024	Commscope Holding Co Inc, swap sur rendement total	(930)	(164)
(53)	31 juill. 2024	Compass Minerals Internation, swap sur rendement total	(1 770)	56
(368)	31 juill. 2024	Conduent Inc, swap sur rendement total	(1 771)	(208)
(17)	31 juill. 2024	Consol Energy Inc, swap sur rendement total	(2 254)	83
(101)	31 juill. 2024	Container Store Group Inc/Th, swap sur rendement total	(304)	(52)
(490)	31 juill. 2024	Cormedix Inc, swap sur rendement total	(2 429)	(320)
(3 316)	31 juill. 2024	Corteva Inc, swap sur rendement total	(209 529)	(9 229)
(6 000)	31 juill. 2024	Cosan Sa Industria Comercio, swap sur rendement total	(31 566)	(2 925)
(277)	31 juill. 2024	Cousins Properties Inc, swap sur rendement total	(8 894)	(1 287)
(64)	31 juill. 2024	Crescent Energy Inc, A, swap sur rendement total	(1 115)	(43)
(138)	31 juill. 2024	Crispr Therapeutics Ag, swap sur rendement total	(11 391)	(386)
(539)	31 juill. 2024	Crown Castle Intl Corp, swap sur rendement total	(81 868)	1 866
(34)	31 juill. 2024	Cs Disco Inc, swap sur rendement total	(340)	(73)
(1 000)	31 juill. 2024	Csbc Corp Taiwan, swap sur rendement total	(875)	41
(4 100)	31 juill. 2024	Cvc Brasil Operadora E Agenc, swap sur rendement total	(3 899)	39
(66)	31 juill. 2024	Cvr Energy Inc, swap sur rendement total	(2 637)	100
(15)	31 juill. 2024	Cvrx Inc, swap sur rendement total	(622)	(215)
(1 789)	31 juill. 2024	Cvs Health Corp, swap sur rendement total	(186 265)	(24 033)
(1 184)	31 juill. 2024	Cyfrowy Polsat Sa, swap sur rendement total	(4 892)	166
(598)	31 juill. 2024	Cymabay Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(18 625)	(2 490)
(400)	31 juill. 2024	Cyrela Brazil Realty Sa Emp, swap sur rendement total	(2 617)	(272)
(11)	31 juill. 2024	Dallah Healthcare Co, swap sur rendement total	(664)	(19)
(783)	31 juill. 2024	Delta Air Lines Inc, swap sur rendement total	(41 536)	(3 069)
(338)	31 juill. 2024	Designer Brands Inc, cat. A, swap sur rendement total	(3 944)	1 263
(1 007)	31 juill. 2024	Dexcom Inc, swap sur rendement total	(164 770)	(10 394)
(347)	31 juill. 2024	Diageo Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(66 647)	(912)
(400)	31 juill. 2024	Diagnosticos Da America Sa, swap sur rendement total	(1 046)	(59)
(109)	31 juill. 2024	Digi International Inc, swap sur rendement total	(3 737)	(148)
(15)	31 juill. 2024	Diodes Inc, swap sur rendement total	(1 593)	(98)
(200)	31 juill. 2024	Direcional Engenharia Sa, swap sur rendement total	(1 241)	(171)
(61)	31 juill. 2024	Discover Financial Services, swap sur rendement total	(9 041)	(688)
(520)	31 juill. 2024	Dollar General Corp, swap sur rendement total	(93 217)	(2 840)
(1 167)	31 juill. 2024	Dollar Tree Inc, swap sur rendement total	(218 587)	(27 667)
(146)	31 juill. 2024	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(3 459)	176

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 719)	31 juill. 2024	Doximity Inc, cat. A, swap sur rendement total	(63 558)	(7 932)
(83)	31 juill. 2024	Dyne Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 456)	(205)
(27)	31 juill. 2024	Eagle Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(186)	23
(118)	31 juill. 2024	Eastman Chemical Co, swap sur rendement total	(14 102)	(768)
(1 382)	31 juill. 2024	Ecopetrol Sa, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(21 722)	1 118
(339)	31 juill. 2024	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(99 707)	(4 503)
(87)	31 juill. 2024	Ecopro Co Ltd, swap sur rendement total	(57 485)	9 225
(221)	31 juill. 2024	Energy Recovery Inc, swap sur rendement total	(5 490)	86
(14 400)	31 juill. 2024	Eneva Sa, swap sur rendement total	(53 257)	(4 063)
(69)	31 juill. 2024	Enfusion Inc, cat. A, swap sur rendement total	(883)	22
(617)	31 juill. 2024	Enhabit Inc, swap sur rendement total	(8 421)	284
(7)	31 juill. 2024	Enpro Industries Inc, swap sur rendement total	(1 447)	(33)
(148)	31 juill. 2024	Entegris Inc, swap sur rendement total	(23 383)	(537)
(668)	31 juill. 2024	Eos Energy Enterprises Inc, swap sur rendement total	(960)	12
(39)	31 juill. 2024	Equifax Inc, swap sur rendement total	(12 717)	(1 293)
(926)	31 juill. 2024	Equitable Holdings Inc, swap sur rendement total	(40 660)	(2 569)
(36)	31 juill. 2024	Euronet Worldwide Inc, swap sur rendement total	(4 818)	57
(2 500)	31 juill. 2024	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(5 742)	(1 032)
(1 648)	31 juill. 2024	Evgo Inc, swap sur rendement total	(7 780)	(591)
(70)	31 juill. 2024	Exlservice Holdings Inc, swap sur rendement total	(2 848)	2
(5 000)	31 juill. 2024	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(25 408)	(736)
(27)	31 juill. 2024	Fair Isaac Corp, swap sur rendement total	(41 441)	(2 577)
(500)	31 juill. 2024	Fate Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(2 466)	(413)
(166)	31 juill. 2024	Fedex Corp, swap sur rendement total	(55 648)	1 312
(75)	31 juill. 2024	Fidelity National Info Serv, swap sur rendement total	(5 941)	62
(17)	31 juill. 2024	Firstcash Inc, swap sur rendement total	(2 430)	114
(13)	31 juill. 2024	Fitaihi Holding Group, swap sur rendement total	(14)	-
(261)	31 juill. 2024	Fleetcor Technologies Inc, swap sur rendement total	(97 262)	(4 715)
(4 700)	31 juill. 2024	Fleury Sa, swap sur rendement total	(23 040)	(1 361)
(329)	31 juill. 2024	Fluence Energy Inc, swap sur rendement total	(10 347)	(768)
(165)	31 juill. 2024	Fomento Economico Mex, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(28 360)	(560)
(80)	31 juill. 2024	Fti Consulting Inc, swap sur rendement total	(21 008)	1 094
(1 100)	31 juill. 2024	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(3 115)	(1 048)
(2 795)	31 juill. 2024	Gamestop Corp, cat. A, swap sur rendement total	(64 607)	(4 778)
(737)	31 juill. 2024	Ge Healthcare Tech, swap sur rendement total	(75 140)	(7 840)
(2 100)	31 juill. 2024	Genomma Lab Internacional, B, swap sur rendement total	(2 309)	(56)
(262)	31 juill. 2024	Genpact Ltd, swap sur rendement total	(11 991)	(50)
(19 300)	31 juill. 2024	Genting Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(14 899)	(276)
(43)	31 juill. 2024	Gogo Inc, swap sur rendement total	(574)	(7)
(14)	31 juill. 2024	Golden Entertainment Inc, swap sur rendement total	(737)	(18)
(1 269)	31 juill. 2024	Goodyear Tire & Rubber Co, swap sur rendement total	(23 962)	(634)
(211)	31 juill. 2024	Graco Inc, swap sur rendement total	(24 139)	(1 419)
(27)	31 juill. 2024	Grand Korea Leisure Co Ltd, swap sur rendement total	(372)	(9)
(161)	31 juill. 2024	Greenbrier Companies Inc, swap sur rendement total	(9 379)	(790)
(930)	31 juill. 2024	Gruma S.A.B., B, swap sur rendement total	(22 471)	236
(293)	31 juill. 2024	Grupa Azoty Sa, swap sur rendement total	(2 425)	(282)
(355)	31 juill. 2024	Grupo Aeroport Del Pacific, B, swap sur rendement total	(8 172)	(923)
(635)	31 juill. 2024	Grupo Aeroport Del Sureste, B, swap sur rendement total	(24 531)	(4 689)
(100)	31 juill. 2024	Grupo Bimbo Sab, série A, swap sur rendement total	(667)	24
(9 000)	31 juill. 2024	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(18 220)	(3 762)
(406)	31 juill. 2024	Guardant Health Inc, swap sur rendement total	(14 481)	8
(1 531)	31 juill. 2024	Halliburton Co, swap sur rendement total	(72 979)	2 213
(810)	31 juill. 2024	Hannon Armstrong Sustainable, swap sur rendement total	(29 879)	(922)
(103 400)	31 juill. 2024	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(125 037)	(3 670)
(713)	31 juill. 2024	Hawaiian Electric Inds, swap sur rendement total	(13 341)	(1 807)
(2 298)	31 juill. 2024	Hdfc Bank Ltd, CAAE, swap sur rendement total	(203 353)	(20 750)
(47)	31 juill. 2024	Helen Of Troy Ltd, swap sur rendement total	(7 487)	(725)
(24)	31 juill. 2024	Herc Holdings Inc, swap sur rendement total	(4 712)	(133)
(60)	31 juill. 2024	Home Depot Inc, swap sur rendement total	(27 418)	(2 217)
(2 182)	31 juill. 2024	Hsbc Holdings Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(116 641)	(5 598)
(2 000)	31 juill. 2024	Htc Corp, swap sur rendement total	(4 423)	(201)
(133)	31 juill. 2024	Hudson Pacific Properties In, swap sur rendement total	(1 633)	(66)
(232)	31 juill. 2024	Humasis Co Ltd, swap sur rendement total	(447)	35
(10)	31 juill. 2024	Huntington Ingalls Industrie, swap sur rendement total	(3 424)	(79)
(363)	31 juill. 2024	Hyatt Hotels Corp, cat. A, swap sur rendement total	(62 421)	(7 249)
(1 700)	31 juill. 2024	Hypera Sa, swap sur rendement total	(16 645)	(1 095)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(8)	31 juill. 2024	Hyundai Merchant Marine, swap sur rendement total	(160)	(33)
(115)	31 juill. 2024	Ideaya Biosciences Inc, swap sur rendement total	(5 395)	(591)
(69)	31 juill. 2024	Impinj Inc, swap sur rendement total	(8 191)	(552)
(600)	31 juill. 2024	Industrias Penoles Sab De Cv, swap sur rendement total	(11 567)	90
(3 831)	31 juill. 2024	Infosys Ltd, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(92 848)	(1 709)
(3 200)	31 juill. 2024	Infracommerce Cxaas Sa, swap sur rendement total	(1 609)	(182)
(261)	31 juill. 2024	Inhibrx Inc, swap sur rendement total	(13 078)	(4 509)
(1 495)	31 juill. 2024	Inmode Ltd, swap sur rendement total	(43 842)	3 150
(700)	31 juill. 2024	Intelbras Sa Industria De Te, swap sur rendement total	(4 212)	(77)
(8)	31 juill. 2024	Intellian Technologies Inc, swap sur rendement total	(592)	34
(96)	31 juill. 2024	International Money Express, swap sur rendement total	(2 796)	(147)
(2 123)	31 juill. 2024	Intl Flavors & Fragrances, swap sur rendement total	(228 934)	(16 077)
(109)	31 juill. 2024	Intrepid Potash Inc, swap sur rendement total	(3 434)	(471)
(73)	31 juill. 2024	Intuit Inc, swap sur rendement total	(60 164)	(183)
(88)	31 juill. 2024	Jabil Inc, swap sur rendement total	(14 783)	(1 173)
(388)	31 juill. 2024	Jastrzebska Spolka Weglowa S, swap sur rendement total	(5 465)	(290)
(928)	31 juill. 2024	Jinkosolar Holding Co, CAAE, swap sur rendement total	(45 202)	(6 637)
(77)	31 juill. 2024	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	(1 258)	(35)
(2 000)	31 juill. 2024	Kaori Heat Treatment Co Ltd, swap sur rendement total	(19 228)	1 684
(25)	31 juill. 2024	Keros Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 311)	(235)
(953)	31 juill. 2024	Kghm Polska Miedz Sa, swap sur rendement total	(39 187)	(2 660)
(9 800)	31 juill. 2024	Khon Kaen Sugar Industry Pcl, swap sur rendement total	(991)	(19)
(81)	31 juill. 2024	Kilroy Realty Corp, swap sur rendement total	(4 313)	(546)
(54)	31 juill. 2024	Kimbell Royalty Partners Lp, swap sur rendement total	(1 072)	8
(154)	31 juill. 2024	Knight-Swift Transportation, swap sur rendement total	(11 707)	(589)
(217)	31 juill. 2024	Kratos Defense & Security, swap sur rendement total	(5 806)	(329)
(158)	31 juill. 2024	Kronos Worldwide Inc, swap sur rendement total	(2 071)	(245)
(144)	31 juill. 2024	Kt&G Corp, swap sur rendement total	(12 780)	236
(461)	31 juill. 2024	Kymera Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(15 476)	(2 053)
(24)	31 juill. 2024	Lam Research Corp, swap sur rendement total	(24 851)	(298)
(27)	31 juill. 2024	Lamb Weston Holdings Inc, swap sur rendement total	(3 848)	55
(45)	31 juill. 2024	Laureate Education Inc, A, swap sur rendement total	(814)	(15)
(54)	31 juill. 2024	Lci Industries, swap sur rendement total	(8 951)	(1 196)
(212)	31 juill. 2024	Legend Biotech Corp, CAAE, swap sur rendement total	(16 820)	281
(1 370)	31 juill. 2024	Leslie'S Inc, swap sur rendement total	(12 483)	(762)
(61)	31 juill. 2024	Lg Energy Solution, swap sur rendement total	(26 632)	1 780
(323)	31 juill. 2024	Light & Wonder Inc, swap sur rendement total	(34 971)	1 996
(196)	31 juill. 2024	Lightwave Logic Inc, swap sur rendement total	(1 287)	7
(500)	31 juill. 2024	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(3 098)	(11)
(500)	31 juill. 2024	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(5 230)	1 212
(2 000)	31 juill. 2024	Lotus Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(23 453)	(1 565)
(1 000)	31 juill. 2024	Macronix International, swap sur rendement total	(1 352)	(133)
(48)	31 juill. 2024	Mahindra & Mahindra, CIAE parrainé, swap sur rendement total	(1 335)	(59)
(14)	31 juill. 2024	Markel Corp, swap sur rendement total	(26 212)	387
(1 067)	31 juill. 2024	Match Group Inc, swap sur rendement total	(51 354)	(2 966)
(243)	31 juill. 2024	Matson Inc, swap sur rendement total	(35 118)	(4 130)
(1 408)	31 juill. 2024	Mattel Inc, swap sur rendement total	(35 052)	378
(3 508)	31 juill. 2024	Melco Resorts & Entert, CAAE, swap sur rendement total	(41 030)	(4 801)
(600)	31 juill. 2024	Meliuz Sa - On, swap sur rendement total	(1 296)	(81)
(35)	31 juill. 2024	Mercadolibre Inc, swap sur rendement total	(72 528)	1 959
(43)	31 juill. 2024	Mercer International Inc, swap sur rendement total	(538)	(8)
(1 052)	31 juill. 2024	Mersana Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(3 218)	(913)
(4)	31 juill. 2024	Methanol Chemicals Co, swap sur rendement total	(28)	(1)
(4 000)	31 juill. 2024	Microbio Co Ltd, swap sur rendement total	(8 709)	157
(890)	31 juill. 2024	Microvast Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 643)	(265)
(3)	31 juill. 2024	Middle East Paper Co, swap sur rendement total	(36)	(4)
(141)	31 juill. 2024	Mister Car Wash Inc, swap sur rendement total	(1 606)	(51)
(1 111)	31 juill. 2024	Moderna Inc, swap sur rendement total	(145 691)	(30 903)
(171)	31 juill. 2024	Modivcare Inc, swap sur rendement total	(9 919)	(1 373)
(108)	31 juill. 2024	Mongodb Inc, swap sur rendement total	(58 224)	1 318
(142)	31 juill. 2024	Monolithic Power Systems Inc, swap sur rendement total	(118 295)	(5 800)
(49)	31 juill. 2024	Montauk Renewables Inc, swap sur rendement total	(576)	24
(527)	31 juill. 2024	Mosaic Co/The, swap sur rendement total	(24 829)	415
(1 622)	31 juill. 2024	Mp Materials Corp, swap sur rendement total	(42 455)	(8 264)
(7 300)	31 juill. 2024	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(2 420)	187
(6 000)	31 juill. 2024	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	(18 310)	(2 714)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(1 000)	31 juill. 2024	Nan Ya Plastics Corp, swap sur rendement total	(2 867)	7
(794)	31 juill. 2024	Nano-X Imaging Ltd, swap sur rendement total	(6 669)	371
(446)	31 juill. 2024	Natera Inc, swap sur rendement total	(36 838)	(3 809)
(137)	31 juill. 2024	National Retail Properties, swap sur rendement total	(7 786)	(402)
(77)	31 juill. 2024	Nayifat Finance Co, swap sur rendement total	(398)	(22)
(5)	31 juill. 2024	Ncsoft Co, swap sur rendement total	(1 228)	115
(3 200)	31 juill. 2024	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 029)	(74)
(1 000)	31 juill. 2024	Neo Solar Power Corp, swap sur rendement total	(634)	(14)
(477)	31 juill. 2024	Neogenomics Inc, swap sur rendement total	(10 177)	2 095
(233)	31 juill. 2024	New York Times Co, A, swap sur rendement total	(15 051)	(872)
(1 959)	31 juill. 2024	Nextera Energy Inc, swap sur rendement total	(156 900)	(5 038)
(27)	31 juill. 2024	Nextera Energy Partners Lp, swap sur rendement total	(1 083)	(19)
(24)	31 juill. 2024	Nice Lt, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(6 314)	77
(953)	31 juill. 2024	Nikola Corp, swap sur rendement total	(1 099)	43
(6)	31 juill. 2024	Novanta Inc, swap sur rendement total	(1 332)	(90)
(1 440)	31 juill. 2024	Ocular Therapeutix Inc, swap sur rendement total	(8 469)	(1 310)
(227)	31 juill. 2024	Ollie'S Bargain Outlet Holdi, swap sur rendement total	(22 716)	(669)
(2 100)	31 juill. 2024	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(5 826)	(487)
(775)	31 juill. 2024	Omnicom Group, swap sur rendement total	(89 121)	(6 031)
(9 000)	31 juill. 2024	Oneness Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	(75 469)	2 589
(77)	31 juill. 2024	Oneok Inc, swap sur rendement total	(7 130)	37
(10)	31 juill. 2024	Onewater Marine Inc, cat. A, swap sur rendement total	(446)	(90)
(338)	31 juill. 2024	Open Lending Corp, cat. A, swap sur rendement total	(3 793)	(352)
(4 800)	31 juill. 2024	Operadora De Sites Mex- A-1, swap sur rendement total	(8 924)	(934)
(3 200)	31 juill. 2024	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(9 349)	(297)
(100)	31 juill. 2024	O'Reilly Automotive Inc, swap sur rendement total	(125 278)	4 771
(176)	31 juill. 2024	Oric Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(2 135)	(294)
(50)	31 juill. 2024	Oscotec Inc, swap sur rendement total	(1 177)	(198)
(390)	31 juill. 2024	Otis Worldwide Corp, swap sur rendement total	(46 010)	(1 372)
(5 146)	31 juill. 2024	Palantir Technologies Inc, A, swap sur rendement total	(116 507)	10 460
(810)	31 juill. 2024	Par Pacific Holdings Inc, swap sur rendement total	(38 846)	(2 028)
(1 937)	31 juill. 2024	Park Hotels & Resorts Inc, swap sur rendement total	(43 420)	(3 704)
(16)	31 juill. 2024	Patrick Industries Inc, swap sur rendement total	(2 117)	(281)
(888)	31 juill. 2024	Patterson-Uti Energy Inc, swap sur rendement total	(12 646)	1 096
(19 600)	31 juill. 2024	Pet Center Comercio E Partic, swap sur rendement total	(21 073)	692
(4 500)	31 juill. 2024	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(26 560)	(2 266)
(1 000)	31 juill. 2024	Pharmaessentia Corp, swap sur rendement total	(14 917)	512
(161)	31 juill. 2024	Pitney Bowes Inc, swap sur rendement total	(934)	(73)
(265)	31 juill. 2024	Planet Fitness In, cat. A, swap sur rendement total	(25 508)	(481)
(10 550)	31 juill. 2024	Polski Koncern Naftowy Orlen, swap sur rendement total	(231 577)	(24 921)
(139)	31 juill. 2024	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	(50 962)	(4 736)
(22 000)	31 juill. 2024	Powerchip Semiconductor Manu, swap sur rendement total	(27 933)	51
(19)	31 juill. 2024	Pra Group Inc, swap sur rendement total	(656)	(39)
(1 400)	31 juill. 2024	Precious Shipping Pcl, swap sur rendement total	(464)	(19)
(245)	31 juill. 2024	Privia Health Group Inc, swap sur rendement total	(7 440)	(485)
(892)	31 juill. 2024	Pultegroup Inc, swap sur rendement total	(121 642)	(6 910)
(349)	31 juill. 2024	Purecycle Technologies Inc, swap sur rendement total	(1 864)	3
(3 200)	31 juill. 2024	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(17 470)	(4 374)
(6 000)	31 juill. 2024	Quanta Computer Inc, swap sur rendement total	(58 073)	(6 889)
(1 237)	31 juill. 2024	Quantum-Si Inc, swap sur rendement total	(3 279)	(643)
(558)	31 juill. 2024	Quinstreet Inc, swap sur rendement total	(9 433)	(51)
(446)	31 juill. 2024	Rabigh Refining And Petroche, swap sur rendement total	(1 634)	81
(627)	31 juill. 2024	Rackspace Technology Inc, swap sur rendement total	(1 654)	(608)
(59)	31 juill. 2024	Ralph Lauren Corp, swap sur rendement total	(11 277)	63
(519)	31 juill. 2024	Rambus Inc, swap sur rendement total	(46 707)	(277)
(3 777)	31 juill. 2024	Recursion Pharmaceuticals, A, swap sur rendement total	(49 106)	(12 490)
(43)	31 juill. 2024	Red Robin Gourmet Burgers, swap sur rendement total	(707)	(203)
(33)	31 juill. 2024	Red Rock Resorts Inc, cat. A, swap sur rendement total	(2 321)	(34)
(43)	31 juill. 2024	Red Sea International Co, swap sur rendement total	(349)	2
(80)	31 juill. 2024	Repligen Corp, swap sur rendement total	(18 967)	(2 311)
(106)	31 juill. 2024	Resideo Technologies Inc, swap sur rendement total	(2 631)	(66)
(26)	31 juill. 2024	Revolution Medicines Inc, swap sur rendement total	(983)	(69)
(21)	31 juill. 2024	Rocky Brands Inc, swap sur rendement total	(836)	(33)
(8)	31 juill. 2024	Rogers Corp, swap sur rendement total	(1 393)	38
(843)	31 juill. 2024	Ross Stores Inc, swap sur rendement total	(153 832)	(4 948)
(124)	31 juill. 2024	Royal Caribbean Cruises Ltd, swap sur rendement total	(21 172)	(3 411)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(58)	31 juill. 2024	Rxo Inc, swap sur rendement total	(1 779)	29
(135)	31 juill. 2024	Ryder System Inc, swap sur rendement total	(20 482)	(1 326)
(1)	31 juill. 2024	Sadr Logistics Co, swap sur rendement total	(1)	-
(869)	31 juill. 2024	Sage Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(24 831)	(2 309)
(610)	31 juill. 2024	Samsara Inc, cat. A, swap sur rendement total	(26 849)	(297)
(759)	31 juill. 2024	Sana Biotechnology Inc, swap sur rendement total	(4 083)	33
(1 000)	31 juill. 2024	Santos Brasil Participacoes, swap sur rendement total	(2 567)	(306)
(6)	31 juill. 2024	Saudi Airlines Catering Co, swap sur rendement total	(267)	(27)
(7 847)	31 juill. 2024	Saudi Arabian Mining Co, swap sur rendement total	(121 816)	(11 525)
(6)	31 juill. 2024	Saudi Printing & Packaging C, swap sur rendement total	(33)	-
(440)	31 juill. 2024	Saudi Tadawul Group Holding, swap sur rendement total	(28 405)	(28)
(8)	31 juill. 2024	Saudi Vitriified Clay Pipe Co, swap sur rendement total	(136)	(15)
(30)	31 juill. 2024	Schnitzer Steel Inds Inc, A, swap sur rendement total	(1 193)	(175)
(156)	31 juill. 2024	Scholar Rock Holding Corp, swap sur rendement total	(3 867)	(582)
(159)	31 juill. 2024	Scorpio Tankers Inc, swap sur rendement total	(12 747)	(1 164)
(1 861)	31 juill. 2024	Shell Plc, CAAE, swap sur rendement total	(161 468)	1 552
(123)	31 juill. 2024	Shoe Carnival Inc, swap sur rendement total	(4 900)	(447)
(8 705)	31 juill. 2024	Sibanye-Stillwater Ltd, CAAE, swap sur rendement total	(62 328)	(10 944)
(34)	31 juill. 2024	Signet Jewelers Ltd, swap sur rendement total	(4 809)	(339)
(80)	31 juill. 2024	Skywest Inc, swap sur rendement total	(5 506)	(490)
(1 029)	31 juill. 2024	Skyworks Solutions Inc, swap sur rendement total	(152 536)	(13 414)
(1 045)	31 juill. 2024	Sl Green Realty Corp, swap sur rendement total	(62 586)	(12 008)
(3 520)	31 juill. 2024	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	(18 054)	(243)
(1 314)	31 juill. 2024	Sotera Health Co, swap sur rendement total	(29 195)	(2 222)
(1 963)	31 juill. 2024	Soundhound Ai Inc, A, swap sur rendement total	(5 487)	72
(14)	31 juill. 2024	South State Corp, swap sur rendement total	(1 559)	41
(238)	31 juill. 2024	Stagwell Inc, swap sur rendement total	(2 081)	(176)
(77)	31 juill. 2024	Sterling Check Corp, swap sur rendement total	(1 413)	(90)
(41)	31 juill. 2024	Stratus Properties Inc, swap sur rendement total	(1 560)	(37)
(2 417)	31 juill. 2024	Sunrun Inc, swap sur rendement total	(62 562)	(21 297)
(60)	31 juill. 2024	Sutro Biopharma Inc, swap sur rendement total	(339)	(59)
(39)	31 juill. 2024	Takween Advanced Industries, swap sur rendement total	(210)	(11)
(330)	31 juill. 2024	Taskus Inc, A, swap sur rendement total	(5 687)	(388)
(57)	31 juill. 2024	Tenet Healthcare Corp, swap sur rendement total	(5 680)	(10)
(46)	31 juill. 2024	Tesla Inc, swap sur rendement total	(15 072)	(401)
(3 812)	31 juill. 2024	Teva Pharmaceutical, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(52 477)	(2 931)
(80)	31 juill. 2024	Texas Capital Bancshares Inc, swap sur rendement total	(6 818)	(340)
(139)	31 juill. 2024	Theravance Biopharma Inc, swap sur rendement total	(2 060)	(132)
(138)	31 juill. 2024	Thredup Inc, cat. A, swap sur rendement total	(409)	(53)
(217)	31 juill. 2024	Tidewater Inc, swap sur rendement total	(20 633)	(2 816)
(1 118)	31 juill. 2024	Totalenergies Se, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(100 524)	(165)
(1 023)	31 juill. 2024	Trade Desk Inc/The, cat. A, swap sur rendement total	(97 069)	(1 369)
(28)	31 juill. 2024	Transcat Inc, swap sur rendement total	(4 037)	(406)
(5 400)	31 juill. 2024	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(56 319)	(3 516)
(354)	31 juill. 2024	Transunion, swap sur rendement total	(32 073)	(4 519)
(584)	31 juill. 2024	Truist Financial Corp, swap sur rendement total	(28 431)	(3 509)
(456)	31 juill. 2024	Ttm Technologies, swap sur rendement total	(9 506)	(154)
(1 053)	31 juill. 2024	Twist Bioscience Corp, swap sur rendement total	(51 180)	(15 915)
(1)	31 juill. 2024	Umm Al-Qura Cement Co, swap sur rendement total	(6)	-
(2 700)	31 juill. 2024	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(252)	(5)
(588)	31 juill. 2024	Unilever Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(37 588)	(468)
(1 000)	31 juill. 2024	Unimicron Technology Corp, swap sur rendement total	(7 588)	(101)
(56)	31 juill. 2024	Unisys Corp, swap sur rendement total	(415)	(42)
(348)	31 juill. 2024	Us Cellular Corp, swap sur rendement total	(19 062)	1 862
(9 800)	31 juill. 2024	Vamos Locacao De Caminhos M, swap sur rendement total	(27 667)	(3 325)
(41)	31 juill. 2024	Vaxcyte Inc, swap sur rendement total	(3 395)	(573)
(478)	31 juill. 2024	Verisk Analytics Inc, swap sur rendement total	(150 551)	2 220
(36)	31 juill. 2024	Vertex Inc, cat. A, swap sur rendement total	(1 279)	2
(159)	31 juill. 2024	Viavi Solutions Inc, swap sur rendement total	(2 111)	(70)
(87)	31 juill. 2024	Vici Properties Inc, swap sur rendement total	(3 705)	(110)
(377)	31 juill. 2024	Vista Outdoor Inc, swap sur rendement total	(14 700)	(624)
(369)	31 juill. 2024	Vistra Corp, swap sur rendement total	(18 742)	(476)
(18)	31 juill. 2024	Vse Corp, swap sur rendement total	(1 534)	(70)
(29)	31 juill. 2024	Walker & Dunlop Inc, swap sur rendement total	(4 245)	(613)
(6 000)	31 juill. 2024	Walsin Lihwa Corp, swap sur rendement total	(9 998)	(129)
(2 000)	31 juill. 2024	Wan Hai Lines Ltd, swap sur rendement total	(4 742)	(789)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(625)	31 juill. 2024	Warby Parker Inc, cat. A, swap sur rendement total	(11 620)	(3 007)
(5 125)	31 juill. 2024	Warner Bros Discovery Inc, swap sur rendement total	(76 904)	(5 887)
(42)	31 juill. 2024	Weatherford International Pl, swap sur rendement total	(5 418)	81
(23)	31 juill. 2024	Weis Markets Inc, swap sur rendement total	(1 940)	(3)
(21)	31 juill. 2024	Westlake Chemical Corp, swap sur rendement total	(3 876)	(305)
(6)	31 juill. 2024	Wex Inc, swap sur rendement total	(1 539)	(137)
(45)	31 juill. 2024	Wiley (John) & Sons, cat. A, swap sur rendement total	(1 904)	9
(4)	31 juill. 2024	Woongjin Coway Co Ltd, swap sur rendement total	(234)	(29)
(203)	31 juill. 2024	Wp Carey Inc, swap sur rendement total	(17 578)	(373)
(867)	31 juill. 2024	Ww International Inc, swap sur rendement total	(10 003)	(1 754)
(485)	31 juill. 2024	Zentalis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(9 689)	(2 466)
(235)	31 juill. 2024	Zumiez Inc, swap sur rendement total	(6 303)	(431)
				<u>(632 131)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		<u>(886 620)</u>
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		<u>410 450</u>
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		<u>(1 036 133)</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		<u>(625 683)</u>

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

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

Parallèlement au changement de raison sociale indiqué ci-dessus, l'objectif du Fonds a également changé. L'objectif de placement du Fonds est de procurer un rendement absolu positif et attrayant redressé en fonction du risque sur une longue période de temps qui présente une faible corrélation avec les portefeuilles de placements en actions traditionnels et qui est moins volatil que celui de tels portefeuilles en investissant dans des titres et des contrats dérivés, ainsi qu'en employant des stratégies de couverture de titres et des stratégies neutres sur le marché des actions.value

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 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	1 503 920 \$	– \$	– \$	1 503 920 \$
Actions américaines – position acheteur	15 387 619	171	–	15 387 790
Actions étrangères – position acheteur	12 417 244	1 388	–	12 418 632
Contrats de change à terme	–	664 638	–	664 638
Contrats de swap	–	410 450	–	410 450
	29 308 783 \$	1 076 647 \$	– \$	30 385 430 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 820 354 \$	574 \$	– \$	1 820 928 \$
Actions américaines – position vendeur	8 650 667	328	–	8 650 995
Actions étrangères – position vendeur	7 986 505	–	–	7 986 505
Contrats de change à terme	–	85 685	–	85 685
Contrats de swap	–	1 036 133	–	1 036 133
	18 457 526 \$	1 122 720 \$	– \$	19 580 246 \$

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2022

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

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

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

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, 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
2023					
Série A	14 220	25 724	–	(2 335)	37 609
Série F	187 498	1 007 322	–	(150 414)	1 044 406
Série I	1 833 972	–	–	(815 330)	1 018 642
2022					
Série A	13 355	1 377	743	(1 255)	14 220
Série F	321 623	20 845	9 858	(164 828)	187 498
Série I	1 970 842	49	136 669	(273 588)	1 833 972

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2023, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de 759 913 \$ (759 913 \$ en 2022) 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 2022).

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

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

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

Frais de gestion

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

Rémunération au rendement

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

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 31 décembre 2023, CCLFGII détenait 934 361 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 541 180 \$ (1 747 173 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 17 820 990 \$ en 2022). Au 31 décembre 2023, GFCC&L détenait 6 649 parts de série A, 6 892 parts de série F et 7 260 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 73 899 \$, 76 990 \$ et 81 902 \$ (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 \$ en 2022).

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

Le Fonds a payé 54 745 \$ (53 834 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Les paiements indirects effectués pour l'exercice se sont établis à 11 256 \$ (7 124 \$ en 2022).

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

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

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

Au 31 décembre 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	17 815	–	17 815	0,1	891
Livre sterling	104 869	900 990	1 005 859	4,3	50 293
Renminbi chinois	803	–	803	–	40
Couronne danoise	325 526	(285 669)	39 857	0,2	1 993
Euro	(19 064)	(654 010)	(673 074)	(2,9)	(33 654)
Dollar de Hong Kong	65 221	(559 960)	(494 739)	(2,1)	(24 737)
Forint hongrois	1 702	–	1 702	–	85
Nouveau shekel israélien	15 414	(184 192)	(168 778)	(0,7)	(8 439)
Yen japonais	219 185	(62 338)	156 847	0,7	7 842
Ringgit malaisien	(620)	–	(620)	–	(31)
Peso mexicain	9 407	–	9 407	–	470
Dollar néo-zélandais	31 253	–	31 253	0,1	1 563
Couronne norvégienne	83 743	(372 766)	(289 023)	(1,2)	(14 451)
Zloty polonais	1 944	–	1 944	–	97
Dollar de Singapour	29 467	–	29 467	0,1	1 473
Rand sud-africain	6 797	–	6 797	–	340
Couronne suédoise	(16 513)	(484 113)	(500 626)	(2,1)	(25 031)
Franc suisse	(21 371)	(310 204)	(331 575)	(1,4)	(16 579)
Bath thaïlandais	(2 437)	–	(2 437)	–	(122)
Lire turque	(47 236)	–	(47 236)	(0,2)	(2 362)
Dirham des ÉAU	731	–	731	–	37
Dollar américain	11 034 747	(20 713 715)	(9 678 968)	(41,1)	(483 948)
Total	11 841 383	(22 725 977)	(10 884 594)	(46,2)	(544 230)

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2022

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

Risque de taux d'intérêt

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

Autre risque de prix

Aux 31 décembre 2023 et 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix, principalement en raison de ses placements en actions négociées sur des bourses. La quasi-totalité de l'actif net du Fonds attribuable aux porteurs de parts rachetables est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions négociées avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué d'environ 1 085 000 \$ (1 885 000 \$ en 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2023 et 2022, le risque de crédit était négligeable, car l'exposition du Fonds aux titres de créance n'était pas importante. Le Fonds était exposé au risque de crédit du fait de ses placements dans des instruments dérivés. Les gains latents sur les obligations contractuelles avec les contreparties correspondaient à 4,6 % (1,7 % en 2022) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Les contreparties aux instruments dérivés avaient toutes obtenu des notations de A ou mieux (résultat de la combinaison des notations attribuées par diverses agences, comme Standard & Poor's, Moody's et Dominion Bond Rating Services).

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

Prêt de titre (note 12)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023 (\$)	2022 (\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	4 292	2 167
Charges liées au prêt de titres	(846)	(427)
Revenus nets tirés du prêt de titres	3 446	1 740
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(307)	(154)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	3 139	1 586

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

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

	2023 (en milliers de \$)	2022 (en milliers de \$)
Titres prêtés	2 353	848
Garanties reçues	2 471	890
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 72,2 % à 208,0 % (de 62,1 % à 79,8 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 146,1 % (73,0 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 15 765 279 \$ (de 1 873 990 \$ à 4 792 875 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 5,36 % (1,95 % en 2022). Au 31 décembre 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à néant (15,7 % en 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

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

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2023	2022
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	12 098 607 \$	2 409 454 \$
Placements	9 496 123	22 962 988
Plus-value latente des contrats de change à terme	362 813	22 253
Plus-value latente des contrats de swap	922 862	320 991
Marge de variation quotidienne	2 760 593	2 029 587
Montant à recevoir du courtier	562 976	579 416
Dividendes à recevoir	13 172	60 755
Autres créances	870	205
	26 218 016	28 385 649
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	—	3 388 108
Placements vendus à découvert	11 684 181	5 619 834
Moins-value latente des contrats de change à terme	112 715	1 727
Moins-value latente des contrats de swap	409 434	320 346
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	19 545	14 881
Montant à payer au courtier	521 056	472 464
Frais d'emprunt de titres à payer	10 528	6 277
Charges à payer	56 061	59 483
Frais de gestion à payer	1 996	2 074
Rémunération au rendement à payer	5 485	5 991
	12 821 001	9 891 185
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 397 015 \$	18 494 464 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	476 330 \$	483 210 \$
Série F	1 735 199 \$	3 195 816 \$
Série I	11 185 486 \$	14 815 438 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	44 592	48 055
Série F	159 079	313 938
Série I	1 017 111	1 454 887
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	10,68 \$	10,06 \$
Série F	10,91 \$	10,18 \$
Série I	11,00 \$	10,18 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

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

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(236 241) \$	(60 945) \$
Variation du gain (perte) de change latent	(127 338)	22 176
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	2 446	2 626
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	447 925	705 621
Charges de dividende sur les titres vendus à découvert	(222 930)	(117 492)
Intérêts aux fins des distributions	378 330	29 765
Gain (perte) net réalisé sur les placements	1 053 827	1 049 841
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(425 835)	669 814
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	291 141	(66 724)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(90 425)	133 064
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	401 098	153 880
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	486 875	(3 277 768)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(927 078)	188 063
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	229 572	15 958
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	512 783	(133 801)
Gain (perte) net total sur placements	<u>2 135 283</u>	<u>(649 779)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>1 774 150</u>	<u>(685 922)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	25 603	32 167
Honoraires des dépositaires	72 025	74 000
Frais de dépôt	19 047	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 464	4 711
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	578	642
Charges d'intérêts	130 167	81 534
Frais de gestion	20 877	26 022
Rémunération au rendement	10 381	6 977
Honoraires de professionnels	10 906	13 708
Coût d'emprunt de titres	110 874	79 480
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	12 894	10 359
Coûts de transaction (note 9)	36 864	23 511
Total des charges d'exploitation	<u>454 680</u>	<u>375 362</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(38 455)</u>	<u>(11 754)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>1 281 015 \$</u>	<u>(1 073 038) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	30 367 \$	(31 888) \$
Série F	243 928 \$	(284 337) \$
Série I	<u>1 006 720 \$</u>	<u>(756 813) \$</u>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	44 308	44 004
Série F	122 795	288 444
Série I	<u>1 106 107</u>	<u>1 417 786</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,69 \$	(0,72) \$
Série F	1,99 \$	(0,99) \$
Série I	<u>0,91 \$</u>	<u>(0,53) \$</u>

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

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

Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	483 210 \$	491 333 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	30 367	(31 888)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	49 693	46 014
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	42 264
Rachat de parts rachetables	(86 940)	(22 249)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(37 247)	66 029
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	–	(24 501)
Gains en capital nets réalisés	–	(17 763)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	–	(42 264)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(6 880)	(8 123)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	476 330 \$	483 210 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	3 195 816 \$	423 659 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	243 928	(284 337)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 330 440	4 049 906
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	2 294	326 456
Rachat de parts rachetables	(3 034 548)	(993 412)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(1 701 814)	3 382 950
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(372)	(208 378)
Gains en capital nets réalisés	–	(118 078)
Remboursement de capital	(2 359)	–
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 731)	(326 456)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(1 460 617)	2 772 157
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	1 735 199 \$	3 195 816 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

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

Pour les exercices clos les 31 décembre

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	14 815 438 \$	23 987 936 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 006 720	(756 813)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	15 002	32 881
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	154 811	1 595 412
Rachat de parts rachetables	(4 651 674)	(8 448 566)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(4 481 861)	(6 820 273)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(21 094)	(1 051 009)
Gains en capital nets réalisés	–	(544 403)
Remboursement de capital	(133 717)	–
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(154 811)	(1 595 412)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(3 629 952)	(9 172 498)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	11 185 486 \$	14 815 438 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	18 494 464 \$	24 902 928 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 281 015	(1 073 038)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 395 135	4 128 801
Réinvestissements des distributions aux porteurs de parts rachetables	157 105	1 964 132
Rachat de parts rachetables	(7 773 162)	(9 464 227)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(6 220 922)	(3 371 294)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(21 466)	(1 283 888)
Gains en capital nets réalisés	–	(680 244)
Remboursement de capital	(136 076)	–
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(157 542)	(1 964 132)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(5 097 449)	(6 408 464)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	13 397 015 \$	18 494 464 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 281 015 \$	(1 073 038) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	127 338	(22 176)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(1 053 827)	(1 049 841)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	425 835	(669 814)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(486 875)	3 277 768
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	927 078	(188 063)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	(229 572)	(15 958)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(512 783)	133 801
Achat de placements	(79 539 798)	(59 533 384)
Produit de la vente de placements	99 323 831	64 448 748
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(731 006)	81 863
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	47 583	12 747
(Augmentation) diminution des autres créances	(665)	(205)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	4 251	5 394
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	4 664	8 463
Augmentation (diminution) des charges à payer	(3 422)	25 203
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(78)	1 258
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	(506)	2 545
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	19 583 063	5 445 311
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	1 395 135	4 113 952
Rachat de parts rachetables**	(7 773 162)	(9 449 378)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	(437)	-
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(6 378 464)	(5 335 426)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	13 204 599	109 885
Variation du gain (perte) de change latent	(127 338)	22 176
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	2 409 454	804 922
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(3 388 108)	(1 915 637)
	12 098 607	(978 654)
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	12 098 607 \$	2 409 454 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	- \$	(3 388 108) \$
	12 098 607 \$	(978 654) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	457 109 \$	706 746 \$
Dividendes payés*	(218 266)	(109 029)
Intérêts reçus*	378 330	29 765
Intérêts payés*	(130 167)	(81 534)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de néant (14 849 \$ en 2022).

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L
(auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L)
Inventaire du portefeuille
Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 17,98 %)				
Athabasca Oil Corp.	6 200	8 823	25 854	
Bonterra Energy Corp.	400	3 692	2 092	
Corporation Cameco, TSE	1 700	90 363	97 115	
Canadian Natural Resources Ltd.	100	8 482	8 681	
Crew Energy Inc.	2 600	9 560	11 804	
Ensign Energy Services Inc.	500	1 051	1 085	
Gear Energy Ltd.	1 500	1 692	960	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	100	7 882	7 548	
Parex Resources Inc.	1 586	36 777	39 571	
Suncor Énergie Inc.	1 600	71 184	67 920	
Tourmaline Oil Corp.	1 100	73 318	65 549	
Valeura Energy Inc	3 300	11 713	9 372	
Whitecap Resources Inc.	100	1 097	887	
Yangarra Resources Ltd.	1 200	3 153	1 536	
		328 787	339 974	2,55
Matières premières (31 décembre 2022 : 12,16 %)				
Aris Mining Corp.	900	5 137	3 933	
Calibre Mining Corp.	1 800	1 934	2 448	
Capstone Copper Corp.	2 000	10 568	12 900	
Cascades inc.	1 300	16 221	16 549	
Centerra Gold Inc.	400	3 745	3 164	
Chemtrade Logistics Income Fund	1 527	13 209	13 010	
First Quantum Minerals Ltd.	4 500	54 503	48 825	
IAMGOLD Corp.	300	1 229	1 002	
Interfor Corp.	900	20 945	21 132	
Ivanhoe Mines Ltd.	100	1 139	1 285	
Liberty Gold Corp.	4 796	5 276	1 487	
Lucara Diamond Corp.	2 500	4 054	963	
Neo Performance Materials Inc.	200	2 247	1 526	
New Gold Inc.	7 700	11 814	14 784	
OceanaGold Corp.	9 699	26 606	24 635	
Orezone Gold Corp.	600	776	510	
Minière Osisko Inc.	2 400	9 633	6 408	
Pan American Silver Corp.	400	8 335	8 652	
Silvercorp Metals inc.	1 800	11 017	6 210	
Taseko Mines Ltd.	571	706	1 062	
Western Forest Products Inc.	100	180	71	
		209 274	190 556	1,42
Industries (31 décembre 2022 : 14,92 %)				
Air Canada	400	7 206	7 476	
ATS Corp.	1 200	45 714	68 532	
Black Diamond Group Ltd.	1 900	3 999	15 523	
Calian Group Ltd.	100	6 362	5 729	
Civeo Corp.	62	1 051	1 868	
Dexterra Group Inc.	140	1 133	806	
Doman Building Materials Group Ltd.	700	4 888	5 803	
Héroux-Devtek Inc.	300	5 378	4 560	
Magellan Aerospace Corp.	500	6 219	3 925	
Thomson Reuters Corp.	492	89 295	95 315	
Waste Connections Inc.	193	33 876	38 187	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
		205 121	247 724	1,85
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 3,11 %)				
Les Industries Dorel Inc., cat B	500	5 518	3 125	
Roots Corp.	500	1 465	1 250	
		6 983	4 375	0,03
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 3,54 %)				
Soins de santé (31 décembre 2022 : 0,27 %)				
XBiotech Inc.	200	1 018	1 055	0,01
Services financiers (31 décembre 2022 : 30,49 %)				
La Banque de Nouvelle-Écosse	100	6 235	6 450	
Brookfield Corp.	200	10 341	10 630	
Power Corporation du Canada	300	11 386	11 367	
		27 962	28 447	0,21
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 5,58 %)				
CGI Inc.	100	13 533	14 195	
Quarterhill Inc.	2 400	3 540	4 680	
Shopify Inc.	340	28 987	35 074	
		46 060	53 949	0,40
Services de communication (31 décembre 2022 : 5,34 %)				
Aimia Inc.	7 707	28 188	24 123	
BCE Inc.	700	38 722	36 519	
Corus Entertainment Inc.	1 500	7 381	1 065	
Québecor inc.	800	25 786	25 216	
		100 077	86 923	0,65
Services publics (31 décembre 2022 : 4,71 %)				
Boralex inc.	1 200	42 818	40 416	
Fortis Inc.	1 300	73 991	70 863	
Northland Power Inc.	1 516	43 324	36 490	
Polaris Renewable Energy Inc.	1 100	19 062	14 553	
Superior Plus Corp.	2 528	30 017	24 345	
		209 212	186 667	1,39
Immobilier (31 décembre 2022 : 3,16 %)				
Allied Properties REIT	100	1 746	2 018	
Groupe Altus limitée	845	46 097	35 608	
FirstService Corp.	200	40 434	42 930	
FPI Granite	900	82 490	68 652	
InterRent REIT	2 400	30 287	31 752	
Killam Apartment REIT	1 200	24 688	21 552	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	1 000	15 925	14 770	
		241 667	217 282	1,62
Total des actions canadiennes – position acheteur		1 376 161	1 356 952	10,13
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -0,53 %)				
Canacol Energy Ltd.	(300)	(2 111)	(2 088)	
Crescent Point Energy Corp.	(2 000)	(19 353)	(18 380)	
Denison Mines Corp.	(22 900)	(42 071)	(53 128)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(6 636)	(46 863)	(62 913)	
Energy Fuels Inc., TSE	(1 900)	(18 178)	(18 050)	
Journey Energy Inc.	(2 000)	(9 072)	(7 720)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Pason Systems Inc.	(1 100)	(12 722)	(17 787)	
Shawcor Ltée	(100)	(680)	(1 516)	
Ur-Energy Inc.	(1 900)	(2 280)	(3 838)	
Vermilion Energy Inc.	(1 000)	(17 708)	(15 970)	
		(171 038)	(201 390)	(1,50)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,49 %)				
Americas Gold & Silver Corp.	(3 100)	(7 563)	(1 023)	
Canfor Pulp Products Inc.	(200)	(1 851)	(360)	
Equinox Gold Corp.	(1 900)	(11 871)	(12 236)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(500)	(2 603)	(2 550)	
Global Atomic Corp.	(1 300)	(2 924)	(3 614)	
I-80 Gold Corp.	(1 500)	(2 759)	(3 495)	
Largo Inc.	(800)	(3 880)	(2 440)	
Lithium Americas Argentina Corp.	(3 900)	(36 509)	(32 565)	
MAG Silver Corp.	(637)	(10 214)	(8 784)	
Novagold Resources Inc.	(1 500)	(9 941)	(7 425)	
Orla Mining Ltd.	(1 000)	(5 827)	(4 320)	
Platinum Group Metals Ltd.	(500)	(1 241)	(750)	
Seabridge Gold Inc.	(500)	(7 595)	(8 030)	
Skeena Resources Ltd.	(1 000)	(7 995)	(6 450)	
Wallbridge Mining Co., Ltd.	(1 500)	(997)	(150)	
		(113 770)	(94 192)	(0,70)
Industries (31 décembre 2022 : -0,09 %)				
Ballard Power Systems Inc.	(4 000)	(23 984)	(19 640)	
CAE inc.	(2 200)	(65 057)	(62 920)	
Chorus Aviation Inc.	(1 400)	(5 239)	(3 584)	
GFL Environmental Inc., TSE	(1 200)	(50 811)	(54 852)	
La Compagnie Électrique Lion	(5 800)	(16 084)	(13 688)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 462)	(8 485)	(1 059)	
TELUS International CDA Inc.	(400)	(5 063)	(4 552)	
Xebec Adsorption Inc.	(4 300)	(9 817)	(1 645)	
		(184 540)	(161 940)	(1,21)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,25 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(200)	(1 088)	(1 356)	
Canada Goose Holdings Inc.	(2 700)	(53 531)	(42 498)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(500)	(31 237)	(28 255)	
Pet Valu Holdings Ltd.	(200)	(5 588)	(5 756)	
		(91 444)	(77 865)	(0,58)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,03 %)				
Neighbourly Pharmacy Inc.	(600)	(9 468)	(10 074)	
SunOpta Inc.	(5 400)	(31 288)	(39 042)	
		(40 756)	(49 116)	(0,37)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,42 %)				
Aurinia Pharmaceuticals Inc.	(215)	(3 003)	(2 549)	
Aurora Cannabis Inc.	(30 954)	(29 070)	(20 120)	
Bausch Health Cos Inc.	(2 400)	(26 749)	(25 512)	
Canopy Growth Corp.	(2 480)	(19 767)	(16 765)	
Cronos Group Inc.	(7 600)	(30 381)	(21 052)	
Oncolytics Biotech Inc.	(600)	(1 572)	(1 074)	
Organigram Holdings Inc., TSE	(6 875)	(17 459)	(11 825)	
SNDL Inc.	(22 053)	(76 125)	(47 690)	
		(204 126)	(146 587)	(1,09)
Services financiers (31 décembre 2022 : néant)				
ECN Capital Corp.	(6 800)	(17 146)	(20 400)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Corporation Nuvei	(900)	(20 762)	(31 329)	
		(37 908)	(51 729)	(0,39)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -0,22 %)				
Blackberry Ltd.	(200)	(1 125)	(940)	
Canadian Solar Inc.	(959)	(42 405)	(33 169)	
Computer Modelling Group Ltd.	(300)	(1 767)	(3 039)	
Converge Technology Solutions Corp.	(3 200)	(11 687)	(13 248)	
Dye & Durham Ltd.	(800)	(15 044)	(11 488)	
Lightspeed Commerce Inc.	(4 100)	(89 078)	(114 062)	
Novanta Inc.	(7)	(1 575)	(1 554)	
		(162 681)	(177 500)	(1,32)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,07 %)				
IMAX Corp.	(189)	(4 404)	(3 743)	
WildBrain Ltd.	(600)	(1 398)	(654)	
		(5 802)	(4 397)	(0,03)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,02 %)				
Fiducie d'impact Dream	(475)	(5 693)	(2 921)	
DREAM Unlimited Corp.	(200)	(3 918)	(4 530)	
Morguard REIT	(100)	(533)	(534)	
NorthWest Healthcare Properties REIT	(1 500)	(6 023)	(7 740)	
Tricon Residential Inc	(2 300)	(23 533)	(27 738)	
True North Commercial REIT	(209)	(3 805)	(2 100)	
		(43 505)	(45 563)	(0,34)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(1 055 570)	(1 010 279)	(7,53)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 2,20 %)				
Baker Hughes Co.	409	15 919	18 434	
Forum Energy Technologies Inc.	11	428	322	
Gran Tierra Energy Inc., NYSE	5	62	37	
Gran Tierra Energy Inc., TSE	400	8 884	2 976	
NACCO Industries Inc.	8	549	385	
Natural Gas Services Group Inc.	100	1 469	2 120	
Smart Sand Inc.	745	1 827	1 896	
Solaris Oilfield Infrastructure Inc.	91	1 288	955	
		30 426	27 125	0,20
Matières premières (31 décembre 2022 : 0,15 %)				
Coronado Global Resources Inc.	3 827	5 568	6 060	
McEwen Mining Inc., TSE	30	343	286	
Newmont Corp.	1 300	67 790	71 305	
Rayonier Advanced Materials Inc.	47	345	251	
		74 046	77 902	0,58
Industries (31 décembre 2022 : 0,51 %)				
ACCO Brands Corp.	886	5 405	7 103	
Acuity Brands Inc.	169	39 202	45 645	
American Superconductor Corp.	62	391	911	
ARC Document Solutions Inc.	100	477	433	
Asure Software Inc.	152	2 177	1 908	
BGSF Inc.	42	713	521	
BrightView Holdings Inc.	16	360	178	
CH Robinson Worldwide Inc.	49	6 424	5 582	
Comfort Systems USA Inc.	22	4 272	5 966	
Concrete Pumping Holdings Inc.	437	3 982	4 725	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
EMCOR Group Inc.	4	836	1 136	
Ennis Inc.	1 255	35 273	36 258	
Franklin Electric Co Inc.	5	597	637	
Global Industrial Co.	287	10 154	14 699	
Graham Corp.	150	2 694	3 752	
HNI Corp.	75	2 795	4 137	
Hurco Cos Inc.	160	5 362	4 542	
Liquidity Services Inc.	147	2 579	3 336	
LSI Industries Inc.	320	2 929	5 941	
Lyft Inc.	3 250	46 385	64 239	
McGrath RentCorp	28	3 358	4 416	
MillerKnoll Inc.	191	5 231	6 719	
Mistras Group Inc.	292	2 570	2 818	
NL Industries Inc.	100	822	740	
Orion Group Holdings Inc.	104	358	677	
Park-Ohio Holdings Corp.	150	2 635	5 332	
Powell Industries Inc.	222	12 662	25 877	
Proto Labs Inc.	166	7 794	8 528	
Steelcase Inc.	1 018	11 360	18 148	
Sterling Infrastructure Inc.	182	7 085	21 102	
Twin Disc Inc.	200	2 986	4 262	
Upwork Inc.	721	13 371	14 137	
V2X Inc.	200	11 124	12 247	
		254 363	336 652	2,51
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 1,55 %)				
ADT Inc.	648	6 775	5 827	
Beazer Homes USA Inc.	21	401	936	
Biglari Holdings Inc.	75	10 041	16 311	
Chegg Inc.	162	4 361	2 427	
Dream Finders Homes Inc.	147	2 799	6 887	
Green Brick Partners Inc.	10	310	685	
Harley-Davidson Inc.	92	4 453	4 469	
Kandi Technologies Group Inc.	113	379	417	
Landsea Homes Corp.	301	2 565	5 215	
Lincoln Educational Services Corp.	46	345	609	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	17	242	253	
Malibu Boats Inc.	55	4 080	3 976	
Marine Products Corp.	147	2 509	2 210	
Noodles & Co.	54	360	224	
Peloton Interactive Inc.	417	4 614	3 349	
Potbelly Corp.	175	2 529	2 404	
Qurate Retail Inc.	287	1 413	331	
Sonos Inc.	161	3 400	3 639	
Standard Motor Products Inc.	325	15 686	17 060	
Travel + Leisure Co.	1	49	52	
Universal Technical Institute Inc.	579	5 245	9 559	
Vacasa Inc.	89	2 258	962	
		74 814	87 802	0,66
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,58 %)				
Village Super Market Inc.	34	1 020	1 176	0,01
Soins de santé (31 décembre 2022 : 2,40 %)				
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	1 514	38 089	62 506	
Akebia Therapeutics Inc.	515	463	842	
Amicus Therapeutics Inc.	80	1 265	1 497	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
AMN Healthcare Services Inc.	109	12 460	10 762	
Astria Therapeutics Inc.	50	620	506	
Axogen Inc.	1 084	13 593	9 763	
Axonics Inc.	95	7 373	7 795	
BioAtla Inc.	1 469	5 041	4 765	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	262	3 636	2 069	
Brookdale Senior Living Inc.	121	689	929	
CareDx Inc.	99	2 844	1 566	
Chimerix Inc.	675	4 668	857	
Clover Health Investments Corp.	709	1 011	890	
Corcept Therapeutics Inc.	518	15 242	22 185	
Cytokinetics Inc.	147	7 183	16 183	
CytomX Therapeutics Inc.	1 511	4 124	3 088	
Deciphera Pharmaceuticals Inc.	92	2 564	1 957	
Embecta Corp.	118	4 235	2 945	
Enovis Corp.	39	2 837	2 881	
Epizyme Inc., droits	3	–	4	
Esperion Therapeutics Inc.	1 389	5 039	5 476	
Eton Pharmaceuticals Inc.	100	474	578	
Exact Sciences Corp.	2	174	195	
GoodRx Holdings Inc.	609	5 192	5 380	
HealthStream Inc.	18	548	642	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	176	8 901	11 741	
iRadimed Corp.	18	1 016	1 127	
KalVista Pharmaceuticals Inc.	243	4 166	3 925	
Karuna Therapeutics Inc.	56	15 107	23 372	
Karyopharm Therapeutics Inc.	88	443	100	
KORU Medical Systems Inc.	200	1 096	647	
Larimar Therapeutics Inc.	100	585	600	
Lineage Cell Therapeutics Inc.	233	369	335	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	47	16 288	14 340	
MannKind Corp.	119	866	571	
Medpace Holdings Inc.	3	808	1 213	
Nurix Therapeutics Inc.	64	1 047	871	
OPKO Health Inc.	1 009	3 564	2 009	
Orthofix Medical Inc.	31	792	551	
PDL BioPharma Inc.	1 415	5 052	–	
Protagonist Therapeutics Inc.	152	4 838	4 596	
Puma Biotechnology Inc.	327	1 376	1 867	
Replimune Group Inc.	8	352	89	
Savara Inc.	956	1 759	5 925	
Shockwave Medical Inc.	1	345	251	
Tactile Systems Technology Inc.	282	2 821	5 317	
Teladoc Health Inc.	714	31 796	20 289	
Tilray Brands Inc.	500	2 033	1 530	
Traverse Therapeutics Inc.	567	16 312	6 721	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	93	5 287	5 864	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	140	1 507	779	
Varex Imaging Corp.	1 274	30 361	34 438	
Ventyx Biosciences Inc.	221	9 040	720	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	305	2 526	2 743	
		309 817	318 792	2,38
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,12 %)				
Crawford & Co., cat. A	29	360	504	
Crawford & Co., cat. B	108	821	1 863	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Eagle Bancorp Inc.	5	363	199	
eHealth Inc.	1 636	18 925	18 811	
ESSA Bancorp Inc.	100	2 174	2 640	
Granite Point Mortgage Trust Inc.	103	702	807	
Heritage Insurance Holdings Inc.	399	1 878	3 430	
Macatawa Bank Corp.	32	421	476	
Medallion Financial Corp.	147	1 248	1 909	
NMI Holdings Inc.	228	6 740	8 923	
Remitly Global Inc.	520	11 743	13 316	
Selectquote Inc.	706	2 075	1 275	
Shore Bancshares Inc.	18	471	338	
Toast Inc.	8	190	193	
United Bankshares Inc.	3	124	149	
Universal Insurance Holdings Inc.	231	5 829	4 867	
Western New England Bancorp Inc.	69	925	819	
		54 989	60 519	0,45
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 2,34 %)				
Alarm.com Holdings Inc.	270	17 935	23 006	
Altair Engineering Inc.	127	12 061	14 092	
American Software Inc.	211	3 521	3 144	
Amtech Systems Inc.	29	359	161	
Arlo Technologies Inc.	186	1 917	2 335	
Bel Fuse Inc.	50	2 170	4 402	
Benchmark Electronics Inc.	12	373	437	
Brightcove Inc., droits	1 756	10 543	5 997	
CEVA Inc.	7	391	210	
Cirrus Logic Inc.	265	37 380	29 069	
Clear Secure Inc.	245	8 843	6 671	
Clearwater Analytics Holdings Inc.	134	2 781	3 539	
Cohu Inc.	120	6 027	5 600	
CPI Card Group Inc.	308	18 159	7 794	
Duolingo Inc.	210	38 827	62 816	
FormFactor Inc.	391	16 172	21 505	
F-Secure Oyj	1 347	6 153	3 993	
Guidewire Software Inc.	179	16 243	25 737	
Infinera Corp.	826	8 422	5 174	
Informatica Inc.	1 099	24 090	41 141	
Intel Corp.	239	9 434	15 836	
Jamf Holding Corp.	1 125	29 430	26 791	
LiveRamp Holdings Inc.	1	37	50	
Magnachip Semiconductor Corp.	1 719	21 531	17 000	
nCino Inc.	516	16 372	22 882	
Nutanix Inc.	9	307	566	
PagerDuty Inc.	102	4 410	3 114	
PDF Solutions Inc.	80	4 582	3 390	
Pegasystems Inc.	54	3 399	3 479	
Photronics Inc.	276	6 092	11 417	
Procore Technologies Inc.	123	9 645	11 227	
Pure Storage Inc.	1 414	47 604	66 488	
Q2 Holdings Inc.	130	5 649	7 441	
Rapid7 Inc.	17	2 338	1 280	
Rimini Street Inc.	740	4 068	3 191	
SEMrush Holdings Inc.	291	3 813	5 242	
Sprinklr Inc.	551	9 297	8 748	
Squarespace Inc.	1 544	63 339	67 206	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tenable Holdings Inc.	29	1 918	1 761	
Varonis Systems Inc.	167	6 475	9 971	
Veeco Instruments Inc.	42	1 151	1 718	
WM Technology Inc.	684	811	650	
		<u>484 069</u>	<u>556 271</u>	4,15
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,16 %)				
AdTheorent Holding Co Inc.	345	642	660	
Altice USA Inc.	3	32	13	
Angi Inc.	310	3 765	1 018	
Bandwidth Inc.	36	1 840	687	
HUUUGE Inc.	497	4 303	4 466	
Iridium Communications Inc.	60	4 789	3 256	
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM, série A	284	8 157	10 763	
Lumen Technologies Inc.	3 693	25 630	8 911	
NII Holdings Inc.	992	2 791	340	
Playstudios Inc.	205	1 134	733	
Roku Inc.	187	14 822	22 601	
Snap Inc.	2 042	27 993	45 585	
Spok Holdings Inc.	309	3 974	6 307	
		<u>99 872</u>	<u>105 340</u>	0,79
Services publics (31 décembre 2022 : 0,09 %)				
NRG Energy Inc.	1	45	68	
RGC Resources Inc.	200	6 253	5 364	
		<u>6 298</u>	<u>5 432</u>	0,04
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,26 %)				
Zillow Group Inc.	8	460	610	–
Total des actions américaines - positions acheteur		<u>1 390 174</u>	<u>1 577 621</u>	11,77
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,58 %)				
Aemetis Inc.	(62)	(388)	(428)	
Bristow Group Inc.	(20)	(753)	(746)	
Centrus Energy Corp.	(21)	(1 042)	(1 507)	
Clean Energy Fuels Corp.	(109)	(597)	(550)	
Core Laboratories Inc.	(580)	(14 449)	(13 506)	
Crescent Energy Co.	(42)	(735)	(732)	
Enviva Inc.	(1 281)	(19 538)	(1 682)	
Gevo Inc.	(791)	(2 279)	(1 210)	
Halliburton Co.	(110)	(6 181)	(5 243)	
Kimbell Royalty Partners LP	(310)	(6 411)	(6 152)	
Liberty Energy Inc.	(101)	(2 488)	(2 416)	
New Fortress Energy Inc.	(1 013)	(41 050)	(50 398)	
NextDecade Corp.	(676)	(5 196)	(4 252)	
Permian Resources Corp.	(893)	(15 997)	(16 014)	
RPC Inc.	(391)	(3 783)	(3 753)	
SilverBow Resources Inc.	(22)	(817)	(844)	
Tellurian Inc.	(4 287)	(5 769)	(4 271)	
TETRA Technologies Inc.	(67)	(541)	(399)	
Tidewater Inc.	(294)	(27 713)	(27 955)	
US Silica Holdings Inc.	(35)	(671)	(522)	
Vertex Energy Inc.	(2 796)	(16 397)	(12 498)	
		<u>(172 795)</u>	<u>(155 078)</u>	(1,16)
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,33 %)				
Alto Ingredients Inc.	(2)	(14)	(7)	
American Vanguard Corp.	(201)	(4 400)	(2 907)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
AptarGroup Inc.	(12)	(2 031)	(1 956)	
Aspen Aerogels Inc.	(79)	(897)	(1 644)	
ATI Inc.	(862)	(49 684)	(51 683)	
Carpenter Technology Corp.	(279)	(25 224)	(26 047)	
Corteva Inc.	(2 091)	(150 424)	(132 125)	
Eastman Chemical Co.	(493)	(55 240)	(58 389)	
International Flavors & Fragrances Inc.	(1 082)	(107 618)	(115 522)	
Intrepid Potash Inc.	(32)	(829)	(1 008)	
Kaiser Aluminum Corp.	(140)	(11 566)	(13 142)	
Livent Corp.	(2 144)	(55 444)	(50 831)	
Loop Industries Inc.	(386)	(1 358)	(1 924)	
LSB Industries Inc.	(21)	(385)	(258)	
Mercer International Inc., TSE	(388)	(4 919)	(4 850)	
Mosaic Co.	(302)	(14 631)	(14 228)	
MP Materials Corp.	(2 032)	(50 802)	(53 186)	
Piedmont Lithium Inc.	(69)	(4 701)	(2 568)	
PureCycle Technologies Inc.	(429)	(4 074)	(2 291)	
Ranpak Holdings Corp.	(7)	(353)	(54)	
Schnitzer Steel Industries Inc.	(267)	(9 185)	(10 618)	
Southern Copper Corp.	(67)	(6 698)	(7 604)	
Sylvamo Corp.	(87)	(5 613)	(5 634)	
Westlake Corp.	(11)	(1 937)	(2 030)	
Worthington Enterprises Inc.	(8)	(563)	(607)	
		(568 590)	(561 113)	(4,19)
Industries (31 décembre 2022 : -1,48 %)				
3D Systems Corp.	(2 540)	(16 967)	(21 268)	
AAR Corp.	(461)	(34 195)	(37 931)	
AerSale Corp.	(116)	(1 861)	(1 942)	
Allegiant Travel Co.	(89)	(8 294)	(9 695)	
Ameresco Inc.	(167)	(10 583)	(6 974)	
Array Technologies Inc.	(1 215)	(32 427)	(26 915)	
Blink Charging Co.	(82)	(996)	(367)	
Carrier Global Corp.	(738)	(54 156)	(55 906)	
Casella Waste Systems Inc.	(13)	(1 378)	(1 465)	
Delta Air Lines Inc.	(2 213)	(116 644)	(117 394)	
Douglas Dynamics Inc.	(12)	(409)	(470)	
Energy Recovery Inc.	(100)	(2 554)	(2 484)	
Eos Energy Enterprises Inc.	(690)	(2 213)	(992)	
Equifax Inc.	(118)	(31 247)	(38 477)	
Fluence Energy Inc.	(617)	(19 241)	(19 404)	
FuelCell Energy Inc.	(839)	(3 373)	(1 770)	
Gibraltar Industries Inc.	(52)	(3 484)	(5 415)	
Greenbrier Cos Inc.	(32)	(1 767)	(1 864)	
Hayward Holdings Inc.	(761)	(11 838)	(13 647)	
Herc Holdings Inc.	(13)	(2 100)	(2 552)	
ITT Inc.	(7)	(978)	(1 101)	
JELD-WEN Holding Inc.	(221)	(3 840)	(5 502)	
Lindsay Corp.	(3)	(523)	(511)	
Masterbrand Inc.	(4)	(44)	(78)	
Matson Inc.	(16)	(1 962)	(2 312)	
Microvast Holdings Inc.	(408)	(1 479)	(753)	
Mueller Water Products Inc.	(51)	(964)	(968)	
Nikola Corp.	(8 996)	(15 390)	(10 377)	
Nordson Corp.	(21)	(7 193)	(7 315)	
NuScale Power Corp.	(40)	(379)	(174)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Oshkosh Corp.	(387)	(49 475)	(55 321)	
Otis Worldwide Corp.	(413)	(48 245)	(48 724)	
Paylocity Holding Corp.	(18)	(4 528)	(3 913)	
Performant Financial Corp.	(111)	(360)	(457)	
Plug Power Inc.	(2 760)	(16 451)	(16 377)	
Rocket Lab USA Inc.	(1 240)	(7 398)	(9 042)	
Shoals Technologies Group Inc.	(1 144)	(23 725)	(23 442)	
Shyft Group Inc.	(60)	(942)	(967)	
SkyWest Inc.	(57)	(3 965)	(3 923)	
Standex International Corp.	(3)	(548)	(627)	
Sun Country Airlines Holdings Inc.	(136)	(2 682)	(2 821)	
Sunrun Inc.	(1 499)	(31 399)	(38 800)	
TaskUS Inc.	(121)	(2 085)	(2 085)	
Textron Inc.	(1)	(47)	(106)	
TPI Composites Inc.	(7)	(388)	(38)	
Transcat Inc.	(4)	(512)	(577)	
TransUnion	(516)	(44 989)	(46 750)	
TriNet Group Inc.	(263)	(30 661)	(41 244)	
Trinity Industries Inc.	(31)	(1 286)	(1 087)	
Verisk Analytics Inc.	(378)	(122 628)	(119 055)	
Viad Corp.	(14)	(355)	(668)	
Virgin Galactic Holdings Inc.	(939)	(4 103)	(3 034)	
VSE Corp.	(5)	(398)	(426)	
Wheels Up Experience Inc.	(187)	(709)	(846)	
Xometry Inc.	(195)	(3 461)	(9 233)	
		(789 819)	(825 586)	(6,16)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,64 %)				
1-800-Flowers.com Inc.	(34)	(396)	(483)	
Academy Sports & Outdoors Inc.	(77)	(6 642)	(6 701)	
America's Car-Mart Inc.	(87)	(9 139)	(8 692)	
AMMO Inc.	(1 238)	(9 694)	(3 428)	
AutoZone Inc.	(21)	(71 897)	(71 597)	
Bath & Body Works Inc.	(162)	(9 200)	(9 220)	
Caleres Inc.	(62)	(2 565)	(2 512)	
Camping World Holdings Inc.	(215)	(7 140)	(7 445)	
Carvana Co.	(396)	(19 413)	(27 643)	
Cavco Industries Inc.	(16)	(5 773)	(7 313)	
Children's Place Inc.	(65)	(1 812)	(1 990)	
Designer Brands Inc.	(446)	(5 652)	(5 205)	
Dorman Products Inc.	(5)	(558)	(550)	
Dutch Bros Inc.	(204)	(7 785)	(8 519)	
Escalade Inc.	(100)	(1 733)	(2 649)	
European Wax Center Inc.	(39)	(925)	(699)	
EVgo Inc.	(2 648)	(14 313)	(12 500)	
Five Below Inc.	(102)	(23 392)	(28 669)	
Flexsteel Industries Inc.	(13)	(442)	(323)	
Full House Resorts Inc.	(943)	(6 399)	(6 677)	
Funko Inc.	(194)	(4 389)	(1 977)	
GameStop Corp.	(3 244)	(70 369)	(74 985)	
Gentherm Inc.	(51)	(4 032)	(3 521)	
G-III Apparel Group Ltd.	(102)	(4 552)	(4 570)	
Goodyear Tire & Rubber Co.	(529)	(9 856)	(9 989)	
GrowGeneration Corp.	(375)	(13 215)	(1 241)	
Helen of Troy Ltd.	(6)	(868)	(956)	
Hyatt Hotels Corp.	(9)	(1 366)	(1 548)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kura Sushi USA Inc.	(10)	(858)	(1 002)	
La-Z-Boy Inc.	(28)	(1 121)	(1 363)	
Lazydays Holdings Inc.	(20)	(379)	(186)	
Leslie's Inc.	(986)	(7 295)	(8 984)	
Life Time Group Holdings Inc.	(505)	(11 708)	(10 042)	
Light & Wonder Inc.	(165)	(18 515)	(17 865)	
Lucid Group Inc.	(4 782)	(49 776)	(26 546)	
MercadoLibre Inc.	(60)	(129 777)	(124 334)	
Mister Car Wash Inc.	(415)	(4 037)	(4 728)	
Mohawk Industries Inc.	(125)	(15 858)	(17 059)	
NIKE Inc., cat. B	(6)	(960)	(859)	
ODP Corp.	(14)	(1 056)	(1 039)	
OneWater Marine Inc.	(148)	(5 362)	(6 594)	
O'Reilly Automotive Inc.	(69)	(87 964)	(86 442)	
Planet Fitness Inc.	(498)	(40 937)	(47 936)	
PulteGroup Inc.	(453)	(55 713)	(61 656)	
Ralph Lauren Corp.	(132)	(25 229)	(25 099)	
Red Rock Resorts Inc.	(169)	(10 570)	(11 884)	
Ross Stores Inc.	(276)	(46 134)	(50 365)	
Shoe Carnival Inc.	(41)	(1 110)	(1 633)	
Smith & Wesson Brands Inc.	(50)	(837)	(894)	
Solid Power Inc.	(1 975)	(7 436)	(3 776)	
Sonic Automotive Inc.	(57)	(3 946)	(4 225)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(175)	(915)	(983)	
Sweetgreen Inc.	(284)	(3 106)	(4 232)	
Target Hospitality Corp.	(100)	(1 697)	(1 283)	
Tempur Sealy International Inc.	(656)	(35 715)	(44 089)	
Tesla Inc.	(3)	(1 011)	(983)	
Under Armour Inc., cat. A	(44)	(653)	(510)	
Vista Outdoor Inc.	(52)	(1 949)	(2 028)	
Warby Parker Inc.	(374)	(6 744)	(6 954)	
WW International Inc.	(264)	(3 103)	(3 046)	
XPEL Inc.	(124)	(9 633)	(8 805)	
Zumiez Inc.	(54)	(1 194)	(1 448)	
		(905 815)	(900 474)	(6,72)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,24 %)				
Alico Inc.	(11)	(360)	(422)	
Beauty Health Co.	(489)	(1 832)	(2 005)	
BRC Inc.	(2 013)	(11 360)	(9 635)	
Calavo Growers Inc.	(141)	(6 653)	(5 468)	
Campbell Soup Co.	(20)	(1 135)	(1 140)	
Chefs' Warehouse Inc.	(43)	(1 465)	(1 669)	
Clorox Co.	(244)	(45 475)	(45 877)	
Dollar Tree Inc.	(411)	(64 527)	(76 983)	
Ingredion Inc.	(122)	(16 296)	(17 459)	
Kraft Heinz Co.	(409)	(20 056)	(19 944)	
Lamb Weston Holdings Inc.	(82)	(11 254)	(11 687)	
Limoneira Co.	(50)	(1 085)	(1 360)	
Mission Produce Inc.	(70)	(1 492)	(931)	
Veru Inc.	(112)	(620)	(106)	
		(183 610)	(194 686)	(1,45)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -2,18 %)				
10X Genomics Inc.	(220)	(12 529)	(16 234)	
2seventy bio Inc.	(969)	(13 628)	(5 456)	
89bio Inc.	(526)	(5 834)	(7 747)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Actinium Pharmaceuticals Inc.	(372)	(2 684)	(2 492)	
AdaptHealth Corp.	(477)	(8 727)	(4 585)	
Adaptive Biotechnologies Corp.	(65)	(487)	(420)	
ADMA Biologics Inc.	(29)	(63)	(173)	
Agenus Inc.	(2 166)	(4 226)	(2 365)	
Aldeyra Therapeutics Inc.	(152)	(467)	(704)	
Alector Inc.	(164)	(1 370)	(1 726)	
Allakos Inc.	(47)	(436)	(169)	
Allogene Therapeutics Inc.	(650)	(5 562)	(2 751)	
American Well Corp.	(998)	(1 908)	(1 961)	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	(884)	(55 128)	(69 775)	
Apollo Medical Holdings Inc.	(100)	(4 720)	(5 050)	
Arcus Biosciences Inc.	(287)	(7 109)	(7 228)	
Arcutis Biotherapeutics Inc.	(250)	(824)	(1 065)	
Ardelyx Inc.	(108)	(887)	(883)	
ARS Pharmaceuticals Inc.	(355)	(1 827)	(2 565)	
Arvinas Inc.	(24)	(763)	(1 303)	
Asensus Surgical Inc.	(956)	(1 491)	(402)	
Avidity Biosciences Inc.	(39)	(760)	(465)	
Azenta Inc.	(18)	(1 344)	(1 546)	
Beam Therapeutics Inc.	(954)	(40 664)	(34 241)	
BioLife Solutions Inc.	(243)	(6 030)	(5 207)	
Bionano Genomics Inc.	(1)	(2)	(2)	
Bio-Techne Corp.	(176)	(18 133)	(17 907)	
Bluebird Bio Inc.	(1 342)	(9 582)	(2 442)	
Bridgebio Pharma Inc.	(1 062)	(34 740)	(56 532)	
Butterfly Network Inc.	(234)	(872)	(333)	
Caribou Biosciences Inc.	(1 400)	(10 838)	(10 578)	
Catalent Inc.	(151)	(8 790)	(8 946)	
Catalyst Pharmaceuticals Inc.	(334)	(6 085)	(7 403)	
Certara Inc.	(1 231)	(38 059)	(28 552)	
Citius Pharmaceuticals Inc.	(1 250)	(1 315)	(1 247)	
Coherus Biosciences Inc.	(1 195)	(10 189)	(5 247)	
CorMedix Inc.	(287)	(1 437)	(1 423)	
CorVel Corp.	(2)	(647)	(652)	
CVS Health Corp.	(1 213)	(117 232)	(126 294)	
Denali Therapeutics Inc.	(464)	(14 647)	(13 130)	
DocGo Inc.	(1 878)	(21 729)	(13 843)	
Doximity Inc.	(872)	(29 030)	(32 241)	
Eagle Pharmaceuticals Inc.	(1)	(39)	(7)	
Enanta Pharmaceuticals Inc.	(6)	(389)	(74)	
Enhabit Inc.	(347)	(5 633)	(4 736)	
Enzo Biochem Inc.	(1 686)	(5 341)	(3 090)	
Evolent Health Inc.	(265)	(10 318)	(11 542)	
Fate Therapeutics Inc.	(260)	(833)	(1 282)	
Geron Corp.	(2 208)	(7 585)	(6 143)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(20 196)	(44 612)	(45 005)	
Harrow Inc.	(700)	(8 262)	(10 338)	
Humacyte Inc.	(256)	(1 346)	(959)	
IGM Biosciences Inc.	(164)	(1 948)	(1 797)	
ImmunityBio Inc.	(214)	(570)	(1 417)	
Inhibrx Inc.	(68)	(2 001)	(3 407)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(963)	(1 940)	(648)	
Inozyme Pharma Inc.	(148)	(964)	(831)	
Invitae Corp.	(1 722)	(17 385)	(1 423)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Iovance Biotherapeutics Inc.	(1 210)	(11 015)	(12 971)	
iTeos Therapeutics Inc.	(36)	(806)	(520)	
Keros Therapeutics Inc.	(100)	(5 778)	(5 243)	
Kymera Therapeutics Inc.	(455)	(14 183)	(15 275)	
MiNK Therapeutics Inc.	(8)	(23)	(11)	
Moderna Inc.	(693)	(95 624)	(90 876)	
ModivCare Inc.	(53)	(2 882)	(3 074)	
Neogen Corp.	(1 218)	(30 068)	(32 298)	
NeoGenomics Inc.	(62)	(1 278)	(1 323)	
Ocugen Inc.	(2 255)	(2 204)	(1 710)	
Ocular Therapeutix Inc.	(1 736)	(5 900)	(10 209)	
Omeros Corp.	(91)	(346)	(392)	
Optinose Inc.	(156)	(368)	(265)	
Outset Medical Inc.	(53)	(374)	(378)	
Owens & Minor Inc.	(164)	(4 503)	(4 167)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(1 136)	(15 770)	(14 695)	
Privia Health Group Inc.	(35)	(1 022)	(1 063)	
PROCEPT BioRobotics Corp.	(23)	(1 076)	(1 271)	
ProPhase Labs Inc.	(60)	(627)	(358)	
Quantum-Si Inc.	(922)	(3 739)	(2 444)	
Recursion Pharmaceuticals Inc.	(4 049)	(38 548)	(52 643)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(10)	(43)	(19)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(84)	(2 273)	(3 320)	
Sage Therapeutics Inc.	(427)	(11 761)	(12 201)	
Sana Biotechnology Inc.	(175)	(783)	(941)	
Scholar Rock Holding Corp.	(24)	(375)	(595)	
Schrodinger Inc.	(138)	(7 074)	(6 514)	
Senseonics Holdings Inc.	(953)	(1 418)	(716)	
Seres Therapeutics Inc.	(385)	(2 585)	(711)	
Simulations Plus Inc.	(6)	(412)	(354)	
Sotera Health Co.	(573)	(11 357)	(12 731)	
SpringWorks Therapeutics Inc.	(98)	(3 825)	(4 717)	
Standard BioTools Inc.	(345)	(807)	(1 005)	
Stereotaxis Inc.	(52)	(429)	(120)	
Syndax Pharmaceuticals Inc.	(34)	(914)	(969)	
Twist Bioscience Corp.	(552)	(13 061)	(26 829)	
UFP Technologies Inc.	(47)	(9 889)	(10 662)	
Vera Therapeutics Inc.	(109)	(1 807)	(2 211)	
Verve Therapeutics Inc.	(586)	(11 073)	(10 771)	
Viatrix Inc.	(453)	(6 426)	(6 469)	
Vir Biotechnology Inc.	(840)	(27 212)	(11 143)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(1 392)	(3 040)	(1 539)	
Zentalis Pharmaceuticals Inc.	(121)	(4 548)	(2 417)	
		(969 207)	(964 124)	(7,20)
Services financiers (31 décembre 2022 : -0,74 %)				
American Express Co.	(147)	(36 103)	(36 313)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(362)	(8 074)	(9 222)	
Bank of Hawaii Corp.	(304)	(20 458)	(29 046)	
BayCom Corp.	(33)	(822)	(1 026)	
Brighthouse Financial Inc.	(552)	(32 036)	(38 519)	
Capital One Financial Corp.	(29)	(4 813)	(5 014)	
Central Valley Community Bancorp	(50)	(1 137)	(1 474)	
Citizens & Northern Corp.	(31)	(1 004)	(917)	
Coastal Financial Corp.	(95)	(5 598)	(5 563)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Discover Financial Services	(527)	(75 813)	(78 107)	
Federal Agricultural Mortgage Corp., cat. C	(2)	(355)	(504)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(3 826)	
Fidelity National Information Services Inc.	(261)	(20 790)	(20 673)	
First Bancorp/Southern Pines NC	(139)	(6 077)	(6 783)	
First Commonwealth Financial Corp.	(75)	(1 234)	(1 527)	
First Financial Northwest Inc.	(100)	(1 827)	(1 777)	
First Foundation Inc.	(235)	(2 459)	(3 000)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(100)	(2 954)	(1 466)	
FleetCor Technologies Inc.	(208)	(76 353)	(77 511)	
Flushing Financial Corp.	(36)	(727)	(782)	
FVCBankcorp Inc.	(17)	(370)	(318)	
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc.	(1 048)	(25 555)	(38 113)	
HarborOne Bancorp Inc.	(422)	(5 405)	(6 666)	
Hingham Institution For Savings The	(69)	(21 749)	(17 687)	
International Money Express Inc.	(50)	(1 229)	(1 456)	
Lakeland Financial Corp.	(6)	(616)	(516)	
Live Oak Bancshares Inc.	(365)	(13 122)	(21 899)	
Mastercard Inc.	(12)	(6 747)	(6 749)	
Metrocity Bankshares Inc.	(167)	(4 031)	(5 289)	
Metropolitan Bank Holding Corp.	(32)	(1 641)	(2 337)	
NBT Bancorp Inc.	(99)	(5 441)	(5 471)	
New York Mortgage Trust Inc.	(51)	(634)	(574)	
Ocwen Financial Corp.	(18)	(678)	(730)	
Open Lending Corp.	(188)	(2 011)	(2 110)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(566)	(18 518)	(21 726)	
Park National Corp.	(53)	(9 755)	(9 285)	
Peapack-Gladstone Financial Corp.	(117)	(4 084)	(4 601)	
PennyMac Financial Services Inc.	(237)	(18 963)	(27 616)	
Piper Sandler Cos	(84)	(15 607)	(19 369)	
PRA Group Inc.	(16)	(357)	(553)	
RBB Bancorp	(94)	(1 525)	(2 360)	
Republic Bancorp Inc.	(7)	(423)	(509)	
Riverview Bancorp Inc.	(310)	(2 586)	(2 616)	
RLI Corp.	(15)	(2 608)	(2 633)	
Seacoast Banking Corp. of Florida	(325)	(10 265)	(12 196)	
ServisFirst Bancshares Inc.	(211)	(15 785)	(18 538)	
Southern First Bancshares Inc.	(82)	(4 216)	(4 011)	
StepStone Group Inc.	(32)	(1 057)	(1 343)	
Synchrony Financial	(210)	(10 375)	(10 575)	
Texas Capital Bancshares Inc.	(5)	(346)	(426)	
Triumph Financial Inc.	(128)	(11 734)	(13 533)	
Two Harbors Investment Corp.	(151)	(2 089)	(2 774)	
Valley National Bancorp	(672)	(8 333)	(9 623)	
WaFd Inc.	(143)	(5 893)	(6 215)	
Walker & Dunlop Inc.	(111)	(13 032)	(16 248)	
Western Alliance Bancorp	(788)	(39 343)	(68 360)	
World Acceptance Corp.	(2)	(296)	(344)	
		(588 165)	(688 419)	(5,14)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -3,11 %)				
ACM Research Inc.	(362)	(7 149)	(9 327)	
Adobe Inc.	(157)	(118 197)	(123 508)	
ADTRAN Holdings Inc.	(667)	(6 251)	(6 456)	
Aehr Test Systems	(61)	(3 881)	(2 134)	
Aeva Technologies Inc.	(38)	(369)	(38)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Amkor Technology Inc.	(80)	(2 753)	(3 510)	
ANSYS Inc.	(75)	(35 720)	(35 887)	
AppLovin Corp.	(74)	(3 971)	(3 888)	
Arista Networks Inc.	(220)	(66 853)	(68 320)	
Broadcom Inc.	(87)	(125 572)	(128 054)	
Clearfield Inc.	(366)	(20 787)	(14 034)	
Cognizant Technology Solutions Corp.	(259)	(24 898)	(25 795)	
CTS Corp.	(21)	(959)	(1 211)	
Digi International Inc.	(52)	(2 269)	(1 783)	
Digimarc Corp.	(40)	(1 171)	(1 905)	
Digital Turbine Inc.	(658)	(34 367)	(5 952)	
Diodes Inc.	(8)	(864)	(849)	
E2open Parent Holdings Inc.	(249)	(1 195)	(1 441)	
Enfusion Inc.	(35)	(378)	(448)	
Enphase Energy Inc.	(183)	(34 916)	(31 886)	
Fair Isaac Corp.	(22)	(22 074)	(33 767)	
First Solar Inc.	(175)	(34 953)	(39 754)	
Five9 Inc.	(136)	(12 234)	(14 111)	
Genasys Inc.	(100)	(456)	(268)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(171)	(3 537)	(3 006)	
Hut 8 Corp.	(2 720)	(43 857)	(48 090)	
Impinj Inc.	(83)	(6 549)	(9 853)	
IonQ Inc.	(732)	(7 794)	(11 949)	
IPG Photonics Corp.	(67)	(11 130)	(9 589)	
Jabil Inc.	(196)	(34 472)	(32 926)	
Lam Research Corp.	(10)	(10 341)	(10 328)	
Luna Innovations Inc.	(218)	(1 731)	(1 912)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(21)	(2 176)	(2 574)	
MicroStrategy Inc.	(89)	(45 579)	(74 124)	
MicroVision Inc.	(933)	(3 240)	(3 272)	
MKS Instruments Inc.	(55)	(6 818)	(7 460)	
MongoDB Inc.	(34)	(17 907)	(18 330)	
Monolithic Power Systems Inc.	(154)	(102 754)	(128 089)	
Napco Security Technologies Inc.	(17)	(569)	(768)	
Navitas Semiconductor Corp.	(2 936)	(28 687)	(31 242)	
Palantir Technologies Inc.	(3 449)	(77 196)	(78 087)	
PAR Technology Corp.	(39)	(2 323)	(2 239)	
RackSpace Technology Inc.	(242)	(693)	(638)	
Rambus Inc.	(185)	(15 223)	(16 649)	
Samsara Inc.	(418)	(13 998)	(18 398)	
SiTime Corp.	(53)	(9 570)	(8 532)	
Skyworks Solutions Inc.	(877)	(120 604)	(130 004)	
SolarEdge Technologies Inc.	(12)	(3 121)	(1 481)	
SoundHound AI Inc.	(638)	(1 875)	(1 783)	
TTM Technologies Inc.	(161)	(3 177)	(3 356)	
Tyler Technologies Inc.	(12)	(6 632)	(6 616)	
Ubiquiti Inc.	(9)	(1 549)	(1 656)	
Universal Display Corp.	(38)	(8 177)	(9 583)	
Veritone Inc.	(1 339)	(5 394)	(3 196)	
Viasat Inc.	(512)	(22 149)	(18 870)	
Viavi Solutions Inc.	(218)	(2 842)	(2 895)	
Zebra Technologies Corp.	(124)	(45 845)	(44 691)	
		(1 229 746)	(1 296 512)	(9,68)
Services de communication (31 décembre 2022 : -0,72 %)				
Anterix Inc.	(128)	(5 452)	(5 624)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
ATN International Inc.	(100)	(5 525)	(5 139)	
Cable One Inc.	(3)	(2 796)	(2 202)	
Cardlytics Inc.	(13)	(491)	(158)	
Cinemark Holdings Inc.	(572)	(12 679)	(10 627)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(1 151)	(3 754)	(2 762)	
Cogent Communications Holdings Inc.	(10)	(900)	(1 003)	
Daily Journal Corp.	(1)	(479)	(449)	
Entravision Communications Corp.	(152)	(917)	(836)	
EW Scripps Co.	(371)	(4 333)	(3 909)	
FuboTV Inc.	(1 575)	(4 495)	(6 604)	
Globalstar Inc.	(2 428)	(4 100)	(6 211)	
Gogo Inc.	(56)	(953)	(748)	
IAC Inc.	(40)	(2 977)	(2 763)	
Madison Square Garden Entertainment Corp.	(6)	(267)	(252)	
Magnite Inc.	(333)	(4 466)	(4 101)	
Match Group Inc.	(400)	(18 769)	(19 252)	
Omnicom Group Inc.	(385)	(41 964)	(43 918)	
PubMatic Inc.	(1 162)	(22 201)	(24 990)	
QuinStreet Inc.	(37)	(578)	(625)	
Shenandoah Telecommunications Co.	(175)	(4 543)	(4 989)	
Sphere Entertainment Co.	(301)	(14 720)	(13 479)	
Stagwell Inc.	(65)	(501)	(568)	
TechTarget Inc.	(11)	(971)	(506)	
Trade Desk Inc.	(148)	(15 400)	(14 043)	
Warner Bros Discovery Inc.	(330)	(4 967)	(4 952)	
WideOpenWest Inc.	(26)	(364)	(139)	
ZipRecruiter Inc.	(234)	(5 029)	(4 289)	
		(184 591)	(185 138)	(1,38)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,87 %)				
Atmos Energy Corp.	(24)	(3 717)	(3 668)	
Cadiz Inc.	(463)	(1 991)	(1 709)	
California Water Service Group	(4)	(330)	(274)	
Chesapeake Utilities Corp.	(7)	(875)	(975)	
Clearway Energy Inc., cat. C	(84)	(2 565)	(3 038)	
Middlesex Water Co.	(3)	(301)	(260)	
New Jersey Resources Corp.	(36)	(2 105)	(2 116)	
NextEra Energy Inc.	(870)	(62 982)	(69 680)	
NextEra Energy Partners LP	(820)	(28 199)	(32 881)	
Spruce Power Holding Corp.	(221)	(11 120)	(1 288)	
		(114 185)	(115 889)	(0,87)
Immobilier (31 décembre 2022 : -0,67 %)				
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(122)	(19 275)	(20 393)	
American Tower Corp.	(22)	(5 884)	(6 263)	
Apartment Investment and Management Co.	(3 383)	(32 432)	(34 928)	
Armada Hoffer Properties Inc.	(286)	(4 838)	(4 665)	
Boston Properties Inc.	(15)	(1 291)	(1 388)	
CBRE Group Inc.	(47)	(5 489)	(5 769)	
Community Healthcare Trust Inc.	(44)	(2 114)	(1 546)	
Compass Inc.	(277)	(1 197)	(1 373)	
COPT Defense Properties	(15)	(524)	(507)	
Crown Castle Inc.	(235)	(36 352)	(35 694)	
Empire State Realty Trust Inc.	(450)	(5 025)	(5 750)	
Essex Property Trust Inc.	(10)	(3 174)	(3 269)	
eXp World Holdings Inc.	(1 391)	(33 332)	(28 466)	
Farmland Partners Inc.	(100)	(1 744)	(1 646)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
FRP Holdings Inc.	(11)	(808)	(912)	
Gladstone Commercial Corp.	(46)	(761)	(803)	
Gladstone Land Corp.	(240)	(5 059)	(4 573)	
Howard Hughes Holdings Inc.	(151)	(15 644)	(17 034)	
Hudson Pacific Properties Inc.	(66)	(784)	(810)	
Jones Lang LaSalle Inc.	(150)	(29 202)	(37 357)	
Kilroy Realty Corp.	(34)	(1 708)	(1 786)	
Macerich Co.	(41)	(881)	(834)	
Marcus & Millichap Inc.	(308)	(14 449)	(17 740)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(100)	(1 478)	(2 095)	
Newmark Group Inc.	(1 361)	(14 297)	(19 669)	
Opendoor Technologies Inc.	(1 194)	(3 079)	(7 053)	
Park Hotels & Resorts Inc.	(802)	(14 230)	(16 180)	
Prologis Inc.	(91)	(16 189)	(15 995)	
Retail Opportunity Investments Corp.	(478)	(9 423)	(8 843)	
RLJ Lodging Trust	(1 149)	(15 117)	(17 757)	
SBA Communications Corp.	(38)	(11 424)	(12 712)	
Seritage Growth Properties	(42)	(423)	(518)	
SL Green Realty Corp.	(1 225)	(49 442)	(72 962)	
St Joe Co.	(100)	(5 609)	(7 935)	
Stratus Properties Inc.	(100)	(3 858)	(3 805)	
Tejon Ranch Co.	(100)	(1 964)	(2 268)	
Veris Residential Inc.	(165)	(3 207)	(3 422)	
Vornado Realty Trust	(840)	(24 845)	(31 290)	
		(396 552)	(456 010)	(3,40)
Total des actions américaines – position vendeur		(6 103 075)	(6 343 029)	(47,35)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2022 : 1,50 %)				
Aker Solutions ASA	2 695	7 751	14 703	
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	24 000	1 766	1 641	
Avance Gas Holding Ltd.	531	10 293	10 314	
Borr Drilling Ltd.	247	1 701	2 433	
Boss Energy Ltd.	369	1 437	1 338	
BP Castrol KK	100	927	813	
BW Energy Ltd.	139	511	487	
BW LPG Ltd.	3 146	42 008	61 802	
BW Offshore Ltd.	256	1 057	745	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	21 739	27 703	26 316	
China Aviation Oil Singapore Corp. Ltd.	6 400	5 723	5 598	
Dorian LPG Ltd.	21	405	1 215	
Dyna-Mac Holdings Ltd.	21 500	8 248	7 200	
E1 Corp.	111	6 359	7 080	
FLEX LNG Ltd.	204	5 168	7 904	
Frontline PLC, NYSE	3 187	68 435	84 258	
Frontline PLC, OSL	446	9 201	11 750	
Hafnia Ltd.	267	1 860	2 434	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	6 000	35 038	43 071	
Ithaca Energy PLC	377	1 446	914	
Magnora ASA	4 282	18 671	18 347	
MMA Offshore Ltd.	13 383	13 373	22 517	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription	26	–	360	
Nordic American Tankers Ltd.	1 291	4 367	7 150	
Odfjell Drilling Ltd.	920	4 276	4 706	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Oil Refineries Ltd.	34 476	14 519	15 427	
Saipem SpA	734	1 355	1 572	
Saras SpA	2 663	4 668	6 268	
Semirara Mining & Power Corp.	30 900	25 456	22 258	
SFL Corp. Ltd.	434	4 202	6 455	
Soechi Lines Tbk PT	199 100	3 232	3 120	
Subsea 7 SA	1 011	16 494	19 454	
Teekay Corp.	130	551	1 226	
TORM PLC	169	7 846	6 743	
United Tractors Tbk PT	5 600	13 011	10 851	
Viva Energy Group Ltd.	125	358	393	
Whitehaven Coal Ltd.	12 677	81 543	84 862	
Yancoal Australia Ltd.	4 042	18 174	18 002	
		469 133	541 727	4,04
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,29 %)				
Air Water Inc.	700	12 816	12 613	
Akcansa Cimento AS	140	904	889	
ASIA Holdings Co., Ltd.	19	3 169	3 638	
Asia Pile Holdings Corp.	100	587	658	
Base Resources Ltd.	6 051	1 096	844	
Bellevue Gold Ltd.	250	379	377	
Borregaard ASA	299	6 484	6 654	
Broadmedia Corp.	400	5 658	5 163	
Carlit Holdings Co., Ltd.	300	2 116	2 607	
Cementir Holding NV	1 261	15 207	17 523	
China BlueChemical Ltd.	4 000	1 406	1 331	
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	1 000	706	866	
CK-San-Etsu Co., Ltd.	100	4 356	3 587	
Daehan Steel Co., Ltd.	418	5 716	5 529	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	700	5 687	6 678	
Daiichi Kigenso Kagaku-Kogyo Co., Ltd.	200	1 726	1 848	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	100	1 844	2 363	
Dongil Industries Co., Ltd.	7	432	338	
Dongkuk Holdings Co., Ltd.	23	428	207	
DRDGOLD Ltd.	3 996	49 741	41 890	
Elopak ASA	788	2 616	3 075	
Emerald Resources NL	1 169	2 865	3 166	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	1 200	5 293	4 804	
Godo Steel Ltd.	400	15 002	17 247	
Gold Road Resources Ltd.	1 333	2 166	2 357	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	200	5 045	5 808	
H+H International A/S	7	355	121	
Hakudo Co., Ltd.	500	10 895	10 882	
Harima Chemicals Group Inc.	400	3 696	3 045	
Hokkan Holdings Ltd.	400	5 358	6 083	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	100	885	1 005	
Ishihara Chemical Co., Ltd.	300	4 606	5 163	
ISU Chemical Co., Ltd.	28	508	392	
Japan Pure Chemical Co., Ltd.	300	7 302	6 821	
Jaya Tiasa Holdings BHD	44 200	8 437	11 542	
JCU Corp.	100	3 169	3 723	
JSP Corp.	200	3 212	3 427	
Jupiter Mines Ltd.	4 480	952	665	
Kalekim Kimyevi Maddeler Sanayi ve Ticaret AS	4 080	3 761	3 916	
Katakura & Co-op Agri Corp.	200	2 333	1 974	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
KISCO Corp.	651	4 251	4 386	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	300	2 073	2 489	
Koza Anadolu Metal Madencilik Isletmeleri AS	3 105	6 120	5 881	
Kumkang Kind Co., Ltd.	1 828	13 385	10 631	
Kurimoto Ltd.	400	8 285	11 486	
Kuriyama Holdings Corp.	100	877	843	
Kyowa Leather Cloth Co., Ltd.	200	975	1 343	
Lion Chemtech Co., Ltd.	437	2 159	1 503	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	431	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	200	705	1 034	
Moriroku Holdings Co., Ltd.	100	1 906	2 602	
Neturen Co., Ltd.	1 600	15 000	14 396	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	100	1 021	1 064	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	200	2 479	2 677	
Noroo Holdings Co., Ltd.	195	2 087	2 288	
Northern Star Resources Ltd.	1 298	14 396	15 942	
Ora Banda Mining Ltd.	3 415	387	737	
Oyak Cimento Fabrikalari AS	4 225	11 098	10 460	
Perenti Ltd.	7 775	8 172	7 275	
Poongsan Corp.	312	13 479	12 522	
POSCO Holdings Inc., SEO	13	7 111	6 648	
POSCO Steeleon Co., Ltd.	15	1 033	869	
Ramelius Resources Ltd.	12 233	17 807	18 546	
Rasa Industries Ltd.	200	4 185	3 938	
Regis Resources Ltd.	2 361	3 855	4 631	
Resolute Mining Ltd.	6 908	2 463	2 766	
SAMHWA Paints Industrial Co., Ltd.	80	535	544	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	300	12 499	11 883	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	400	1 680	1 818	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	400	5 542	6 716	
Silver Lake Resources Ltd.	2 204	1 993	2 360	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	312 000	68 371	59 535	
St Barbara Ltd.	829	493	157	
Stanmore Resources Ltd.	1 946	6 059	7 021	
Tayca Corp.	100	1 182	1 280	
Ten Sixty Four Ltd.	1 777	1 048	456	
Toho Zinc Co., Ltd.	200	3 177	2 108	
Tokuyama Corp.	300	6 305	6 709	
Tokyo Rope Manufacturing Co., Ltd.	600	6 175	7 492	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	800	12 413	12 937	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	100	1 878	3 858	
Topy Industries Ltd.	800	15 451	19 118	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	2 500	587	431	
VT Co., Ltd.	189	3 364	3 158	
West African Resources Ltd.	3 556	3 145	3 024	
Westgold Resources Ltd.	7 158	11 550	14 040	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	300	2 873	4 602	
		520 897	527 454	3,94
Industries (31 décembre 2022 : 1,36 %)				
Advan Group Co., Ltd.	500	4 626	5 013	
AG Anadolu Grubu Holding AS	122	1 132	1 094	
Aichi Corp.	900	7 927	9 167	
Alinco Inc.	200	2 039	1 874	
Alps Logistics Co., Ltd.	100	1 284	1 554	
Anest Iwata Corp.	200	2 017	2 075	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Austal Ltd.	12 164	19 045	22 217	
Bet Shemesh Engines Holdings 1997 Ltd.	129	4 988	5 423	
Binjiang Service Group Co., Ltd.	500	1 904	1 393	
Blue Bird Tbk PT	49 000	9 162	7 511	
Boustead Singapore Ltd.	8 300	7 177	7 135	
Bunka Shutter Co., Ltd.	700	7 512	9 179	
Cargotec Oyj	82	5 127	6 295	
Cembre SpA	259	11 797	14 034	
Central Glass Co., Ltd.	400	10 796	9 970	
Central Security Patrols Co., Ltd.	100	2 814	2 383	
Chilled & Frozen Logistics Holdings Co., Ltd.	100	1 138	1 353	
China Lesso Group Holdings Ltd.	1 000	731	689	
Cimpress PLC	34	2 013	3 589	
CITIC Resources Holdings Ltd.	6 000	462	355	
Corp America Airports SA	1 872	20 113	39 643	
Cosel Co., Ltd.	400	4 553	5 144	
Daewoo Engineering & Construction Co., Ltd.	77	355	327	
Dai-Dan Co., Ltd.	500	6 707	6 664	
Daisue Construction Co., Ltd.	700	8 750	8 871	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	100	2 779	3 161	
Denyo Co., Ltd.	300	5 253	6 510	
DY POWER Corp.	122	2 141	1 540	
E-Commodities Holdings Ltd.	6 000	1 423	1 570	
El Al Israel Airlines	944	1 326	1 168	
Emeco Holdings Ltd.	11 394	6 754	6 869	
Endo Lighting Corp.	100	831	1 123	
Eurogroup Laminations SpA	3	24	17	
Ferreycorp SAA	2 153	1 809	1 902	
FNM SpA	1 461	1 017	962	
Frencken Group Ltd.	24 900	22 365	33 602	
FSE Lifestyle Services Ltd.	991	648	951	
Fudo Tetra Corp.	100	1 658	2 115	
Fuji Die Co., Ltd.	500	4 006	3 101	
Furukawa Electric Co., Ltd.	300	6 985	6 221	
Gecoss Corp.	2 100	17 693	20 800	
Hirakawa Hewtech Corp.	200	2 970	2 475	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	500	4 153	4 779	
Hyosung Heavy Industries Corp.	10	1 771	1 658	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	300	3 748	4 388	
Imura & Co., Ltd.	200	2 108	2 312	
Inwido AB	8	72	142	
Itoki Corp.	900	10 630	11 339	
Iwaki Co., Ltd.	200	2 580	3 885	
Japan Pulp & Paper Co., Ltd.	300	13 828	13 974	
Japan Transcity Corp.	400	2 050	2 297	
JK Holdings Co., Ltd.	800	7 613	7 759	
Kanaden Corp.	300	3 691	4 363	
Kanamoto Co., Ltd.	200	4 878	5 473	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	200	7 784	12 215	
Keihin Co., Ltd.	200	3 270	3 279	
Keppel Ltd.	5 700	38 896	40 284	
Kimura Unity Co., Ltd.	200	2 331	2 505	
Kinki Sharyo Co., Ltd.	200	3 830	3 270	
Kitano Construction Corp.	100	2 764	2 965	
Kitz Corp.	500	4 678	5 640	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
KOC Holding AS	237	1 493	1 500	
Kokuyo Co., Ltd.	100	2 173	2 146	
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	200	4 935	5 376	
Komori Corp.	100	1 003	1 067	
Kondotec Inc.	300	3 189	3 246	
Konecranes Oyj	764	34 124	45 382	
Kongsberg Gruppen ASA	660	37 160	39 882	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	1 000	7 593	6 388	
KRS Corp.	500	4 415	4 228	
Kyodo Printing Co., Ltd.	200	5 613	6 042	
LS Electric Co., Ltd.	33	3 357	2 473	
Luxfer Holdings PLC	278	5 779	3 277	
Mader Group Ltd.	636	4 255	3 920	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	900	9 396	11 154	
Matsui Construction Co., Ltd.	500	2 937	3 919	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	300	3 441	3 926	
Mie Kotsu Group Holdings Inc.	1 700	9 582	9 588	
Mirai Industry Co., Ltd.	300	6 426	9 147	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	3 000	9 181	9 428	
Monadelphous Group Ltd.	9	103	120	
MPC Container Ships ASA	27 097	61 837	46 880	
Munters Group AB	352	3 996	7 530	
Nakabayashi Co., Ltd.	200	974	1 029	
Nakano Corp.	600	2 421	2 643	
Nanyo Corp.	200	4 125	3 994	
Nice Corp.	600	8 097	9 546	
Nichiden Corp.	300	5 992	8 056	
Nichireki Co., Ltd.	200	3 097	4 519	
Nikkiso Co., Ltd.	2 000	18 751	19 267	
Nilfisk Holding A/S	251	6 724	5 797	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 527	
Nippon Sharyo Ltd.	600	11 769	11 544	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	100	679	537	
Nitto Kogyo Corp.	1 000	26 838	33 671	
Nitto Seiko Co., Ltd.	300	1 752	1 476	
Nitto Construction Co., Ltd.	400	3 993	3 969	
NKT A/S	690	44 878	62 531	
Nordex SE	25	318	379	
NRW Holdings Ltd.	260	573	697	
Ochi Holdings Co., Ltd.	1 500	18 579	20 427	
Odawara Engineering Co., Ltd.	200	3 655	3 775	
Okabe Co., Ltd.	1 000	7 272	6 846	
Oriental Shiraishi Corp.	2 800	8 432	8 904	
Pegasus Hava Tasimaciligi AS	16	525	464	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	317	18 885	19 976	
Perak Transit Bhd	1 100	361	360	
Persol Holdings Co., Ltd.	1 500	3 239	3 397	
Port of Tauranga Ltd.	1 155	5 351	5 400	
Pronexus Inc.	500	5 092	6 159	
Prysmian SpA	36	1 888	2 159	
Quick Co., Ltd.	100	1 825	2 411	
Raito Kogyo Co., Ltd.	200	3 507	3 535	
Rejlers AB	161	3 453	2 581	
Sakai Heavy Industries Ltd.	100	4 736	5 603	
Salcef Group SpA	110	3 488	3 950	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Sammok S-Form Co., Ltd.	278	4 276	4 750	
Samsung Heavy Industries Co., Ltd.	1 087	9 588	8 625	
Sanix Inc.	800	2 614	2 357	
Sanko Gosei Ltd.	400	2 382	1 848	
Sanko Metal Industrial Co., Ltd.	200	7 936	8 465	
Sankyo Tateyama Inc.	200	1 352	1 465	
Sansei Technologies Inc.	500	6 091	5 383	
Sansha Electric Manufacturing Co.	100	1 063	1 238	
Sanyo Denki Co., Ltd.	100	6 924	5 864	
Sanyo Trading Co., Ltd.	800	10 610	8 949	
Sato Holdings Cor	200	3 877	3 958	
Sato Shoji Corp.	300	4 104	4 088	
Seika Corp.	500	9 358	13 805	
Seiko Electric Co., Ltd.	800	7 686	8 246	
Sensata Technologies Holding PLC	22	1 365	1 090	
Shikun & Binui Ltd.	6	28	22	
Shimojima Co., Ltd.	700	7 183	8 433	
Shin Nippon Air Technologies Co., Ltd.	200	4 106	4 461	
Shinwa Co., Ltd.	100	2 952	2 210	
SIA Engineering Co., Ltd.	1 400	3 257	3 317	
Sinfonia Technology Co., Ltd.	300	4 696	5 845	
Singapore Airlines Ltd.	14 900	88 483	97 707	
Skellerup Holdings Ltd.	489	1 878	2 058	
SmartGroup Corp. Ltd.	221	1 626	1 734	
SNT Dynamics Co., Ltd.	1 400	14 017	20 641	
Solar A/S	3	378	273	
Space Co., Ltd.	500	4 949	4 359	
SRG Global Ltd.	5 172	3 246	3 118	
Stolt-Nielsen Ltd.	88	2 951	3 559	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 960	4 177	
Sumiseki Holdings Inc.	100	947	1 024	
Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	200	4 888	5 129	
SWCC Corp.	600	10 349	16 044	
Systemair AB	160	798	1 648	
Taikisha Ltd.	200	7 348	7 641	
Takamiya Co., Ltd.	200	881	926	
Takaoka Toko Co., Ltd.	500	9 868	9 872	
Takashima & Co., Ltd.	1 200	10 123	13 132	
Technoflex Corp.	400	4 250	4 074	
Tekken Corp.	100	1 865	1 877	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	8 000	748	628	
Tobishima Corp.	200	2 166	2 451	
Tokyo Energy & Systems Inc.	100	919	978	
Toli Corp.	1 500	4 682	4 475	
Tomoe Corp.	100	443	542	
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	300	4 759	6 330	
Tourism Holdings Ltd., NZE	1 099	3 274	3 532	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 472	
Toyo Machinery & Metal Co., Ltd.	1 000	6 128	6 416	
Trusco Nakayama Corp.	500	10 958	11 439	
Tsubakimoto Kogyo Co., Ltd.	100	4 852	6 014	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	100	1 104	1 256	
Tsurumi Manufacturing Co., Ltd.	300	6 558	10 424	
Turk Hava Yollari AO	5 650	63 555	57 665	
Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	132	4 358	4 196	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de	1 400	5 036	7 791	
Ventia Services Group Pty Ltd.	6 298	14 359	17 793	
Vitzrocell Co., Ltd.	315	7 548	5 250	
Wakita & Co., Ltd.	2 300	28 797	34 419	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 588	11 301	18 350	
WDB Holdings Co., Ltd.	100	2 102	2 070	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	201	7 995	9 513	
Will Group Inc.	200	2 697	2 162	
YAMABIKO Corp.	600	8 162	8 395	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	200	3 044	3 201	
Yamaura Corp.	600	6 793	7 902	
Yasuda Logistics Corp.	100	973	1 097	
Yokogawa Bridge Holdings Corp.	300	7 738	7 119	
Young Poong Precision Corp.	464	6 341	6 048	
Yuasa Trading Co., Ltd.	600	23 455	26 600	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	500	3 297	3 119	
		1 330 081	1 475 373	11,01
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 1,02 %)				
Aisan Industry Co., Ltd.	200	1 898	2 202	
Akebono Brake Industry Co., Ltd.	2 500	3 332	2 619	
Alpha Corp.	400	4 456	5 126	
Amiyaki Tei Co., Ltd.	100	3 233	3 578	
Arcos Dorados Holdings Inc.	733	6 333	12 265	
Articore Group Ltd.	1 164	457	723	
Ashimori Industry Co., Ltd.	100	1 770	1 884	
Astra Otoparts Tbk PT	7 500	1 172	1 516	
Aucnet Inc.	1 900	30 033	32 450	
Avantia Co., Ltd.	600	4 687	4 938	
Baroque Japan Ltd.	400	3 162	3 075	
Benesse Holdings Inc.	1 000	16 652	24 384	
Bermaz Auto Bhd	22 700	14 813	15 373	
Bijou Brigitte AG	100	6 521	5 841	
Bloomerry Resorts Corp.	2 400	358	562	
Bookoff Group Holdings Ltd.	1 200	15 286	12 795	
Bronco Billy Co., Ltd.	300	7 691	8 937	
Brunello Cucinelli SpA	4	465	516	
Café de Coral Holdings Ltd.	2 000	3 577	3 043	
Capri Holdings Ltd.	421	25 819	27 890	
Central Automotive Products Ltd.	200	5 434	7 791	
Cettire Ltd.	2 981	6 877	7 778	
China Harmony Auto Holding Ltd.	2 000	333	196	
Clas Ohlson AB	50	881	1 034	
Cleanup Corp.	300	2 091	1 922	
Consorcio ARA SAB de CV	1 916	576	548	
Corona Corp.	100	956	891	
Crystal International Group Ltd.	4 500	1 854	2 204	
Daido Metal Co., Ltd.	1 400	6 701	7 202	
Dainichi Co., Ltd.	100	711	660	
Despegar.com Corp.	142	1 084	1 771	
Dharma Polimetal Tbk PT	36 100	5 093	4 390	
Eagle Industry Co., Ltd.	200	2 429	2 993	
EAT&HOLDINGS Co., Ltd.	100	2 302	1 965	
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 145	1 312	1 771	
Emak SpA	947	1 562	1 515	
FCC Co., Ltd.	400	7 047	6 510	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Ferrari NV	122	49 577	54 236	
First Juken Co., Ltd.	800	8 516	7 797	
F-Tech Inc.	300	2 399	1 790	
Fuji Corp. Ltd.	4 100	27 237	27 112	
FuKoKu Co., Ltd.	200	2 360	2 512	
Futaba Industrial Co., Ltd.	600	2 668	4 546	
G8 Education Ltd.	339	356	360	
Gajah Tunggal Tbk PT	98 200	7 451	8 704	
Genki Sushi Co., Ltd.	500	8 031	14 474	
Geo Holdings Corp.	300	4 800	5 954	
Gestamp Automocion SA	1 058	6 227	5 406	
Giordano International Ltd.	28 000	11 826	12 483	
Great Wall Motor Co., Ltd.	500	809	856	
Greens Co., Ltd.	300	3 764	4 927	
Gunze Ltd.	100	4 129	4 677	
H & M Hennes & Mauritz AB	18	250	416	
Hagihara Industries Inc.	400	5 090	5 402	
Haseko Corp.	400	6 614	6 854	
Hi-Lex Corp.	400	4 900	5 084	
H-One Co., Ltd.	600	4 196	4 422	
Honeys Holdings Co., Ltd.	1 200	16 870	19 597	
Hwaseung Corp. Co., Ltd.	991	2 131	2 060	
IJTT Co., Ltd.	500	2 962	4 022	
Imasen Electric Industrial	1 200	7 600	7 475	
IMMSI SpA	4 220	2 812	3 498	
Imperial Hotel Ltd.	400	3 342	3 565	
Inzi Controls Co., Ltd.	293	2 847	2 430	
JANOME Corp.	500	2 807	3 171	
JB Hi-Fi Ltd.	701	32 384	33 447	
Johnson Electric Holdings Ltd.	1 500	2 237	3 141	
JS Global Lifestyle Co., Ltd.	2 500	535	654	
KeyHolder Inc.	200	2 161	1 519	
KNT-CT Holdings Co., Ltd.	1 300	14 655	15 612	
Komatsu Matere Co., Ltd.	100	1 107	748	
Konaka Co., Ltd.	1 200	4 370	4 534	
Kurabo Industries Ltd.	100	2 139	2 705	
Lastminute.com NV	36	1 208	1 314	
Map Aktif Adiperkasa PT	14 000	703	983	
Matsuoka Corp.	200	2 102	2 712	
MBM Resources BHD	1 500	1 681	1 825	
Meiko Network Japan Co., Ltd.	100	655	716	
Meiwa Estate Co., Ltd.	1 900	16 610	21 609	
Mikuni Corp.	1 700	5 947	6 980	
Mitchells & Butlers PLC	19	88	82	
Mitra Pinasthika Mustika Tbk PT	164 800	15 709	14 819	
Morito Co., Ltd.	600	6 406	7 211	
MOS Food Services Inc.	500	15 750	15 362	
MrMax Holdings Ltd.	200	1 220	1 169	
Nichirin Co., Ltd.	200	5 091	6 117	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	600	5 789	6 745	
Nissan Motor Co., Ltd.	200	1 064	1 037	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	1 500	4 814	6 468	
Open House Group Co., Ltd.	200	7 676	7 825	
OVS SpA	3 246	9 393	10 733	
Padini Holdings Bhd	6 000	6 915	6 043	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Panasonic Holdings Corp.	1 300	16 705	16 980	
Pandora A/S	317	49 473	57 803	
Piaggio & C SpA	807	4 258	3 501	
Pirelli & C SpA	1 214	8 291	8 712	
Playtech PLC	114	843	860	
PRADA SpA	300	2 848	2 262	
Prinx Chengshan Holdings Ltd.	500	597	540	
Rock Field Co., Ltd.	300	4 489	4 526	
Roland Corp.	100	3 956	4 120	
Sanden Corp.	200	452	372	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	100	557	673	
Sanlorenzo SpA	7	348	432	
Sanoh Industrial Co., Ltd.	200	1 602	1 472	
Sanyo Shokai Ltd.	200	3 443	4 437	
Seoyon E-Hwa Co., Ltd.	25	399	491	
Shikibo Ltd.	600	6 395	6 145	
SISB PCL	8 000	9 301	10 971	
SNT Corp.	1 600	3 700	3 936	
SNT Holdings Co., Ltd.	343	5 583	6 072	
Sogefi SpA	1 559	2 641	4 644	
SPK Corp.	300	5 470	5 183	
SSI Group Inc.	46 000	2 833	2 486	
Stella International Holdings Ltd.	2 500	3 481	3 888	
Step Co., Ltd.	700	12 482	12 335	
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	2 000	28 247	28 658	
Suncall Corp.	100	580	421	
Super Retail Group Ltd.	1 272	15 595	18 048	
T RAD Co., Ltd.	400	6 760	11 542	
Tachikawa Corp.	300	3 570	3 906	
Taiho Kogyo Co., Ltd.	300	2 352	2 231	
TBK Co., Ltd.	800	2 989	2 783	
Teknosa Ic Ve Dis Ticaret AS	726	1 130	963	
Texwinca Holdings Ltd.	4 000	965	648	
Toa Corp. /Hyogo	500	4 256	4 836	
Topre Corp.	100	1 288	1 757	
Tsutsumi Jewelry Co., Ltd.	300	6 766	6 414	
Unipres Corp.	1 000	9 376	8 914	
United Arrows Ltd.	900	16 002	15 893	
Unitika Ltd.	2 600	5 612	4 231	
Van de Velde NV	275	14 918	13 519	
Vestel Beyaz Esya Sanayi ve Ticaret AS	685	496	489	
Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret AS	574	1 309	1 185	
WATAMI Co., Ltd.	200	2 154	1 936	
Webjet Ltd.	4 768	30 433	31 489	
Yossix Holdings Co., Ltd.	300	6 646	7 627	
		881 529	957 129	7,14
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 0,34 %)				
111 Inc.	140	544	286	
Adecoagro SA	803	8 921	11 753	
Aeon Co M Bhd	21 300	8 104	6 662	
Albis Co., Ltd.	100	2 248	2 456	
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	576	3 400	3 536	
Arcs Co., Ltd.	200	5 054	5 204	
Belc Co., Ltd.	100	5 368	5 846	
DingDong Cayman Ltd.	52	368	103	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Grupo Herdez SAB de CV	500	1 842	1 795	
Herbalife Ltd.	365	7 839	7 344	
Inghams Group Ltd.	907	2 768	3 232	
Metcash Ltd.	2 437	8 038	7 652	
Mitsui DM Sugar Holdings Co., Ltd.	200	5 469	5 558	
Nagatanien Holdings Co., Ltd.	100	2 072	2 006	
Nichimo Co., Ltd.	200	3 249	3 775	
Nihon Chouzai Co., Ltd.	700	8 210	9 159	
Okuwa Co., Ltd.	500	4 121	3 868	
Ontex Group NV	1 843	18 413	20 416	
Pigeon Corp.	1 000	15 270	15 189	
Premium Water Holdings Inc.	200	4 890	5 473	
Ridley Corp. Ltd.	1 486	3 038	3 677	
Sappe PCL	9 500	22 261	31 746	
Shiseido Co., Ltd.	300	11 360	11 931	
Sok Marketler Ticaret AS	2 386	7 157	5 747	
ST Corp.	400	5 752	5 713	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	70	131	84	
YAKUODO Holdings Co., Ltd.	200	5 034	5 092	
		170 921	185 303	1,38
Soins de santé (31 décembre 2022 : 1,11 %)				
Alkermes PLC	275	9 525	10 059	
Ambu A/S	935	17 137	19 220	
Arjo AB	44	588	227	
Austar Lifesciences Ltd.	2 000	461	527	
BoneSupport Holding AB	1 441	14 860	35 484	
Capitol Health Ltd.	3 655	877	773	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	220	4 466	3 920	
Eisai Co., Ltd.	600	45 441	39 575	
El.En. SpA	325	5 907	4 616	
Elekta AB	14	148	151	
FINDEX Inc.	500	3 438	4 817	
Fuji Pharma Co., Ltd.	100	1 064	1 627	
Hans Biomed Corp.	57	1 492	857	
JMS Co., Ltd.	500	2 713	2 352	
Kiniksa Pharmaceuticals Ltd.	45	835	1 041	
Kissei Pharmaceutical Co., Ltd.	100	3 114	2 890	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	700	4 639	4 793	
Koninklijke Philips NV, NYSE	949	22 376	29 194	
KPJ Healthcare Bhd	27 300	9 469	11 281	
Kyowa Kirin Co., Ltd.	100	2 287	2 217	
Linal Co., Ltd.	600	4 389	2 974	
LivaNova PLC	187	10 993	12 758	
M3 Inc.	100	1 997	2 182	
Medistim ASA	100	3 579	2 779	
Medtecs International Corp. Ltd.	76 500	15 505	14 185	
MLP Saglik Hizmetleri AS	503	3 571	3 346	
Modern Dental Group Ltd.	1 000	489	726	
Monash IVF Group Ltd.	2 593	3 134	3 033	
Mural Oncology PLC	33	757	258	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	2 507	26 540	56 324	
Nipro Corp.	300	3 076	3 106	
Novo Nordisk A/S	832	96 126	113 490	
Opthea Ltd.	584	358	300	
Peptron Inc.	109	3 970	4 492	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Pro Medicus Ltd.	513	30 274	44 232	
Prothena Corp. PLC	101	7 838	4 840	
Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	6 300	7 938	5 814	
Regis Healthcare Ltd.	712	1 626	2 082	
SanBio Co., Ltd.	3 200	22 757	21 011	
Seed Co., Ltd.	1 300	6 920	9 934	
Seikagaku Corp.	500	3 554	3 559	
Sisram Medical Ltd.	800	1 701	711	
Software Service Inc.	100	9 041	9 194	
Solasto Corp.	200	1 344	1 152	
St-Care Holding Corp.	1 200	9 003	11 190	
StemRIM Inc.	1 300	14 841	7 028	
Telix Pharmaceuticals Ltd.	3 264	26 954	29 603	
Vital KSK Holdings Inc.	300	2 732	2 929	
Zealand Pharma A/S	32	2 254	2 334	
		474 098	551 187	4,11
Services financiers (31 décembre 2022 : 1,30 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	1 308	1 113	1 155	
AEON Credit Service M Bhd	800	1 394	1 279	
Aizawa Securities Group Co., Ltd.	200	1 514	2 183	
Akatsuki Corp.	1 300	4 392	5 386	
Akbank TAS	16 980	28 301	27 686	
Akita Bank Ltd.	100	1 465	1 778	
Anadolu Anonim Turk Sigorta Sirketi	1 606	4 387	4 309	
Anadolu Hayat Emeklilik AS	985	2 365	1 676	
B2 Impact ASA	4 061	4 210	3 875	
Bairong Inc.	500	1 082	1 142	
Banca Generali SpA	22	1 051	1 078	
Banca IFIS SpA	386	7 473	8 827	
Banca Mediolanum SpA	606	7 019	7 533	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	9 332	30 844	41 404	
Banco BPM SpA	11 721	63 674	81 625	
Bank Hapoalim BM	813	9 173	9 679	
Bank Leumi Le-Israel BM	395	4 045	4 211	
Bank of Iwate Ltd.	900	17 060	21 053	
Bank of Nagoya Ltd.	200	6 731	10 176	
Bank of Saga Ltd.	500	7 894	8 647	
Bank of the Ryukyus Ltd.	400	3 773	4 138	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	1 367	11 014	11 894	
Berner Kantonalbank AG	2	684	739	
BPER Banca	182	816	802	
Bright Smart Securities & Commodities Group Ltd.	52 000	15 022	12 645	
Cembra Money Bank AG	135	14 268	13 875	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	741	1 482	
Credito Emiliano SpA	1 857	19 076	21 747	
CSU Digital SA	200	687	1 062	
Dah Sing Banking Group Ltd.	2 800	3 072	2 383	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 000	6 741	5 404	
DoValue SpA	32	354	160	
Ehime Bank Ltd.	1 500	12 564	14 142	
Entrust Inc.	200	1 665	1 482	
EQT Holdings Ltd.	980	23 532	22 485	
Helia Group Ltd.	9 765	27 738	38 219	
Hellenic Exchanges - Athens Stock Exchange SA	467	3 398	3 605	
Hong Leong Finance Ltd.	12 300	31 523	30 738	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
HS Holdings Co., Ltd.	1 100	9 934	10 381	
HUB24 Ltd.	48	1 379	1 554	
Hyakujushi Bank Ltd.	700	13 253	15 752	
Hyundai Motor Securities Co., Ltd.	151	1 279	1 328	
Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	400	2 583	2 645	
iFAST Corp. Ltd.	6 100	40 087	50 062	
Insurance Australia Group Ltd.	1 580	7 899	8 046	
Intesa Sanpaolo SpA	4 121	16 122	15 868	
Is Yatirim Menkul Degerler AS	1 155	1 648	1 650	
ISX Financial EU Ltd.	92	–	–	
James River Group Holdings Ltd.	264	7 161	3 217	
Japan Post Insurance Co., Ltd.	100	2 119	2 342	
Juroku Financial Group Inc.	200	6 457	6 968	
Keiyo Bank Ltd.	2 300	11 988	14 650	
Kita-Nippon Bank Ltd.	200	3 857	3 958	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	700	5 851	6 645	
Matsui Securities Co., Ltd.	1 100	7 808	7 531	
Medibank Pvt Ltd.	7 436	22 759	23 818	
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	191	3 099	3 117	
Mirae Asset Life Insurance Co., Ltd.	2 230	8 141	10 879	
Miyazaki Bank Ltd.	300	7 233	7 349	
Musashino Bank Ltd.	700	13 739	17 455	
MyState Ltd.	184	594	520	
Navigator Global Investments Ltd.	886	932	1 012	
Netwealth Group Ltd.	1 242	16 180	17 209	
Nib holdings Ltd.	9 471	65 624	62 974	
NZX Ltd.	8 578	8 242	7 806	
OFX Group Ltd.	11 868	16 902	16 071	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	100	1 914	1 764	
Pacific Current Group Ltd.	291	1 857	2 301	
Panin Financial Tbk PT	160 000	6 013	3 617	
Poste Italiane SpA	80	1 210	1 197	
Procrea Holdings Inc.	100	1 989	1 756	
Protector Forsikring ASA	989	20 817	23 114	
RCE Capital Bhd	600	341	527	
Resurs Holding AB	2 701	7 962	8 439	
Ringkjoebing Landbobank A/S	44	8 261	8 524	
San ju San Financial Group Inc.	700	10 075	11 883	
SBI Global Asset Management Co., Ltd.	1 600	7 893	9 129	
Sekerbank Turk AS	1 862	605	357	
Shikoku Bank Ltd.	400	3 501	3 592	
Shimizu Bank Ltd.	500	6 678	7 193	
Spar Nord Bank A/S	177	3 664	3 687	
SpareBank 1 Nord Norge	1 435	18 431	19 228	
SpareBank 1 SMN	418	7 857	7 696	
St Galler Kantonbank AG	2	1 468	1 540	
Steadfast Group Ltd.	2 602	12 912	13 625	
Sydbank AS	349	21 629	20 022	
Tamburi Investment Partners SpA	205	2 311	2 777	
Tochigi Bank Ltd.	1 400	3 375	4 059	
Tokyo Century Corp.	400	4 516	5 713	
TOMONY Holdings Inc.	1 200	4 150	4 388	
Tongyang Life Insurance Co., Ltd.	1 165	4 397	5 403	
Towa Bank Ltd.	1 500	7 272	8 502	
Traders Holdings Co., Ltd.	2 800	15 045	13 985	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Turkiye Sigorta AS	6 044	11 040	10 945	
Yamagata Bank Ltd.	400	3 934	3 996	
		885 842	961 470	7,18
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 1,17 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	100	1 764	1 685	
Ad-sol Nissin Corp.	100	1 570	1 457	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	300	4 364	6 580	
Ambarella Inc.	40	4 250	3 233	
AOI Electronics Co., Ltd.	100	1 878	2 653	
Arad Ltd.	690	14 388	13 841	
Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	200	2 506	1 964	
ASMPT Ltd.	200	2 632	2 516	
Avaco Co., Ltd.	74	1 638	1 155	
Axell Corp.	300	3 043	6 055	
Bouvet ASA	1 116	9 115	8 824	
BrainPad Inc.	100	661	1 033	
Broadleaf Co., Ltd.	100	438	540	
Business Brain Showa-Ota Inc.	100	1 915	2 041	
Business Engineering Corp.	100	2 964	3 853	
CAC Holdings Corp.	200	3 206	3 253	
Cafe24 Corp.	33	513	946	
Cal-Comp Electronics Thailand PCL, CAE sans droit de vote	7 000	545	562	
Camtek Ltd.	643	39 892	59 900	
Canon Electronics Inc.	500	9 059	9 559	
CMK Corp.	300	1 382	2 329	
CSE Global Ltd.	27 200	12 433	11 692	
CyberArk Software Ltd.	104	21 327	30 039	
D.I Corp.	442	3 493	2 851	
Daitron Co., Ltd.	100	1 526	2 620	
Data#3 Ltd.	1 177	7 305	8 938	
Datalogic SpA	1 317	14 757	12 968	
DB Inc.	212	485	376	
Densan System Holdings Co., Ltd.	100	3 347	2 589	
DMS Co., Ltd.	727	4 581	5 047	
Ebase Co., Ltd.	300	2 124	2 194	
ESPEC Corp.	300	6 548	6 619	
Forval Corp.	100	1 114	1 355	
FTGroup Co., Ltd.	1 000	11 552	11 102	
Furuno Electric Co., Ltd.	100	973	1 734	
GL Sciences Inc.	100	2 426	2 361	
Glozel Co., Ltd.	1 800	6 955	11 583	
Hanmi Semiconductor Co., Ltd.	57	3 098	3 601	
Hochiki Corp.	400	7 318	6 536	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	100	1 251	1 275	
ID Holdings Corp.	400	4 517	6 304	
I-Net Corp.	100	1 500	1 728	
Infomedia Ltd.	8 101	11 289	10 496	
Innotech Corp.	300	4 579	4 717	
Intelligent Wave Inc.	200	1 490	1 953	
I-PEX Inc.	200	2 721	2 885	
ISB Corp.	100	1 450	1 372	
KC Co., Ltd.	173	3 329	3 261	
KC Tech Co., Ltd.	393	8 948	10 783	
Kitron ASA	1 717	7 848	7 468	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	200	882	883	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	700	3 661	2 639	
Lagercrantz Group AB	77	1 271	1 361	
LG Display Co., Ltd., CAAE	28	359	178	
LINK Mobility Group Holding ASA	5 879	7 055	13 862	
LOT Vacuum Co., Ltd.	603	10 256	12 440	
Macquarie Technology Group Ltd.	329	18 187	20 292	
Maxell Ltd.	300	4 411	4 377	
Megaport Ltd.	1 678	17 416	13 890	
Meiko Electronics Co., Ltd.	100	2 695	3 900	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	100	698	865	
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	100	1 460	1 642	
Mitachi Co., Ltd.	700	9 322	7 542	
NEOJAPAN Inc.	100	910	954	
Nova Ltd.	406	48 516	74 633	
NSW Inc.	200	5 104	5 322	
Oizumi Corp.	100	582	405	
Optex Group Co., Ltd.	100	2 064	1 670	
PAX Global Technology Ltd.	1 000	1 182	1 022	
PC Partner Group Ltd.	2 000	1 892	1 060	
PCI Holdings Inc.	300	3 175	2 840	
Praemium Ltd.	14 238	9 741	4 996	
Pro-Ship Inc.	200	2 367	2 565	
RPMGlobal Holdings Ltd.	270	355	425	
RYODEN Corp.	100	1 478	2 436	
SAES Getters SpA	261	10 521	12 945	
Sapiens International Corp. NV, NASD	2	55	76	
SB Technology Corp.	200	4 563	4 443	
Shinko Shoji Co., Ltd.	100	1 077	1 089	
Shinsegae Information & Communication Co., Ltd.	245	3 331	3 038	
Soliton Systems KK	200	2 167	2 604	
Solxyz Co., Ltd.	400	1 698	1 504	
Southern Cross Payments Ltd.	3 745	3 967	–	
Spigen Korea Co., Ltd.	410	15 374	13 853	
Startia Holdings Inc.	400	4 793	5 017	
Sun-Wa Technos Corp.	200	2 875	4 108	
Suzuki Co., Ltd.	600	6 380	6 156	
System Information Co., Ltd.	600	4 295	5 202	
System Research Co., Ltd.	100	2 254	2 705	
Systema Corp.	1 500	4 373	4 293	
TAKEBISHI Corp.	500	8 237	8 960	
TeamViewer SE	505	11 409	10 342	
Technology One Ltd.	7 714	99 881	106 678	
Tenos Japan Inc.	400	2 358	2 379	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	200	2 999	3 788	
TIS Inc.	100	3 127	2 906	
Tobii AB	489	4 009	377	
Tomen Devices Corp.	100	5 318	5 013	
Tongda Group Holdings Ltd.	90 000	1 561	1 565	
Top Engineering Co., Ltd.	358	2 463	2 020	
Tower Semiconductor Ltd.	611	21 421	24 768	
Tsuzuki Denki Co., Ltd.	300	6 019	6 319	
U-blox Holding AG	15	2 498	2 348	
Uchi Technologies Bhd	16 700	16 337	17 779	
Uchida Yoko Co., Ltd.	100	6 202	6 435	
UMC Electronics Co., Ltd.	100	483	345	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
UMS Holdings Ltd.	7 300	8 631	9 778	
Vaisala Oyj	100	5 758	5 783	
Venture Corp. Ltd.	1 500	21 523	20 407	
VINX Corp.	100	1 330	1 889	
Vista Group International Ltd.	5 632	6 961	7 758	
Wasion Holdings Ltd.	18 000	10 716	11 915	
Weimob Inc.	1 000	696	486	
Wix.com Ltd.	173	19 070	28 063	
Wonik Holdings Co., Ltd.	824	2 909	2 843	
Xero Ltd.	89	7 918	8 993	
		770 603	859 595	6,42
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,13 %)				
Amuse Inc.	300	5 510	4 164	
Arnoldo Mondadori Editore SpA	3 390	9 655	10 592	
Aussie Broadband Ltd.	137	473	481	
Avex Inc.	800	12 217	10 236	
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	621	1 125	1 120	
Cairo Communication SpA	511	1 294	1 346	
CAR Group Ltd.	270	6 474	7 565	
Chorus Ltd.	1 503	10 347	9 863	
COOKPAD Inc.	1 000	1 429	1 104	
Crazy Sports Group Ltd.	12 000	545	203	
Freebit Co., Ltd.	200	2 214	2 725	
G5 Entertainment AB	31	1 138	632	
IMAGICA Group Inc.	1 000	5 862	5 967	
Indosat Tbk PT	3 100	1 798	2 489	
Inkeverse Group Ltd.	7	2	1	
Maoyan Entertainment	1 400	2 600	2 123	
Marvelous Inc.	400	2 937	2 668	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	35	258	167	
OCK Group Bhd	4 900	627	612	
Oricon Inc.	400	3 820	2 746	
Paradox Interactive AB	31	1 083	914	
Perion Network Ltd.	297	15 591	12 387	
Pico Far East Holdings Ltd.	42 000	10 417	10 922	
Sanoma Oyj	900	10 927	9 111	
SKY Network Television Ltd.	5 895	11 772	13 584	
Spark New Zealand Ltd.	10 873	42 884	47 022	
Telecom Italia SpA	16 157	6 130	6 924	
Television Broadcasts Ltd.	4 200	2 841	2 241	
TPG Telecom Ltd.	328	1 572	1 529	
Tuas Ltd.	4 613	8 668	13 282	
TX Group AG	8	1 458	1 514	
Wantedly Inc.	200	3 846	2 555	
Xinhua Winshare Publishing and Media Co., Ltd., HKG	1 000	927	1 174	
Zenrin Co., Ltd.	200	1 729	1 635	
		190 170	191 598	1,43
Services publics (31 décembre 2022 : 1,06 %)				
AGL Energy Ltd.	4 499	37 147	38 375	
Chubu Electric Power Co Inc.	1 400	23 912	23 851	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	118	357	361	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	300	1 007	1 072	
Kenon Holdings Ltd.	103	5 414	3 298	
Manila Water Co Inc.	4 400	1 930	1 949	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 444	113	145	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Semcorp Industries Ltd.	8 600	45 468	45 649	
Shizuoka Gas Co., Ltd.	400	3 637	3 839	
Tohoku Electric Power Co Inc.	2 900	26 077	26 009	
YTL Corp. Bhd	4 100	1 415	2 224	
YTL Power International Bhd	7 900	3 978	5 758	
		150 455	152 530	1,14
Immobilier (31 décembre 2022 : 0,27 %)				
Airport Facilities Co., Ltd.	1 400	7 782	7 726	
Capitaland India Trust	4 100	4 468	4 672	
Concentradora Fibra Danhos SA de CV	1 900	3 384	3 101	
Grandy House Corp.	600	3 495	3 446	
Intershop Holding AG	10	9 919	9 635	
IOI Properties Group Bhd	8 300	2 967	4 168	
Keppel DC REIT	7 800	14 676	15 204	
Keppel REIT	12 340	11 018	11 472	
Lendlease Corp. Ltd.	111	650	746	
Leopalace21 Corp.	200	638	801	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	800	373	414	
Mah Sing Group Bhd	6 500	1 195	1 548	
Matrix Concepts Holdings Bhd	8 100	3 417	3 835	
Melison Ltd.	40	3 864	4 101	
Mugen Estate Co., Ltd.	500	3 974	5 060	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	400	2 439	1 874	
OSK Holdings Bhd	26 000	7 742	9 252	
Peet Ltd.	1 312	1 379	1 493	
Reit 1 Ltd.	5	42	31	
Rural Funds Group	623	1 336	1 188	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	100	3 750	3 634	
Selvaag Bolig ASA	1 393	7 242	5 987	
Summarecon Agung Tbk PT	40 000	2 525	1 970	
Swire Pacific Ltd.	3 500	35 938	39 067	
Swire Properties Ltd.	400	1 399	1 067	
Swiss Prime Site AG	4	465	563	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 959	
Torunlar Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	1 585	2 642	2 243	
UOL Group Ltd.	1 900	12 153	11 927	
		152 792	158 184	1,18
Total des actions étrangères – position acheteur		5 996 521	6 561 550	48,97
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2022 : -1,05 %)				
Aker BP ASA	(55)	(2 070)	(2 110)	
BP PLC, CAAE	(1 101)	(54 015)	(51 393)	
Cooper Energy Ltd.	(9 662)	(3 114)	(1 130)	
Diversified Energy Co PLC	(19)	(588)	(356)	
Ecopetrol SA	(932)	(15 472)	(14 649)	
Eni SpA, MIL	(2 317)	(43 487)	(51 799)	
Eni SpA, NYSE	(1 142)	(43 997)	(51 214)	
John Wood Group PLC	(282)	(637)	(816)	
Paladin Energy Ltd.	(13 735)	(7 780)	(12 173)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(72)	(5 731)	(5 934)	
Shell PLC, CAAE	(1 159)	(103 945)	(100 559)	
TGS ASA	(41)	(770)	(704)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
TotalEnergies SE	(1 254)	(113 109)	(111 414)	
Weatherford International PLC	(22)	(2 852)	(2 838)	
		(397 567)	(407 089)	(3,04)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,15 %)				
Alumina Ltd.	(815)	(763)	(664)	
Anglogold Ashanti PLC, NYSE	(3 576)	(98 579)	(88 129)	
BASF SE	(11)	(762)	(782)	
BEWi ASA	(813)	(3 098)	(2 713)	
Bowen Coking Coal Ltd.	(13 902)	(1 631)	(1 251)	
Calix Ltd.	(5 240)	(16 072)	(16 171)	
Capricorn Metals Ltd.	(421)	(1 598)	(1 784)	
Chalice Mining Ltd.	(1 720)	(5 127)	(2 623)	
Champion Iron Ltd.	(400)	(2 532)	(2 984)	
Cia de Minas Buenaventura SAA	(1 146)	(12 391)	(23 029)	
Core Lithium Ltd.	(32 604)	(28 148)	(7 334)	
Hokuetsu Corp.	(100)	(698)	(1 325)	
Kobe Steel Ltd.	(300)	(4 620)	(5 119)	
Liontown Resources Ltd.	(3 895)	(6 120)	(5 782)	
Mineral Resources Ltd.	(1 254)	(66 639)	(78 980)	
Pilbara Minerals Ltd.	(15 962)	(52 327)	(56 729)	
Sandfire Resources Ltd.	(1 921)	(10 253)	(12 687)	
Sayona Mining Ltd.	(12 684)	(1 235)	(810)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(3 811)	(31 523)	(27 287)	
SOL SpA	(29)	(678)	(1 174)	
Syrah Resources Ltd.	(1 601)	(1 283)	(929)	
Talga Group Ltd.	(3 161)	(3 142)	(2 233)	
Tata Steel Ltd.	(14)	(354)	(303)	
Tietto Minerals Ltd.	(16 832)	(6 986)	(9 238)	
Trident Royalties PLC	(428)	(376)	(237)	
Tronox Holdings PLC	(644)	(10 982)	(12 024)	
Vulcan Energy Resources Ltd.	(3 085)	(6 990)	(7 911)	
		(374 907)	(370 232)	(2,76)
Industries (31 décembre 2022 : -2,55 %)				
Adecco Group AG	(1)	(73)	(65)	
Aéroports de Paris SA	(1)	(185)	(171)	
AFC Energy PLC	(3 797)	(986)	(1 308)	
Aker Carbon Capture ASA	(1 719)	(3 501)	(3 031)	
AP Moller - Maersk A/S	(11)	(23 067)	(26 093)	
AutoStore Holdings Ltd.	(294)	(743)	(763)	
Beijer Ref AB	(438)	(5 818)	(7 731)	
Clarivate PLC	(5 035)	(59 604)	(61 479)	
Daikin Industries Ltd.	(200)	(39 493)	(42 996)	
Downer EDI Ltd.	(254)	(929)	(1 006)	
Elbit Systems Ltd.	(4)	(1 089)	(1 125)	
Elco Ltd.	(257)	(15 957)	(10 738)	
Enav SpA	(304)	(1 580)	(1 521)	
Fluidra SA	(955)	(16 914)	(26 221)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(337)	
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	(98)	(17 148)	(22 642)	
Hankyu Hanshin Holdings Inc.	(300)	(12 837)	(12 596)	
Harmonic Drive Systems Inc.	(1 100)	(35 633)	(42 800)	
Hexagon Composites ASA	(157)	(582)	(589)	
Hexagon Purus ASA	(5 504)	(8 480)	(7 961)	
International Consolidated Airlines Group SA	(506)	(1 200)	(1 313)	
Japan Airlines Co., Ltd.	(100)	(2 585)	(2 595)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Japan Airport Terminal Co., Ltd.	(200)	(13 555)	(11 618)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(1 000)	(55 694)	(56 586)	
Kornit Digital Ltd.	(411)	(15 103)	(10 384)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(2 200)	(15 416)	(15 638)	
MINEBEA MITSUMI Inc.	(100)	(2 543)	(2 711)	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	(100)	(7 051)	(7 708)	
Mitsui & Co., Ltd.	(800)	(40 616)	(39 642)	
Nitto Boseki Co., Ltd.	(100)	(3 811)	(4 298)	
Nomura Micro Science Co., Ltd.	(100)	(10 898)	(13 964)	
NTG Nordic Transport Group A/S	(5)	(359)	(287)	
Prosegur Cia de Seguridad SA	(50)	(292)	(128)	
Raksul Inc.	(500)	(7 070)	(5 930)	
Recruit Holdings Co., Ltd.	(700)	(35 811)	(39 041)	
Seatrium Ltd.	(84 400)	(9 152)	(9 955)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(542)	(5 360)	(4 607)	
Tadano Ltd.	(100)	(1 034)	(1 103)	
Tinexta SpA	(96)	(3 051)	(2 836)	
TOMRA Systems ASA	(1 731)	(23 288)	(27 745)	
Toyota Industries Corp.	(300)	(29 812)	(32 268)	
Trane Technologies PLC	(169)	(52 670)	(54 352)	
Vestas Wind Systems A/S	(60)	(2 224)	(2 512)	
Vow ASA	(1 250)	(2 350)	(1 889)	
		(586 008)	(620 283)	(4,63)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,22 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(331)	
Avolta AG	(78)	(4 767)	(4 042)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(1 262)	(5 589)	(6 793)	
Baby Bunting Group Ltd.	(1 214)	(2 369)	(2 185)	
Bike24 Holding AG	(100)	(426)	(214)	
De' Longhi SpA	(18)	(464)	(800)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(955)	(43 892)	(50 645)	
GN Store Nord AS	(686)	(21 765)	(23 028)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(66)	(351)	(327)	
Harvey Norman Holdings Ltd.	(75)	(367)	(283)	
Harvia Oyj	(160)	(5 178)	(6 339)	
Henry Boot PLC	(100)	(373)	(350)	
IDP Education Ltd.	(2 960)	(58 176)	(53 345)	
Istyle Inc.	(3 400)	(14 716)	(13 197)	
JM AB	(114)	(5 420)	(2 648)	
Just Eat Takeaway.com NV	(19)	(1 068)	(381)	
KMD Brands Ltd.	(2)	(2)	(1)	
Leifheit AG	(29)	(574)	(686)	
Lovisa Holdings Ltd.	(194)	(3 303)	(4 271)	
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	(3)	(3 062)	(3 206)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(2 001)	(25 096)	(23 404)	
Minor International PCL, CAE sans droit de vote	(45)	(50)	(51)	
Moncler SpA	(21)	(1 716)	(1 704)	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	(24)	(1 710)	(1 619)	
Salvatore Ferragamo SpA	(31)	(554)	(551)	
Sharp Corp.	(100)	(991)	(940)	
Signet Jewelers Ltd.	(57)	(6 858)	(8 062)	
Sony Group Corp., CAAE	(12)	(1 497)	(1 498)	
Star Entertainment Grp Ltd.	(34 544)	(18 280)	(16 007)	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	(400)	(6 590)	(6 717)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Tabcorp Holdings Ltd.	(873)	(702)	(656)	
Tadiran Group Ltd.	(13)	(1 607)	(1 277)	
Toyota Motor Corp.	(4)	(1 017)	(967)	
Verkkokauppa.com Oyj	(24)	(139)	(91)	
WH Smith PLC	(331)	(8 414)	(7 422)	
		(247 430)	(244 038)	(1,82)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -1,06 %)				
Aeon Co., Ltd.	(300)	(8 771)	(8 841)	
Agrana Beteiligungs AG	(25)	(657)	(513)	
Aker BioMarine ASA	(100)	(514)	(597)	
Anora Group Oyj	(100)	(1 064)	(635)	
Bega Cheese Ltd.	(1 628)	(5 156)	(5 185)	
BrasilAgro - Co Brasileira de Propriedades Agrícolas	(609)	(5 045)	(4 240)	
Chubu Shiryō Co., Ltd.	(200)	(2 174)	(2 050)	
Cia Cervecerias Unidas SA	(647)	(13 074)	(10 698)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(48)	(2 915)	(4 224)	
Diageo PLC	(534)	(113 099)	(102 564)	
Elders Ltd.	(783)	(4 953)	(5 305)	
ForFarmers NV	(77)	(375)	(267)	
Grieg Seafood ASA	(342)	(3 610)	(3 033)	
Heineken NV	(6)	(783)	(804)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 746)	(2 765)	
Kesko Oyj	(109)	(2 911)	(2 846)	
MARR SpA	(65)	(1 141)	(1 087)	
Pharmanutra SpA	(36)	(2 839)	(2 957)	
Schouw & Co A/S	(146)	(15 014)	(15 776)	
Select Harvests Ltd.	(69)	(429)	(180)	
Seven & i Holdings Co., Ltd.	(100)	(5 233)	(5 233)	
Strauss Group Ltd.	(13)	(341)	(324)	
Yoshimura Food Holdings KK	(1 200)	(12 910)	(11 695)	
		(206 754)	(191 819)	(1,43)
Soins de santé (31 décembre 2022 : -0,81 %)				
ArcticZymes Technologies ASA	(1 083)	(4 272)	(5 906)	
AstraZeneca PLC, CAAE	(177)	(15 821)	(15 719)	
Atrys Health SA	(123)	(1 785)	(658)	
BioMérieux	(6)	(881)	(879)	
Boiron SA	(50)	(3 032)	(2 929)	
Chemometec A/S	(117)	(9 879)	(8 870)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(2 600)	(117 604)	(129 907)	
Coloplast A/S	(560)	(87 854)	(84 474)	
CRISPR Therapeutics AG	(340)	(27 307)	(28 065)	
DiaSorin SpA	(335)	(46 306)	(45 498)	
EBOS Group Ltd.	(4)	(119)	(119)	
Galapagos NV	(15)	(874)	(808)	
Galapagos NV, CAAE	(20)	(984)	(1 072)	
Genmab A/S	(84)	(42 600)	(35 371)	
GNI Group Ltd.	(200)	(5 713)	(5 294)	
I-Mab	(849)	(3 574)	(2 127)	
Imugene Ltd.	(8 463)	(732)	(838)	
Inmode Ltd.	(2 380)	(67 820)	(69 795)	
JMDC Inc.	(400)	(16 470)	(15 949)	
Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	(4)	(353)	(351)	
Legend Biotech Corp.	(278)	(24 743)	(22 057)	
Lonza Group AG	(2)	(1 728)	(1 108)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
MeiraGTx Holdings PLC	(305)	(2 236)	(2 823)	
Merus NV	(167)	(5 266)	(6 056)	
Mesoblast Ltd., CAAE	(234)	(437)	(339)	
Molecular Partners AG	(114)	(2 464)	(614)	
Nano-X Imaging Ltd.	(416)	(4 916)	(3 494)	
Oncopeptides AB	(1 735)	(2 152)	(1 739)	
PolyNovo Ltd.	(13 963)	(18 754)	(20 792)	
ProQR Therapeutics NV	(95)	(269)	(248)	
Scancell Holdings PLC	(1 620)	(381)	(286)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., CAAE	(350)	(4 456)	(4 818)	
Vetoquinol SA	(100)	(10 465)	(14 916)	
		(532 247)	(533 919)	(3,99)
Services financiers (31 décembre 2022 : -2,42 %)				
Aegon Ltd., AMS	(9 405)	(66 675)	(71 894)	
Aegon Ltd., NYSE	(807)	(3 229)	(6 129)	
Baloise Holding AG	(2)	(416)	(413)	
Banco Macro SA	(719)	(16 893)	(27 210)	
Banco Santander Chile	(1 379)	(34 644)	(35 440)	
Banco Santander SA, CAAE	(2 993)	(13 780)	(16 339)	
Bank of Ireland Group PLC	(44)	(577)	(527)	
Barclays PLC	(163)	(1 589)	(1 694)	
Commercial International Bank - Egypt (CIB)	(1 948)	(3 381)	(3 288)	
Credit Corp. Group Ltd.	(810)	(14 021)	(11 814)	
Daiwa Securities Group Inc.	(100)	(850)	(888)	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	(396)	(1 253)	(1 269)	
Grupo Financiero Galicia SA	(2 918)	(46 831)	(66 430)	
Grupo Supervielle SA	(1 154)	(2 643)	(6 178)	
Hachijuni Bank Ltd.	(700)	(5 445)	(5 144)	
HDFC Bank Ltd., CAAE	(1 522)	(128 043)	(134 684)	
MA Financial Group Ltd.	(6 062)	(27 778)	(30 108)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(7 300)	(75 583)	(82 718)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAE	(69)	(685)	(783)	
Nexi SpA	(5 476)	(75 254)	(59 073)	
Prudential PLC	(9)	(175)	(134)	
Prudential PLC, CAAE	(1)	(37)	(30)	
Solvar Ltd.	(454)	(705)	(539)	
St James's Place PLC	(8)	(122)	(92)	
Standard Chartered PLC	(104)	(1 091)	(1 165)	
UBS Group AG	(209)	(5 869)	(8 546)	
Willis Towers Watson PLC	(46)	(14 520)	(14 630)	
		(542 089)	(587 159)	(4,38)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -1,58 %)				
Adtran Networks SE	(16)	(395)	(466)	
Avantest Corp.	(2 800)	(124 784)	(125 627)	
Amper SA	(3 987)	(904)	(486)	
Appier Group Inc.	(2 500)	(36 944)	(43 258)	
Aurora Innovation Inc.	(2 131)	(9 456)	(12 279)	
Bit Digital Inc.	(3 401)	(16 285)	(18 970)	
BrainChip Holdings Ltd.	(5 042)	(1 887)	(771)	
Bravura Solutions Ltd.	(196)	(373)	(151)	
Canaan Inc.	(373)	(1 012)	(1 136)	
Cognyte Software Ltd.	(70)	(2 509)	(594)	
Crayon Group Holding ASA	(169)	(2 474)	(1 859)	
Credo Technology Group Holding Ltd.	(561)	(13 213)	(14 403)	
Digital Garage Inc.	(600)	(26 810)	(20 567)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Disco Corp.	(100)	(23 778)	(32 717)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(200)	(15 850)	(15 850)	
Hexagon AB	(288)	(3 807)	(4 558)	
Infosys Ltd.	(3 701)	(86 101)	(89 697)	
Innoviz Technologies Ltd.	(337)	(1 040)	(1 124)	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	(1 108)	(44 278)	(53 970)	
Kapsch TrafficCom AG	(21)	(421)	(274)	
Keyence Corp.	(200)	(120 717)	(116 203)	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	(48)	(389)	(454)	
Money Forward Inc.	(1 100)	(56 529)	(44 467)	
Netcompany Group A/S	(257)	(18 209)	(11 329)	
Nice Ltd.	(72)	(19 279)	(18 941)	
Nordic Semiconductor ASA	(3 168)	(46 818)	(51 827)	
NXP Semiconductors NV	(5)	(1 497)	(1 514)	
Optim Corp.	(500)	(5 718)	(3 863)	
Rakus Co., Ltd.	(600)	(12 595)	(14 661)	
REC Silicon ASA	(4 482)	(8 465)	(8 147)	
Renesas Electronics Corp.	(600)	(12 896)	(14 305)	
Ricoh Co., Ltd.	(400)	(4 545)	(4 052)	
Rohm Co., Ltd.	(1 000)	(25 291)	(25 277)	
Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	(6)	(10 761)	(11 852)	
Secunet Security Networks AG	(1)	(821)	(213)	
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	(1 700)	(88 120)	(87 197)	
Silex Systems Ltd.	(5 459)	(15 792)	(21 366)	
Silicom Ltd.	(73)	(1 603)	(1 742)	
Sinch AB	(405)	(1 979)	(1 988)	
SMART Global Holdings Inc.	(136)	(4 089)	(3 395)	
Softwareone Holding AG	(34)	(561)	(874)	
Towa Corp.	(200)	(4 606)	(13 338)	
Wipro Ltd.	(93)	(580)	(683)	
WiseTech Global Ltd.	(280)	(17 538)	(18 988)	
		(891 719)	(915 433)	(6,83)
Services de communication (31 décembre 2022: -1,38 %)				
Adevinta ASA	(1 899)	(21 468)	(27 714)	
Capcom Co., Ltd.	(200)	(8 526)	(8 523)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 454)	(15 388)	(13 826)	
Future PLC	(44)	(776)	(588)	
Grupo Televisa SAB	(33)	(438)	(145)	
Gurunavi Inc.	(600)	(2 207)	(1 532)	
Heroz Inc.	(400)	(5 578)	(6 323)	
Japan Communications Inc.	(400)	(911)	(853)	
Liberty Latin America Ltd., cat. C	(49)	(519)	(474)	
Métropole Télévision SA	(160)	(3 091)	(3 016)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., A	(1 111)	(2 784)	(3 816)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	(62)	(369)	(295)	
Mobile TeleSystems PJSC	(911)	(8 419)	–	
MTI Ltd.	(100)	(504)	(607)	
Nexon Co., Ltd.	(400)	(10 740)	(9 613)	
Nintendo Co., Ltd.	(400)	(26 431)	(27 532)	
Remedy Entertainment Oyj	(27)	(644)	(999)	
RTL Group SA	(10)	(512)	(509)	
SEEK Ltd.	(756)	(14 500)	(18 182)	
SoftBank Group Corp.	(300)	(17 911)	(17 658)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(1 688)	(1 529)	(1 511)	
Telecom Argentina SA	(4 740)	(34 175)	(44 689)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Toei Animation Co., Ltd.	(100)	(14 125)	(17 705)	
		(191 545)	(206 110)	(1,54)
Services publics (31 décembre 2022 : -0,38 %)				
Central Puerto SA	(375)	(4 189)	(4 500)	
EDP Renovaveis SA	(314)	(7 163)	(8 473)	
Elmera Group ASA	(125)	(363)	(490)	
Empresa Distribuidora Y Comercializadora Norte	(535)	(7 774)	(13 665)	
Fortum Oyj	(13)	(262)	(247)	
Italgas SpA	(3 832)	(29 438)	(28 913)	
Naturgy Energy Group SA	(23)	(769)	(905)	
OPC Energy Ltd.	(100)	(848)	(861)	
Orsted AS	(276)	(19 500)	(20 186)	
		(70 306)	(78 240)	(0,58)
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,11 %)				
Abacus Group	(13 711)	(32 021)	(14 187)	
Abacus Storage King	(17 597)	(24 739)	(17 891)	
Altisource Portfolio Solutions SA	(29)	(473)	(136)	
Ananda Development PCL	(31 600)	(1 789)	(940)	
Atrium Ljungberg AB	(18)	(325)	(545)	
BWP Trust	(1 605)	(5 781)	(5 098)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(473)	(2 019)	(2 124)	
Charter Hall Group	(8 307)	(82 010)	(89 990)	
Charter Hall Long Wale REIT	(510)	(1 871)	(1 725)	
Deutsche Wohnen SE	(113)	(6 022)	(3 940)	
Goldcrest Co., Ltd.	(100)	(1 694)	(2 067)	
Hamborner REIT AG	(61)	(690)	(605)	
Immobel SA	(83)	(8 723)	(3 603)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA, bons de souscription	(290)	-	(184)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(200)	(1 704)	(2 022)	
Pandox AB	(501)	(7 192)	(9 859)	
Picton Property Income Ltd.	(332)	(418)	(386)	
Property & Building Corp. Ltd.	(16)	(997)	(1 289)	
SRE Holdings Corp.	(400)	(12 507)	(10 303)	
Stendorren Fastigheter AB	(115)	(2 856)	(2 760)	
Supermarket Income Reit PLC	(4 266)	(5 484)	(6 232)	
Wallenstam AB	(20)	(95)	(143)	
Yanlord Land Group Ltd.	(900)	(575)	(522)	
		(199 985)	(176 551)	(1,32)
Total des actions étrangères – position vendeur		(4 240 557)	(4 330 873)	(32,32)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		(6 750)		
Total du portefeuille de placements		(2 643 096)	(2 188 058)	(16,33)
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			362 813	2,71
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(112 715)	(0,84)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			922 862	6,89
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(409 434)	(3,06)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Autres actifs, moins les passifs			14 821 547	110,63
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			13 397 015	100,00

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

Contrats de change à terme (Annexe 1)

Au 31 décembre 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente
						\$
Banque Royale du Canada	USD	(105 288)	GBP	84 000	19 mars 2024	2 392
Banque Royale du Canada	USD	(52 557)	NOK	539 000	19 mars 2024	798
Banque Royale du Canada	USD	(9 496 747)	CAD	12 872 000	19 mars 2024	359 623
						362 813
Banque Royale du Canada	AUD	(401 000)	USD	264 808	19 mars 2024	(12 347)
Banque Royale du Canada	CNY	(465 000)	USD	65 581	19 mars 2024	(672)
Banque Royale du Canada	DKK	(1 692 000)	USD	246 234	19 mars 2024	(7 221)
Banque Royale du Canada	EUR	(127 000)	USD	137 646	19 mars 2024	(4 047)
Banque Royale du Canada	HKD	(1 175 000)	USD	150 635	19 mars 2024	(163)
Banque Royale du Canada	ILS	(605 000)	USD	163 931	19 mars 2024	(5 858)
Banque Royale du Canada	JPY	(132 332 000)	USD	925 588	19 mars 2024	(32 711)
Banque Royale du Canada	NZD	(157 000)	USD	96 179	19 mars 2024	(4 222)
Banque Royale du Canada	NOK	(3 806 000)	USD	349 279	19 mars 2024	(34 051)
Banque Royale du Canada	SGD	(411 000)	USD	307 686	19 mars 2024	(6 593)
Banque Royale du Canada	SEK	(1 092 000)	USD	104 993	19 mars 2024	(4 830)
						(112 715)
						250 098

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

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contreparties : La Banque de Nouvelle-Écosse, notation AA; JP Morgan, notation A				
Swaps d'actions – position acheteur				
Dollar australien – taux de swap des acceptations bancaires (BBSW) à 1 mois				
5 340	31 juill. 2024	Firefinch Ltd, swap sur rendement total	961	116
4 171	31 juill. 2024	Ten Sixty Four Ltd, swap sur rendement total	1 070	(1 076)
				(960)
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
182	31 juill. 2024	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	13 981	870
325	31 juill. 2024	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	1 710	234
4 935	31 juill. 2024	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	11 614	(832)
1 005	31 juill. 2024	Anglo American Plc, swap sur rendement total	33 290	(781)
489	31 juill. 2024	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	1 831	369
148	31 juill. 2024	Associated British Foods Plc, swap sur rendement total	6 003	67
6 958	31 juill. 2024	Aston Martin Lagonda Global, swap sur rendement total	26 386	(278)
7 472	31 juill. 2024	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	49 826	53
1 613	31 juill. 2024	Bae Systems Plc, swap sur rendement total	30 110	1 539
699	31 juill. 2024	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	952	(44)
130	31 juill. 2024	Balfour Beatty Plc, swap sur rendement total	724	10
2 121	31 juill. 2024	Bank Of Cyprus Holdings Plc, swap sur rendement total	10 839	853
231	31 juill. 2024	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	15 435	1 989
31	31 juill. 2024	Bellway Plc, swap sur rendement total	1 388	125
327	31 juill. 2024	Bodycote Plc, swap sur rendement total	3 268	98
1 411	31 juill. 2024	Boku Inc, swap sur rendement total	3 166	(262)
828	31 juill. 2024	Braemar Shipping Services Pl, swap sur rendement total	3 828	(98)
100	31 juill. 2024	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	609	23
2 254	31 juill. 2024	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	587	(59)
5 697	31 juill. 2024	Bt Group Plc, swap sur rendement total	12 058	207
597	31 juill. 2024	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	12 173	1 332
16 938	31 juill. 2024	Capita Plc, swap sur rendement total	6 264	805
4 447	31 juill. 2024	Card Factory Plc, swap sur rendement total	8 058	609
587	31 juill. 2024	Centamin Plc, swap sur rendement total	984	25
14 028	31 juill. 2024	Centrica Plc, swap sur rendement total	33 166	(878)
32	31 juill. 2024	Computacenter Plc, swap sur rendement total	1 502	45
918	31 juill. 2024	Darktrace Plc, swap sur rendement total	5 659	278
2 269	31 juill. 2024	Dfs Furniture Plc, swap sur rendement total	4 646	525
433	31 juill. 2024	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	2 743	39
463	31 juill. 2024	Easyjet Plc, swap sur rendement total	3 969	158
325	31 juill. 2024	Eckoh Plc, swap sur rendement total	213	16
248	31 juill. 2024	Equals Group Plc, swap sur rendement total	507	4
1 923	31 juill. 2024	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	5 705	498
846	31 juill. 2024	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	654	24
191	31 juill. 2024	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	2 923	2
1 048	31 juill. 2024	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	3 964	100
11 532	31 juill. 2024	Glencore Plc, swap sur rendement total	91 515	4 627
82	31 juill. 2024	Greggs Plc, swap sur rendement total	3 587	187
632	31 juill. 2024	H&T Group Plc, swap sur rendement total	4 589	(404)
541	31 juill. 2024	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	1 840	123
5 114	31 juill. 2024	Hammerson Plc, swap sur rendement total	2 441	103
3 512	31 juill. 2024	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	43 332	764
5 341	31 juill. 2024	Hays Plc, swap sur rendement total	9 804	415
614	31 juill. 2024	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	10 878	330
339	31 juill. 2024	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	778	69
280	31 juill. 2024	Howden Joinery Group Plc, swap sur rendement total	3 829	310
1 000	31 juill. 2024	Hunting Plc, swap sur rendement total	4 967	580
125	31 juill. 2024	Ibstock Plc, swap sur rendement total	318	42
1 696	31 juill. 2024	Idox Plc, swap sur rendement total	1 964	133
43	31 juill. 2024	Inchcape Plc, swap sur rendement total	517	57
164	31 juill. 2024	International Personal Finan, swap sur rendement total	328	19
1 223	31 juill. 2024	Investec Plc, swap sur rendement total	10 933	351
967	31 juill. 2024	Iomart Group Plc, swap sur rendement total	2 477	(192)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 142	31 juill. 2024	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	3 191	120
22	31 juill. 2024	Jet2 Plc, swap sur rendement total	463	16
139	31 juill. 2024	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	4 018	333
3 090	31 juill. 2024	Jupiter Fund Management, swap sur rendement total	4 851	560
138	31 juill. 2024	Keller Group Plc, swap sur rendement total	2 041	144
3 983	31 juill. 2024	Kenmare Resources Plc, swap sur rendement total	26 413	(469)
6 376	31 juill. 2024	Kier Group Plc, swap sur rendement total	11 489	(214)
9	31 juill. 2024	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	99	17
824	31 juill. 2024	London Stock Exchange Group, swap sur rendement total	128 455	4 270
123	31 juill. 2024	M&C Saatchi Plc, swap sur rendement total	331	41
16 822	31 juill. 2024	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	77 309	5 706
1 187	31 juill. 2024	Marston'S Plc, swap sur rendement total	674	77
2 686	31 juill. 2024	Me Group International Plc, swap sur rendement total	5 644	(144)
4 813	31 juill. 2024	Melrose Industries Plc, swap sur rendement total	45 905	3 784
2 084	31 juill. 2024	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	9 031	1 176
7 263	31 juill. 2024	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	12 245	237
70	31 juill. 2024	Mj Gleeson Plc, swap sur rendement total	571	48
585	31 juill. 2024	Mobico Group Plc, swap sur rendement total	832	172
2 207	31 juill. 2024	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	10 395	249
882	31 juill. 2024	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	4 196	393
179	31 juill. 2024	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	6 665	518
1 455	31 juill. 2024	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	3 150	170
4 269	31 juill. 2024	Netcall Plc, swap sur rendement total	6 518	1 183
187	31 juill. 2024	Next Plc, swap sur rendement total	25 725	549
457	31 juill. 2024	Ninety One Plc, swap sur rendement total	1 410	83
121	31 juill. 2024	Norcros Plc, swap sur rendement total	397	59
1 082	31 juill. 2024	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	8 450	1 585
206	31 juill. 2024	Oxford Instruments Plc, swap sur rendement total	7 947	594
340	31 juill. 2024	Oxford Metrics Plc, swap sur rendement total	627	125
1 104	31 juill. 2024	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	12 944	3 405
3 853	31 juill. 2024	Pendragon Plc, swap sur rendement total	2 092	24
34	31 juill. 2024	Persimmon Plc, swap sur rendement total	794	66
1 765	31 juill. 2024	Playtech Plc, swap sur rendement total	13 309	1 075
23	31 juill. 2024	Polar Capital Holdings Plc, swap sur rendement total	186	13
1 116	31 juill. 2024	Rank Group Plc, swap sur rendement total	1 407	(15)
58	31 juill. 2024	Reach Plc, swap sur rendement total	73	3
94	31 juill. 2024	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	1 357	25
260	31 juill. 2024	Renishaw Plc, swap sur rendement total	15 638	1 209
23 182	31 juill. 2024	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	116 787	10 681
426	31 juill. 2024	Sanderson Design Group Plc, swap sur rendement total	834	(3)
1 812	31 juill. 2024	Senior Plc, swap sur rendement total	5 409	182
4 664	31 juill. 2024	Serco Group Plc, swap sur rendement total	12 709	396
1 660	31 juill. 2024	Severfield Plc, swap sur rendement total	1 775	93
254	31 juill. 2024	Sig Plc, swap sur rendement total	143	21
410	31 juill. 2024	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	668	59
1 180	31 juill. 2024	Somero Enterprises Inc, actions ord., swap sur rendement total	7 438	1 665
11 569	31 juill. 2024	Speedy Hire Plc, swap sur rendement total	6 554	401
181	31 juill. 2024	Sthree Plc, swap sur rendement total	1 272	38
377	31 juill. 2024	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	932	34
1 423	31 juill. 2024	Tbc Bank Group Plc, swap sur rendement total	67 693	967
24	31 juill. 2024	Telecom Plus Plc, swap sur rendement total	650	29
68	31 juill. 2024	Ten Entertainment Group Plc, swap sur rendement total	472	1
2 958	31 juill. 2024	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	7 384	875
359	31 juill. 2024	Tt Electronics Plc, swap sur rendement total	943	46
10 640	31 juill. 2024	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	6 961	473
464	31 juill. 2024	Tyman Plc, swap sur rendement total	2 453	394
200	31 juill. 2024	United Utilities Group Plc, swap sur rendement total	3 618	(65)
3 355	31 juill. 2024	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	4 052	(734)
337	31 juill. 2024	Volex Plc, swap sur rendement total	1 815	89
434	31 juill. 2024	Volution Group Plc, swap sur rendement total	3 163	274
809	31 juill. 2024	Warpaint London Plc, swap sur rendement total	5 100	608

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
656	31 juill. 2024	Wetherspoon (J.D.) Plc, swap sur rendement total	8 937	1 341
48	31 juill. 2024	Wincanton Plc, swap sur rendement total	252	15
16	31 juill. 2024	Wizz Air Holdings Plc, swap sur rendement total	595	75
69	31 juill. 2024	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	1 573	161
1 018	31 juill. 2024	Xps Pensions Group Plc, swap sur rendement total	3 987	(59)
				60 423
Euro – taux à court terme (ESTR)				
211	31 juill. 2024	2G Energy Ag, swap sur rendement total	6 977	(6)
119	31 juill. 2024	Acs Actividades Cons Y Serv, swap sur rendement total	6 961	591
355	31 juill. 2024	Aedas Homes Sau, swap sur rendement total	9 421	482
50	31 juill. 2024	Aedifica, swap sur rendement total	4 636	385
1 066	31 juill. 2024	Air France-Klm, swap sur rendement total	21 105	2 954
110	31 juill. 2024	Akwel, swap sur rendement total	2 589	99
130	31 juill. 2024	Alma Media Corp, swap sur rendement total	1 818	120
2 395	31 juill. 2024	Alstom, swap sur rendement total	42 490	2 688
36	31 juill. 2024	Alten Sa, swap sur rendement total	7 058	458
1 810	31 juill. 2024	Applus Services Sa, swap sur rendement total	26 364	136
30	31 juill. 2024	Argan, swap sur rendement total	3 723	307
12 075	31 juill. 2024	Aroundtown Sa, swap sur rendement total	43 531	5 549
204	31 juill. 2024	Ascencio, swap sur rendement total	14 768	1 008
66	31 juill. 2024	Asm International Nv, swap sur rendement total	45 179	16
53	31 juill. 2024	Aspo Oyj, swap sur rendement total	462	(17)
150	31 juill. 2024	Assystem, swap sur rendement total	10 815	1 469
23	31 juill. 2024	Atoss Software Ag, swap sur rendement total	7 002	(215)
10	31 juill. 2024	Aurubis Ag, swap sur rendement total	1 082	(30)
760	31 juill. 2024	Auto1 Group Se, swap sur rendement total	7 182	1 050
166	31 juill. 2024	Axway Software Sa, swap sur rendement total	6 383	564
53 413	31 juill. 2024	Banco Comercial Portugues-R, swap sur rendement total	21 349	(1 573)
32 988	31 juill. 2024	Banco De Sabadell Sa, swap sur rendement total	53 480	(10 436)
476	31 juill. 2024	Barco N.V., swap sur rendement total	11 475	718
440	31 juill. 2024	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	30 750	24
513	31 juill. 2024	Be Semiconductor Industries, swap sur rendement total	101 960	1 859
129	31 juill. 2024	Bechtle Ag, swap sur rendement total	8 529	(23)
1 131	31 juill. 2024	Beneteau, swap sur rendement total	20 560	1 989
238	31 juill. 2024	Bertrandt Ag, swap sur rendement total	17 819	1 926
117	31 juill. 2024	Bijou Brigitte Modi Access, swap sur rendement total	6 834	(327)
377	31 juill. 2024	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	17 819	1 259
14 287	31 juill. 2024	Caixabank Sa, swap sur rendement total	77 539	(8 986)
26	31 juill. 2024	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	1 996	228
1 009	31 juill. 2024	Carrefour Sa, swap sur rendement total	24 346	(1 151)
501	31 juill. 2024	Ceconomy Ag, swap sur rendement total	1 807	187
2 483	31 juill. 2024	Cgg Sa, swap sur rendement total	2 163	(41)
422	31 juill. 2024	Cliq Digital Ag, swap sur rendement total	12 220	657
230	31 juill. 2024	Colruyt Sa, swap sur rendement total	13 669	39
407	31 juill. 2024	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	8 371	(12)
245	31 juill. 2024	Corp Acciona Energias Renova, swap sur rendement total	10 021	(61)
226	31 juill. 2024	Covestro Ag, swap sur rendement total	17 342	1 424
142	31 juill. 2024	Covivio, swap sur rendement total	10 069	766
99	31 juill. 2024	Crédit Agricole Sa, swap sur rendement total	1 853	82
173	31 juill. 2024	Dassault Aviation Sa, swap sur rendement total	45 157	(945)
1 364	31 juill. 2024	Decuninck Nv, swap sur rendement total	4 520	–
35	31 juill. 2024	Delivery Hero Se, swap sur rendement total	1 275	30
671	31 juill. 2024	Deutz Ag, swap sur rendement total	4 691	437
90	31 juill. 2024	D'Ieteren Sa/Nv, swap sur rendement total	23 190	2 595
284	31 juill. 2024	Duerr Ag, swap sur rendement total	8 844	435
509	31 juill. 2024	Econocom Group, swap sur rendement total	1 905	50
328	31 juill. 2024	Edreams Odigeo Sl, swap sur rendement total	3 664	421
285	31 juill. 2024	Elecnor Sa, swap sur rendement total	8 116	475
291	31 juill. 2024	Elior Group, swap sur rendement total	1 243	93
11	31 juill. 2024	Elmos Semiconductor Ag, swap sur rendement total	1 186	(87)
386	31 juill. 2024	Elringklinger Ag, swap sur rendement total	3 104	(195)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
729	31 juill. 2024	Enagas Sa, swap sur rendement total	16 209	(337)
128	31 juill. 2024	Esker Sa, swap sur rendement total	29 756	2 172
138	31 juill. 2024	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	11 856	994
56	31 juill. 2024	Euronext Nv, swap sur rendement total	6 415	173
136	31 juill. 2024	Evs Broadcast Equipment S.A., swap sur rendement total	5 715	117
1 020	31 juill. 2024	Flatex Ag, swap sur rendement total	16 596	669
265	31 juill. 2024	Fomento De Construc Y Contra, swap sur rendement total	5 620	711
375	31 juill. 2024	Forvia, swap sur rendement total	11 154	1 007
1 004	31 juill. 2024	F-Secure Corp, swap sur rendement total	2 976	281
320	31 juill. 2024	Fugro Nv-Cva, swap sur rendement total	8 082	216
12	31 juill. 2024	Gerresheimer Ag, swap sur rendement total	1 649	123
6	31 juill. 2024	Gesco Ag, swap sur rendement total	163	(4)
7 105	31 juill. 2024	Gestamp Automocion Sa, swap sur rendement total	36 305	(438)
11	31 juill. 2024	Grand City Properties, swap sur rendement total	163	17
27	31 juill. 2024	Groupe Guillin, swap sur rendement total	1 215	30
809	31 juill. 2024	Grupo Catalana Occidente Sa, swap sur rendement total	36 412	(1 335)
3 067	31 juill. 2024	Heidelberger Druckmaschinen, swap sur rendement total	5 535	(100)
34	31 juill. 2024	Immofinanz Ag, swap sur rendement total	1 042	102
757	31 juill. 2024	Indra Sistemas Sa, swap sur rendement total	15 437	96
682	31 juill. 2024	Industria De Diseno Textil, swap sur rendement total	39 170	821
416	31 juill. 2024	Infineon Technologies Ag, swap sur rendement total	22 905	(442)
2 566	31 juill. 2024	Inmobiliaria Colonial Socimi, swap sur rendement total	24 481	160
26	31 juill. 2024	Ion Beam Applications, swap sur rendement total	437	23
177	31 juill. 2024	Jacquet Métal Service Sa, swap sur rendement total	5 053	326
168	31 juill. 2024	K+S Ag, actions ord., swap sur rendement total	3 502	141
65	31 juill. 2024	Kering, swap sur rendement total	37 777	366
798	31 juill. 2024	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	91 129	5 035
544	31 juill. 2024	Kion Group Ag, swap sur rendement total	30 642	4 085
149	31 juill. 2024	Klepierre, swap sur rendement total	5 356	288
100	31 juill. 2024	KloECKner & Co Se, swap sur rendement total	1 001	88
100	31 juill. 2024	Koenig & Bauer Ag, swap sur rendement total	1 762	97
392	31 juill. 2024	Kojamo Oyj, swap sur rendement total	6 795	627
115	31 juill. 2024	Konecranes Oyj, swap sur rendement total	6 831	716
1 289	31 juill. 2024	Koninklijke Bam Groep Nv, swap sur rendement total	4 540	(182)
15 415	31 juill. 2024	Koninklijke Kpn Nv, swap sur rendement total	70 010	(788)
2 717	31 juill. 2024	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	83 445	8 948
35	31 juill. 2024	Ksb Se & Co Kгаа-Vorzug, swap sur rendement total	29 671	1 451
178	31 juill. 2024	Lanxess Ag, swap sur rendement total	7 356	1 473
1 317	31 juill. 2024	Lar Espana Real Estate Socim, swap sur rendement total	11 798	70
17	31 juill. 2024	Leg Immobilien Ag, swap sur rendement total	1 964	165
132	31 juill. 2024	Legrand Sa, swap sur rendement total	18 093	729
245	31 juill. 2024	Lisi, swap sur rendement total	8 422	404
3 905	31 juill. 2024	Mapfre Sa, swap sur rendement total	11 052	(385)
1 897	31 juill. 2024	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	16 828	(991)
100	31 juill. 2024	Mensch Und Maschine Software, swap sur rendement total	8 011	245
1 351	31 juill. 2024	Merlin Properties Socimi Sa, swap sur rendement total	19 797	781
87	31 juill. 2024	Mersen, swap sur rendement total	4 461	213
467	31 juill. 2024	Metso Oyj, swap sur rendement total	6 238	75
646	31 juill. 2024	Mlp Se, swap sur rendement total	5 213	477
235	31 juill. 2024	Morphosys Ag, swap sur rendement total	11 638	2 305
11 323	31 juill. 2024	Mota Engil Sgps Sa, swap sur rendement total	65 312	3 613
28	31 juill. 2024	Nexans Sa, swap sur rendement total	3 232	261
380	31 juill. 2024	Nextensa, swap sur rendement total	27 039	(801)
174	31 juill. 2024	Noho Partners Oyj, swap sur rendement total	2 190	274
903	31 juill. 2024	Nordex Se, swap sur rendement total	13 679	285
931	31 juill. 2024	Northern Data Ag, swap sur rendement total	35 665	1 933
859	31 juill. 2024	Obrascon Huarte Lain S.A., swap sur rendement total	563	(29)
2 280	31 juill. 2024	Ontex Group Nv, swap sur rendement total	25 256	1 861
2 771	31 juill. 2024	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	13 885	(141)
4 678	31 juill. 2024	Outokumpu Oyj, swap sur rendement total	30 554	836
396	31 juill. 2024	Palfinger Ag, swap sur rendement total	14 536	756

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L) Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
357	31 juill. 2024	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	884	10
110	31 juill. 2024	Porr Ag, swap sur rendement total	2 035	75
1 265	31 juill. 2024	Postnl Nv, swap sur rendement total	2 604	(57)
5 313	31 juill. 2024	Prosegur Cash Sa, swap sur rendement total	4 156	96
111	31 juill. 2024	Prosiebensat.1 Media Se, swap sur rendement total	895	(38)
772	31 juill. 2024	Proximus, swap sur rendement total	9 569	(471)
2 060	31 juill. 2024	Pva Tepla Ag, swap sur rendement total	61 212	2 894
5	31 juill. 2024	Qt Group Oyj, swap sur rendement total	470	10
1 020	31 juill. 2024	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	27 738	4 921
782	31 juill. 2024	Red Electrica Corporacion Sa, swap sur rendement total	16 983	(622)
31	31 juill. 2024	Redcare Pharmacy Nv, swap sur rendement total	5 942	76
66	31 juill. 2024	Retail Estates, swap sur rendement total	6 210	137
1 749	31 juill. 2024	Sacyr Sa, swap sur rendement total	7 964	100
1 513	31 juill. 2024	Saf-Holland Sa, swap sur rendement total	33 498	738
829	31 juill. 2024	Salzgitter Ag, swap sur rendement total	33 810	643
46	31 juill. 2024	Sanoma Oyj, swap sur rendement total	466	1
266	31 juill. 2024	Scanfil Oyj, swap sur rendement total	3 034	(72)
3 070	31 juill. 2024	Schaeffler Ag, actions priv., swap sur rendement total	25 019	2 261
610	31 juill. 2024	Semapa-Sociedade De Investim, swap sur rendement total	11 906	(139)
57	31 juill. 2024	Ses Imagotag, swap sur rendement total	11 275	2 479
355	31 juill. 2024	Sgl Carbon Se, swap sur rendement total	3 366	219
5 167	31 juill. 2024	Siemens Energy Ag	90 314	8 088
71	31 juill. 2024	Siltronic Ag, swap sur rendement total	9 147	134
296	31 juill. 2024	Sma Solar Technology Ag, swap sur rendement total	26 106	2 033
86	31 juill. 2024	Solaria Energia Y Medio Ambi, swap sur rendement total	2 331	23
226	31 juill. 2024	Solvay Sa, swap sur rendement total	9 128	196
69	31 juill. 2024	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	19 880	787
2	31 juill. 2024	Sto Se & Co. Kгаа, actions priv., swap sur rendement total	407	52
143	31 juill. 2024	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	5 770	218
82	31 juill. 2024	Sword Group, swap sur rendement total	4 760	288
394	31 juill. 2024	Tag Immobilien Ag, swap sur rendement total	7 573	313
44	31 juill. 2024	Talanx Ag, swap sur rendement total	4 143	(304)
1 129	31 juill. 2024	Teamviewer Ag, swap sur rendement total	23 122	1 202
10	31 juill. 2024	Teleperformance, swap sur rendement total	1 923	(26)
34	31 juill. 2024	Thermador Groupe, swap sur rendement total	4 185	380
9 900	31 juill. 2024	Thyssenkrupp Ag, swap sur rendement total	91 021	(8 922)
873	31 juill. 2024	Tomtom, swap sur rendement total	8 119	356
2 476	31 juill. 2024	Tubacex Sa, swap sur rendement total	12 623	417
426	31 juill. 2024	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	14 340	(1 918)
141	31 juill. 2024	Ucb Sa, swap sur rendement total	16 204	1 153
8 031	31 juill. 2024	Unicaja Banco Sa, swap sur rendement total	10 411	(1 540)
25	31 juill. 2024	United Internet Ag, actions ord., swap sur rendement total	839	84
100	31 juill. 2024	Vaisala Oyj, actions, A, swap sur rendement total	5 783	480
3 412	31 juill. 2024	Valeo Sa, swap sur rendement total	69 156	2 976
665	31 juill. 2024	Vallourec Sa, swap sur rendement total	13 585	396
737	31 juill. 2024	Valmet Oyj, swap sur rendement total	28 029	1 567
346	31 juill. 2024	Veolia Environnement, swap sur rendement total	14 394	(226)
271	31 juill. 2024	Verallia, swap sur rendement total	13 761	821
60	31 juill. 2024	Vgp, swap sur rendement total	9 177	508
200	31 juill. 2024	Vicat, swap sur rendement total	9 570	(58)
165	31 juill. 2024	Vienna Insurance Group Ag, swap sur rendement total	6 369	40
315	31 juill. 2024	Vitesco Technologies Group A, swap sur rendement total	35 880	(7 161)
1 321	31 juill. 2024	Voestalpine Ag, swap sur rendement total	54 954	5 024
367	31 juill. 2024	Volkswagen Ag, actions priv., swap sur rendement total	59 765	903
648	31 juill. 2024	Vopak, swap sur rendement total	28 731	(1 093)
42	31 juill. 2024	Wacker Chemie Ag, swap sur rendement total	6 993	77
93	31 juill. 2024	Wacker Neuson Se, swap sur rendement total	2 474	146
2 056	31 juill. 2024	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	39 306	1 268
1 427	31 juill. 2024	Wienerberger Ag, swap sur rendement total	62 814	8 233
736	31 juill. 2024	Worldline Sa, swap sur rendement total	16 799	1 381
1 156	31 juill. 2024	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	17 141	(594)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L) Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
70	31 juill. 2024	Zumtobel Group Ag, swap sur rendement total	640	(5)
				<u>81 086</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
1 000	31 juill. 2024	Aac Technologies Holdings In, swap sur rendement total	3 918	185
5 000	31 juill. 2024	Ane Cayman Inc, swap sur rendement total	4 720	(709)
5 000	31 juill. 2024	Beijing Urban Construction, H, swap sur rendement total	1 672	21
4 500	31 juill. 2024	Chaoju Eye Care Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 359	(74)
68 000	31 juill. 2024	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	15 502	(971)
10 000	31 juill. 2024	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	10 791	147
10 000	31 juill. 2024	China Nonferrous Mining Corp, swap sur rendement total	8 663	652
7 800	31 juill. 2024	China Pacific Insurance Gr, H, swap sur rendement total	20 758	(1 048)
84 000	31 juill. 2024	China Youzan Ltd, swap sur rendement total	2 043	522
4 500	31 juill. 2024	Cime Vehicles Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	5 266	7
4 000	31 juill. 2024	Country Garden Services Hold, swap sur rendement total	4 559	170
1 000	31 juill. 2024	Cowell E Holdings Inc, swap sur rendement total	3 892	557
6 000	31 juill. 2024	Dongyue Group, swap sur rendement total	5 725	(290)
22 000	31 juill. 2024	Far East Horizon Ltd, swap sur rendement total	22 810	2 014
5 000	31 juill. 2024	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	3 656	142
4 000	31 juill. 2024	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	5 802	39
8 500	31 juill. 2024	Great Wall Motor Company, H, swap sur rendement total	14 555	(1 655)
500	31 juill. 2024	Greentown China Holdings, swap sur rendement total	671	(31)
16 000	31 juill. 2024	Guangzhou Automobile Group, H, swap sur rendement total	9 808	(7)
22 000	31 juill. 2024	Haitong Unitrust Internati, H, swap sur rendement total	3 046	101
500	31 juill. 2024	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	312	24
100	31 juill. 2024	Hong Kong Exchanges & Clear, swap sur rendement total	4 526	(170)
815	31 juill. 2024	Horizon Construction Develop, swap sur rendement total	632	632
4 000	31 juill. 2024	Huaneng Power Intl Inc, H, swap sur rendement total	2 796	39
49 000	31 juill. 2024	Inke Ltd, swap sur rendement total	6 868	(190)
1 000	31 juill. 2024	Innovent Biologics Inc, swap sur rendement total	7 219	(235)
34 000	31 juill. 2024	International Alliance Finan, swap sur rendement total	6 430	(454)
900	31 juill. 2024	Ke Holdings Inc, cat. A, swap sur rendement total	6 581	311
11 000	31 juill. 2024	Longfor Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	23 873	(1 198)
6 000	31 juill. 2024	Petrochina Co Ltd, H, swap sur rendement total	5 228	11
48 000	31 juill. 2024	Sinopec Oilfield Service, H, swap sur rendement total	3 931	(147)
2 000	31 juill. 2024	Sunny Optical Tech, swap sur rendement total	23 928	(20)
2 000	31 juill. 2024	Techtronic Industries Co Ltd, swap sur rendement total	31 426	4 141
2 100	31 juill. 2024	Television Broadcasts Ltd, swap sur rendement total	1 121	(57)
220 000	31 juill. 2024	Tongda Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 827	(727)
2 000	31 juill. 2024	United Energy Group Ltd, swap sur rendement total	287	33
2 000	31 juill. 2024	Weichai Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	4 404	(267)
4 000	31 juill. 2024	Zengame Technology Holding, swap sur rendement total	3 823	1 113
				<u>2 611</u>
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
2 262	31 juill. 2024	Advtech Ltd, swap sur rendement total	4 002	(22)
4 055	31 juill. 2024	Aeci Ltd, swap sur rendement total	32 071	1 653
1 215	31 juill. 2024	Afrimat Ltd, swap sur rendement total	5 519	545
1 245	31 juill. 2024	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	592	73
1 260	31 juill. 2024	Allied Electronics Cor, actions, A, swap sur rendement total	931	36
8 754	31 juill. 2024	Arcelormittal South Africa, swap sur rendement total	1 035	261
31 821	31 juill. 2024	Arrowhead Properties Ltd, B, swap sur rendement total	7 893	(79)
1 974	31 juill. 2024	Barloworld Ltd, swap sur rendement total	11 244	332
126	31 juill. 2024	Bidvest Group Ltd, swap sur rendement total	2 292	142
279	31 juill. 2024	Cashbuild Ltd, swap sur rendement total	3 358	(40)
2 208	31 juill. 2024	Coronation Fund Managers Ltd, swap sur rendement total	4 961	(95)
1 255	31 juill. 2024	Datatec Ltd, swap sur rendement total	3 665	479
412	31 juill. 2024	Discovery Ltd, swap sur rendement total	4 268	290
467	31 juill. 2024	Exxaro Resources Ltd, swap sur rendement total	6 885	525
214	31 juill. 2024	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	3 126	131
245	31 juill. 2024	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	2 838	(61)
123	31 juill. 2024	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	809	140
6 160	31 juill. 2024	Jse Ltd, swap sur rendement total	41 058	1 607

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 581	31 juill. 2024	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	4 902	145
11 808	31 juill. 2024	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	1 107	71
17 961	31 juill. 2024	Outsurance Group Ltd, swap sur rendement total	54 652	566
5 650	31 juill. 2024	Ppc Ltd, swap sur rendement total	1 625	130
5 127	31 juill. 2024	Raubex Group Ltd, swap sur rendement total	10 247	463
309	31 juill. 2024	Sanlam Ltd, swap sur rendement total	1 622	99
432	31 juill. 2024	Santam Ltd, swap sur rendement total	8 926	(179)
1 021	31 juill. 2024	Sappi Limited, swap sur rendement total	3 254	326
2 477	31 juill. 2024	Southern Sun Ltd, swap sur rendement total	938	13
2 594	31 juill. 2024	Sun International Ltd, swap sur rendement total	7 669	164
7 317	31 juill. 2024	Super Group Ltd, swap sur rendement total	15 696	276
565	31 juill. 2024	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	6 266	351
8 183	31 juill. 2024	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	7 228	(16)
				8 326
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
58	31 juill. 2024	Addlife Ab, B, swap sur rendement total	830	62
33	31 juill. 2024	Afry Ab, swap sur rendement total	603	52
200	31 juill. 2024	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	2 148	61
4 944	31 juill. 2024	Alleima Ab, swap sur rendement total	49 564	329
264	31 juill. 2024	Alligo Ab, B, swap sur rendement total	4 283	513
2 054	31 juill. 2024	Ambea Ab, swap sur rendement total	14 136	2 057
200	31 juill. 2024	Aq Group Ab, swap sur rendement total	13 267	336
108	31 juill. 2024	Arise Ab, swap sur rendement total	642	74
44	31 juill. 2024	Arjo Ab, actions, B, swap sur rendement total	227	10
3 734	31 juill. 2024	Attendo Ab, swap sur rendement total	17 637	586
403	31 juill. 2024	Bergman & Beving Aktiebolag, swap sur rendement total	9 681	505
17	31 juill. 2024	Better Collective A/S, swap sur rendement total	571	39
96	31 juill. 2024	Biotage Ab, swap sur rendement total	1 679	63
333	31 juill. 2024	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	8 200	568
182	31 juill. 2024	Bufab Ab, swap sur rendement total	9 201	1 161
362	31 juill. 2024	Bulten Ab, swap sur rendement total	3 789	705
194	31 juill. 2024	Camurus Ab, swap sur rendement total	13 656	1 462
494	31 juill. 2024	Clas Ohlson Ab, actions, B, swap sur rendement total	10 212	1 916
54	31 juill. 2024	Eastnine Ab, swap sur rendement total	1 215	78
163	31 juill. 2024	Elekta Ab, actions, B, swap sur rendement total	1 756	6
77	31 juill. 2024	Fabege Ab, swap sur rendement total	1 090	103
388	31 juill. 2024	Fagerhult Ab, swap sur rendement total	3 351	75
5 368	31 juill. 2024	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	124 050	5 245
113	31 juill. 2024	Humana Ab, swap sur rendement total	416	12
50	31 juill. 2024	Inwido Ab, swap sur rendement total	884	33
1	31 juill. 2024	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	18	2
46	31 juill. 2024	Lindab International Ab, swap sur rendement total	1 198	41
258	31 juill. 2024	Modern Times Group, actions, B, swap sur rendement total	2 908	37
322	31 juill. 2024	Munters Group Ab, swap sur rendement total	6 888	693
1 037	31 juill. 2024	Mycronic Ab, swap sur rendement total	38 995	6 521
1 620	31 juill. 2024	Ncab Group Ab, swap sur rendement total	15 526	1 621
899	31 juill. 2024	Nordic Paper Holding Ab, swap sur rendement total	5 252	311
33	31 juill. 2024	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	1 006	141
424	31 juill. 2024	Paradox Interactive Ab, swap sur rendement total	12 504	817
344	31 juill. 2024	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	4 231	264
444	31 juill. 2024	Rvrc Holding Ab, swap sur rendement total	3 500	370
13	31 juill. 2024	Sdipitech A, B, swap sur rendement total	459	51
141	31 juill. 2024	Sensys Gatsco Group Ab, swap sur rendement total	1 340	(142)
936	31 juill. 2024	Tobii Ab, swap sur rendement total	721	(163)
453	31 juill. 2024	Tobii Dynavox Ab, swap sur rendement total	2 495	131
				26 746
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
30	31 juill. 2024	Allreal Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	7 069	238
23	31 juill. 2024	Also Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	9 044	186
65	31 juill. 2024	Apg Sga Sa, swap sur rendement total	18 636	968
478	31 juill. 2024	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	6 156	(986)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
154	31 juill. 2024	Banque Cantonale Vaudois, actions ord., swap sur rendement total	26 178	369
37	31 juill. 2024	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	13 680	99
15	31 juill. 2024	Bkw Ag, swap sur rendement total	3 513	(92)
52	31 juill. 2024	Burckhardt Compression Holdi, swap sur rendement total	41 304	1 407
18	31 juill. 2024	Burkhalter Holding Ag, swap sur rendement total	2 614	59
190	31 juill. 2024	Cembra Money Bank Ag, swap sur rendement total	19 527	224
1	31 juill. 2024	Dormakaba Holding Ag, swap sur rendement total	711	2
1	31 juill. 2024	Ems-Chemie Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 067	93
1	31 juill. 2024	Forbo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 651	94
193	31 juill. 2024	Implenia Ag, actions ord., swap sur rendement total	9 222	510
1	31 juill. 2024	Intershop Holding Ag, swap sur rendement total	964	4
116	31 juill. 2024	Investis Holding Sa, swap sur rendement total	17 737	634
23	31 juill. 2024	Jungfraubahn Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	5 765	16
32	31 juill. 2024	Landis+Gyr Group Ag, swap sur rendement total	3 810	65
102	31 juill. 2024	Lastminute.Com Nv, swap sur rendement total	3 723	17
56	31 juill. 2024	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	6 998	(38)
118	31 juill. 2024	Meier Tobler Group Ag, swap sur rendement total	6 831	78
156	31 juill. 2024	Montana Aerospace Ag, swap sur rendement total	4 316	385
13	31 juill. 2024	Orior Ag, swap sur rendement total	1 468	(12)
315	31 juill. 2024	Psp Swiss Property Ag, actions ord., swap sur rendement total	58 036	1 048
1	31 juill. 2024	Siegfried Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 347	88
2	31 juill. 2024	St Galler Kantonalbank A, actions ord., swap sur rendement total	1 540	25
94	31 juill. 2024	Sulzer Ag, actions ord., swap sur rendement total	12 650	(130)
273	31 juill. 2024	Swiss Prime Site, actions ord., swap sur rendement total	38 429	743
15	31 juill. 2024	Swissquote Group Holding, actions ord., swap sur rendement total	4 808	147
63	31 juill. 2024	Temenos Ag, actions ord., swap sur rendement total	7 720	296
48	31 juill. 2024	Thurgauer Kantonalbank, certificat, swap sur rendement total	8 986	(237)
13	31 juill. 2024	Tx Group Ag, swap sur rendement total	2 460	373
100	31 juill. 2024	U-Blox Holding Ag, swap sur rendement total	15 651	1 132
191	31 juill. 2024	Varia Us Properties Ag, swap sur rendement total	11 371	255
43	31 juill. 2024	Vz Holding Ag, swap sur rendement total	6 615	234
				<u>8 294</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
262	31 juill. 2024	Perdoceo Education Corp, swap sur rendement total	6 067	(11)
2 122	31 juill. 2024	111 Inc, swap sur rendement total	4 337	(1 270)
24	31 juill. 2024	3M Co, swap sur rendement total	3 460	300
142	31 juill. 2024	8X8 Inc, swap sur rendement total	708	127
189	31 juill. 2024	Acadia Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	7 803	2 112
1 000	31 juill. 2024	Acetion Technology Corp, swap sur rendement total	22 548	63
193	31 juill. 2024	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	402	53
2 000	31 juill. 2024	Acter Group Corp Ltd, swap sur rendement total	15 305	(8)
337	31 juill. 2024	Actoz Soft Co Ltd, swap sur rendement total	2 994	(356)
57	31 juill. 2024	Acuity Brands Inc, swap sur rendement total	15 395	1 870
3 559	31 juill. 2024	Adecoagro Sa, swap sur rendement total	52 091	(1 775)
198	31 juill. 2024	Adt Inc, swap sur rendement total	1 790	247
561	31 juill. 2024	Advanced Micro Devices, swap sur rendement total	109 044	18 325
78	31 juill. 2024	Aercap Holdings Nv, swap sur rendement total	7 644	121
794	31 juill. 2024	Aes Corp, swap sur rendement total	20 154	1 182
45	31 juill. 2024	Aflac Inc, swap sur rendement total	4 895	6
21	31 juill. 2024	Agco Corp, swap sur rendement total	3 362	136
414	31 juill. 2024	Air Lease Corp, swap sur rendement total	23 010	1 600
211	31 juill. 2024	Alarm.Com Holdings Inc, swap sur rendement total	17 979	2 759
1 853	31 juill. 2024	Alignment Healthcare Inc, swap sur rendement total	21 037	2 641
189	31 juill. 2024	Alior Bank Sa, swap sur rendement total	4 835	(5)
335	31 juill. 2024	Allbirds Inc, cat. A, swap sur rendement total	541	140
1 000	31 juill. 2024	Alltop Technology Co Ltd, swap sur rendement total	8 278	436
77	31 juill. 2024	Alphabet Inc, cat. C, swap sur rendement total	14 309	(31)
311	31 juill. 2024	Alphatec Holdings Inc, swap sur rendement total	6 196	1 252
26	31 juill. 2024	Altair Engineering Inc, A, swap sur rendement total	2 885	391
14	31 juill. 2024	A-Mark Precious Metals Inc, swap sur rendement total	558	14
34	31 juill. 2024	Ambarella Inc, swap sur rendement total	2 748	101

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
48	31 juill. 2024	Ameren Corporation, swap sur rendement total	4 579	(223)
553	31 juill. 2024	American Eagle Outfitters, swap sur rendement total	15 430	415
119	31 juill. 2024	American Superconductor Corp, swap sur rendement total	1 748	238
73	31 juill. 2024	Amn Healthcare Services Inc, swap sur rendement total	7 208	641
158	31 juill. 2024	Anneal Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	1 265	363
86	31 juill. 2024	Amphastar Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	7 014	530
1 804	31 juill. 2024	Amylyx Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	35 015	1 207
118	31 juill. 2024	Anapass Inc, swap sur rendement total	2 585	14
31	31 juill. 2024	Angiodynamics Inc, swap sur rendement total	320	53
1 900	31 juill. 2024	Anhui Kouzi Distillery Co, A, swap sur rendement total	15 985	208
50	31 juill. 2024	Antarchile Sa, swap sur rendement total	532	(35)
36	31 juill. 2024	Anywhere Real Estate Inc, swap sur rendement total	385	55
502	31 juill. 2024	Apple Inc, swap sur rendement total	127 443	(910)
142	31 juill. 2024	Aramark, swap sur rendement total	5 261	58
16	31 juill. 2024	Arcellx Inc, swap sur rendement total	1 171	43
2 637	31 juill. 2024	Arcos Dorados Holdings Inc, A, swap sur rendement total	44 125	2 703
133	31 juill. 2024	Arcturus Therapeutics Holdin, swap sur rendement total	5 530	1 299
658	31 juill. 2024	Ardmore Shipping Corp, swap sur rendement total	12 225	(149)
738	31 juill. 2024	Arlo Technologies Inc, swap sur rendement total	9 264	156
59	31 juill. 2024	Arrow Electronics Inc, swap sur rendement total	9 511	81
32	31 juill. 2024	Ashland Global Holdings Inc, swap sur rendement total	3 557	64
97	31 juill. 2024	Asia Paper Manufacturing Co, swap sur rendement total	4 086	26
1 000	31 juill. 2024	Asia Tech Image Inc, swap sur rendement total	2 871	21
812	31 juill. 2024	At&T Inc, swap sur rendement total	17 966	269
142	31 juill. 2024	Ataa Educational Co, swap sur rendement total	3 605	(52)
243	31 juill. 2024	Atlassian Corp Plc, cat. A, swap sur rendement total	76 215	14 754
1 000	31 juill. 2024	Aurora Corp, swap sur rendement total	3 277	100
118	31 juill. 2024	Autonation Inc, swap sur rendement total	23 367	2 237
90	31 juill. 2024	Avepoint Inc, swap sur rendement total	974	-
22	31 juill. 2024	Axcelis Technologies Inc, swap sur rendement total	3 762	115
284	31 juill. 2024	Axogen Inc, swap sur rendement total	2 558	96
9	31 juill. 2024	Axsome Therapeutics Inc, swap sur rendement total	945	99
188	31 juill. 2024	Backblaze Inc, A, swap sur rendement total	1 882	(9)
1 117	31 juill. 2024	Baker Hughes A Ge Co, swap sur rendement total	50 343	270
800	31 juill. 2024	Banco Btg Pactual Sa, parts, swap sur rendement total	8 176	687
149	31 juill. 2024	Bank Millennium Sa, swap sur rendement total	417	17
14	31 juill. 2024	Bank Ozk, swap sur rendement total	920	6
2 800	31 juill. 2024	Barito Pacific Tbk Pt, swap sur rendement total	319	(42)
30	31 juill. 2024	Barnes Group Inc, swap sur rendement total	1 291	243
357	31 juill. 2024	Baxter International Inc, swap sur rendement total	18 335	1 163
34	31 juill. 2024	Beigene Ltd, CAAE, swap sur rendement total	8 086	(32)
300	31 juill. 2024	Beijing Yanjing Brewery Co, A, swap sur rendement total	481	(59)
8 900	31 juill. 2024	Beingmate Co Ltd, A, swap sur rendement total	6 529	(590)
17	31 juill. 2024	Benchmark Electronics Inc, swap sur rendement total	623	60
24	31 juill. 2024	Benefit Systems Sa, swap sur rendement total	15 684	496
97	31 juill. 2024	Berkshire Hathaway Inc, cat. B, swap sur rendement total	45 618	(592)
136	31 juill. 2024	Best Buy Co Inc, swap sur rendement total	14 203	567
84	31 juill. 2024	Big Lots Inc, swap sur rendement total	863	210
304	31 juill. 2024	Biocryst Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	2 401	28
24	31 juill. 2024	Biomea Fusion Inc, swap sur rendement total	460	4
60	31 juill. 2024	Black Hills Corp, swap sur rendement total	4 268	140
224	31 juill. 2024	Bloom Energy Corp, A, swap sur rendement total	4 371	196
27	31 juill. 2024	Blue Bird Corp, swap sur rendement total	960	205
8	31 juill. 2024	Blueprint Medicines Corp, swap sur rendement total	973	64
17	31 juill. 2024	Boise Cascade Co, swap sur rendement total	2 900	99
32	31 juill. 2024	Borgwarner Inc, swap sur rendement total	1 513	85
9	31 juill. 2024	Boston Beer Company Inc, A, swap sur rendement total	4 101	(152)
1 456	31 juill. 2024	Box Inc, cat. A, swap sur rendement total	49 168	558
100	31 juill. 2024	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	594	92
59	31 juill. 2024	Bread Financial Holdings Inc, swap sur rendement total	2 563	312
100	31 juill. 2024	Brf Sa, swap sur rendement total	375	4

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
9	31 juill. 2024	Bright Horizons Family Solut, swap sur rendement total	1 118	37
218	31 juill. 2024	Bristol-Myers Squibb Co, swap sur rendement total	14 749	392
144	31 juill. 2024	Brookdale Senior Living Inc, swap sur rendement total	1 105	95
25	31 juill. 2024	Bruker Corp, swap sur rendement total	2 422	253
73	31 juill. 2024	Builders Firstsource Inc, swap sur rendement total	16 069	384
1 484	31 juill. 2024	Byucksan Corporation, swap sur rendement total	3 978	(225)
72	31 juill. 2024	C.H. Robinson Worldwide Inc, swap sur rendement total	8 260	413
118	31 juill. 2024	Calix Inc, swap sur rendement total	6 798	329
201	31 juill. 2024	Cap Sa, swap sur rendement total	2 184	315
4 000	31 juill. 2024	Capital Futures Corp, swap sur rendement total	8 812	569
36	31 juill. 2024	Capri Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 385	77
32	31 juill. 2024	Cardinal Health Inc, swap sur rendement total	4 274	1
1 228	31 juill. 2024	Carmax Inc, swap sur rendement total	124 261	19 794
100	31 juill. 2024	Carnival Corp, swap sur rendement total	2 445	(33)
455	31 juill. 2024	Carrols Restaurant Group Inc, swap sur rendement total	4 728	181
26	31 juill. 2024	Castle Biosciences Inc, swap sur rendement total	740	52
424	31 juill. 2024	Cato Corp, cat. A, swap sur rendement total	4 087	203
23	31 juill. 2024	Celldex Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 203	273
467	31 juill. 2024	Cellebrite Di Ltd, swap sur rendement total	5 333	110
1 680	31 juill. 2024	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	1 692	359
5 659	31 juill. 2024	Cementos Argos Sa	11 766	1 464
369	31 juill. 2024	Cencora Inc, swap sur rendement total	99 930	1 622
187	31 juill. 2024	Central Garden And Pet Co, A, swap sur rendement total	10 859	1 876
300	31 juill. 2024	Central Pattana Pub Co Ltd, swap sur rendement total	805	39
15	31 juill. 2024	Cerence Inc, swap sur rendement total	389	45
282	31 juill. 2024	Chegg Inc, swap sur rendement total	4 224	518
6 000	31 juill. 2024	Cheng Shin Rubber Ind Co Ltd, swap sur rendement total	11 615	336
457	31 juill. 2024	Chevron Corp, swap sur rendement total	89 884	2 201
2 298	31 juill. 2024	China Automotive Systems Inc, swap sur rendement total	9 787	(1 315)
1 300	31 juill. 2024	China Coal Xinji Energy Co, A, swap sur rendement total	1 272	4
3 712	31 juill. 2024	China Crystal New Material, H, swap sur rendement total	5 876	(171)
405	31 juill. 2024	China Yuchai Intl Ltd, swap sur rendement total	4 475	(409)
1 066	31 juill. 2024	Chromadex Corp, swap sur rendement total	2 010	56
144	31 juill. 2024	Cia Brasileira De Dis, CAAE, swap sur rendement total	152	29
500	31 juill. 2024	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	552	102
900	31 juill. 2024	Cia De Saneamento Do Pa, parts, swap sur rendement total	7 139	738
11 100	31 juill. 2024	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	62 455	5 742
11 121	31 juill. 2024	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	908	51
6 300	31 juill. 2024	Cielo Sa, swap sur rendement total	8 029	1 206
539	31 juill. 2024	Cirrus Logic Inc, swap sur rendement total	59 125	2 588
384	31 juill. 2024	Cleantech Inc, swap sur rendement total	5 585	(144)
298	31 juill. 2024	Clear Secure Inc, cat. A, swap sur rendement total	8 114	(298)
520	31 juill. 2024	Clearwater Analytics Hds, A, swap sur rendement total	13 734	(843)
85	31 juill. 2024	Clearwater Paper Corp, swap sur rendement total	4 048	65
448	31 juill. 2024	Clover Health Investments Co, swap sur rendement total	562	16
250	31 juill. 2024	Cnx Resources Corp, swap sur rendement total	6 593	(161)
605	31 juill. 2024	Coasia Corp, swap sur rendement total	4 622	(11)
5 500	31 juill. 2024	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	5 216	411
16	31 juill. 2024	Cohu Inc, swap sur rendement total	747	74
327	31 juill. 2024	Coinbase Global Inc, cat. A, swap sur rendement total	74 991	18 211
10	31 juill. 2024	Comfort Systems Usa Inc, swap sur rendement total	2 712	158
15	31 juill. 2024	Commerce Bancshares Inc, swap sur rendement total	1 056	82
41	31 juill. 2024	Computer Programs & Systems, swap sur rendement total	606	35
3 500	31 juill. 2024	Concentradora Fibra Danhos S, swap sur rendement total	5 697	536
468	31 juill. 2024	Concrete Pumping Holdings In, swap sur rendement total	5 060	433
8	31 juill. 2024	Conmed Corp, swap sur rendement total	1 157	20
171	31 juill. 2024	Consensus Cloud Solution, swap sur rendement total	5 910	1 740
900	31 juill. 2024	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	3 627	287
61	31 juill. 2024	Corcept Therapeutics Inc, swap sur rendement total	2 613	556
294	31 juill. 2024	Corning Inc, swap sur rendement total	11 805	298
1 371	31 juill. 2024	Corp America Airports Sa, swap sur rendement total	29 033	1 971

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
66	31 juill. 2024	Cosmecca Korea Co Ltd, swap sur rendement total	2 447	(83)
70	31 juill. 2024	Costamare Inc, swap sur rendement total	961	9
85	31 juill. 2024	Couchbase Inc, swap sur rendement total	2 524	314
74	31 juill. 2024	Cpi Card Group Inc, swap sur rendement total	1 872	130
43	31 juill. 2024	Crawford & Company, cat. A, swap sur rendement total	747	108
19	31 juill. 2024	Crowdstrike Holdings Inc, A, swap sur rendement total	6 397	381
6 400	31 juill. 2024	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	9 217	1 344
41	31 juill. 2024	Cryoport Inc, swap sur rendement total	837	22
42	31 juill. 2024	Csg Systems Intl Inc, swap sur rendement total	2 947	125
1 200	31 juill. 2024	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	6 382	312
7	31 juill. 2024	Cummins Inc, swap sur rendement total	2 211	(7)
616	31 juill. 2024	Custom Truck One Source Inc, swap sur rendement total	5 020	282
108	31 juill. 2024	Cyberark Software Ltd/Israel, swap sur rendement total	31 195	2 709
137	31 juill. 2024	Cytokinetics Inc, swap sur rendement total	15 082	7 685
42	31 juill. 2024	Daesang Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	572	22
272	31 juill. 2024	Db Inc, swap sur rendement total	481	(3)
167	31 juill. 2024	Deciphera Pharmaceuticals In, swap sur rendement total	3 552	610
248	31 juill. 2024	Deluxe Corp, swap sur rendement total	7 014	890
4 087	31 juill. 2024	Develia Sa, swap sur rendement total	6 218	(379)
600	31 juill. 2024	Dexxos Participacoes Sa, On, swap sur rendement total	1 895	31
12	31 juill. 2024	Diamondback Energy Inc, swap sur rendement total	2 454	(9)
1 151	31 juill. 2024	Docusign Inc, swap sur rendement total	90 228	11 048
948	31 juill. 2024	Dongbu Steel Co Ltd, swap sur rendement total	8 830	327
93	31 juill. 2024	Donnelley Financial Solution, swap sur rendement total	7 648	383
813	31 juill. 2024	Doordash Inc, A, swap sur rendement total	106 012	2 188
39	31 juill. 2024	Dorian Lpg Ltd, swap sur rendement total	2 256	(49)
109	31 juill. 2024	Dr Horton Inc, swap sur rendement total	21 844	3 418
1 082	31 juill. 2024	Draftkings Inc, cat. A, swap sur rendement total	50 292	(2 095)
44	31 juill. 2024	Dream Finders Homes Inc, A, swap sur rendement total	2 061	490
770	31 juill. 2024	Dreamus Co, swap sur rendement total	2 308	15
1 982	31 juill. 2024	Dropbox Inc, cat. A, swap sur rendement total	77 045	3 237
15	31 juill. 2024	Dt Midstream Inc, swap sur rendement total	1 098	3
43	31 juill. 2024	Duolingo, swap sur rendement total	12 862	746
292	31 juill. 2024	Dxc Technology Co, swap sur rendement total	8 806	(69)
10	31 juill. 2024	Dxp Enterprises Inc, swap sur rendement total	444	57
51	31 juill. 2024	Ebay Inc, swap sur rendement total	2 933	147
1 900	31 juill. 2024	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	4 864	449
34	31 juill. 2024	Editas Medicine Inc, swap sur rendement total	454	(21)
86	31 juill. 2024	Egain Corp, swap sur rendement total	945	71
278	31 juill. 2024	Ehealth Inc, swap sur rendement total	3 196	401
41	31 juill. 2024	Elanco Animal Health Inc, swap sur rendement total	806	165
277	31 juill. 2024	Elastic Nv, swap sur rendement total	41 164	8 167
158	31 juill. 2024	Embecka Corp, swap sur rendement total	3 944	106
40	31 juill. 2024	Emcor Group Inc, swap sur rendement total	11 363	111
226	31 juill. 2024	Emergent Biosolutions Inc, swap sur rendement total	715	75
2 375	31 juill. 2024	Empresas Cmpe Sa, swap sur rendement total	6 092	-
2	31 juill. 2024	Encore Wire Corp, swap sur rendement total	563	(8)
2 209	31 juill. 2024	Enea Sa, swap sur rendement total	6 788	255
324	31 juill. 2024	Energizer Holdings Inc, swap sur rendement total	13 535	138
1 402	31 juill. 2024	Engie Energia Chile Sa, swap sur rendement total	1 946	178
439	31 juill. 2024	Esperion Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 731	516
100	31 juill. 2024	Essa Bancorp Inc, swap sur rendement total	2 640	431
221	31 juill. 2024	Estée Lauder Companies, cat. A, swap sur rendement total	42 619	5 239
100	31 juill. 2024	Eternit Sa, swap sur rendement total	238	4
498	31 juill. 2024	Etsy Inc, swap sur rendement total	53 223	3 139
1 800	31 juill. 2024	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	8 215	516
183	31 juill. 2024	Eventbrite Inc, cat. A, swap sur rendement total	2 017	294
87	31 juill. 2024	Everbridge Inc, swap sur rendement total	2 789	402
14 000	31 juill. 2024	Evergreen Steel Corp, swap sur rendement total	62 772	12 622
3 000	31 juill. 2024	Everlight Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	6 467	538
89	31 juill. 2024	Exact Sciences Corp, swap sur rendement total	8 682	685

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
145	31 juill. 2024	Extreme Networks Inc, swap sur rendement total	3 373	219
953	31 juill. 2024	Exxon Mobil Corp, swap sur rendement total	125 637	(766)
205	31 juill. 2024	Eyepoint Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	6 247	890
592	31 juill. 2024	Federated Hermes Inc, swap sur rendement total	26 431	1 440
600	31 juill. 2024	Fibra Uno Administracion Sa, swap sur rendement total	1 424	144
1 778	31 juill. 2024	First Horizon Corp, swap sur rendement total	33 549	908
44	31 juill. 2024	Formfactor Inc, swap sur rendement total	2 420	231
1 216	31 juill. 2024	Fortinet Inc, swap sur rendement total	93 848	8 685
2 000	31 juill. 2024	Fortune Electric Co Ltd, swap sur rendement total	28 196	(1 367)
11	31 juill. 2024	Fox Factory Holding Corp, swap sur rendement total	979	36
14	31 juill. 2024	Franklin Electric Co Inc, swap sur rendement total	1 784	120
1 300	31 juill. 2024	Fras-Le Sa, swap sur rendement total	6 082	599
134	31 juill. 2024	Frontline Ltd, swap sur rendement total	3 543	14
856	31 juill. 2024	Futu Holdings Ltd, CAAE, swap sur rendement total	61 662	387
78	31 juill. 2024	Futurefuel Corp, swap sur rendement total	625	12
137	31 juill. 2024	G1 Therapeutics Inc, swap sur rendement total	551	76
52	31 juill. 2024	Gaeasoft, swap sur rendement total	507	(31)
5 000	31 juill. 2024	Gemtek Technology Corp, swap sur rendement total	7 437	(237)
187	31 juill. 2024	Generac Holdings Inc, swap sur rendement total	31 868	1 217
2 685	31 juill. 2024	General Motors Co, swap sur rendement total	127 173	12 436
19 100	31 juill. 2024	Genera Sab De Cv, swap sur rendement total	34 976	5 734
425	31 juill. 2024	Geo Group Inc/The, swap sur rendement total	6 069	344
200	31 juill. 2024	Giti Tire Corp, A, swap sur rendement total	550	(10)
29	31 juill. 2024	Glaukos Corp, swap sur rendement total	3 040	525
3 000	31 juill. 2024	Global Brands Manufacture, swap sur rendement total	8 342	(418)
2 000	31 juill. 2024	Global Mixed-Mode Technology, swap sur rendement total	22 763	107
92	31 juill. 2024	Goodrx Holdings Inc, cat. A, swap sur rendement total	813	83
1 842	31 juill. 2024	Grab Holdings Ltd, cat. A, swap sur rendement total	8 185	774
100	31 juill. 2024	Graham Corp, swap sur rendement total	2 501	60
30	31 juill. 2024	Graham Holdings Co, cat. B, swap sur rendement total	27 553	2 647
833	31 juill. 2024	Graphic Packaging Holding Co, swap sur rendement total	27 185	1 904
2 000	31 juill. 2024	Greatek Electronics Inc, swap sur rendement total	5 277	152
9	31 juill. 2024	Green Brick Partners Inc, swap sur rendement total	616	43
177	31 juill. 2024	Green Dot Corp, cat. A, swap sur rendement total	2 311	432
148	31 juill. 2024	Green Plains Inc, swap sur rendement total	4 922	32
672	31 juill. 2024	Greenlight Capital Re Ltd, A, swap sur rendement total	10 119	263
74	31 juill. 2024	Grupa Pracuj Sa, swap sur rendement total	1 538	182
1 800	31 juill. 2024	Grupo Herdez Sab, série *, swap sur rendement total	6 444	398
100	31 juill. 2024	Grupo Sbf Sa, swap sur rendement total	319	14
1 955	31 juill. 2024	Grupo Security Sa, swap sur rendement total	761	53
1 040	31 juill. 2024	Gs Global Corp, swap sur rendement total	2 708	(25)
11	31 juill. 2024	Guidewire Software Inc, swap sur rendement total	1 582	124
31 070	31 juill. 2024	Habib Bank Ltd, swap sur rendement total	16 106	(38)
283	31 juill. 2024	Hankook Tire & Technology Co, swap sur rendement total	13 121	29
651	31 juill. 2024	Hanmi Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	41 020	776
6	31 juill. 2024	Hanwha Aerospace Co Ltd, swap sur rendement total	763	(11)
503	31 juill. 2024	Harley-Davidson Inc, swap sur rendement total	24 434	3 968
64	31 juill. 2024	Hashicorp Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 995	161
49	31 juill. 2024	Health Catalyst Inc, swap sur rendement total	598	125
18	31 juill. 2024	Healthstream Inc, swap sur rendement total	642	25
233	31 juill. 2024	Heico Corp, swap sur rendement total	54 955	1 098
2 700	31 juill. 2024	Henglin Home Furnishings C, A, swap sur rendement total	22 349	6 774
335	31 juill. 2024	Herbalife Nutrition Ltd, swap sur rendement total	6 741	1 024
31	31 juill. 2024	Heritage Commerce Corp, swap sur rendement total	405	18
114	31 juill. 2024	Heritage Financial Corp, swap sur rendement total	3 215	169
1 318	31 juill. 2024	Heritage Insurance Holdings, swap sur rendement total	11 331	(3 822)
545	31 juill. 2024	Hertz Global Holdings Inc, swap sur rendement total	7 467	1 434
30 000	31 juill. 2024	Hidrovias Do Brasil Sa, swap sur rendement total	32 120	2 796
635	31 juill. 2024	Hims & Hers Health Inc, swap sur rendement total	7 452	4
165	31 juill. 2024	Hni Corp, swap sur rendement total	9 101	215
1 000	31 juill. 2024	Holy Stone Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	4 182	(49)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
13 600	31 juill. 2024	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	6 263	459
9 623	31 juill. 2024	Hub Power Company, swap sur rendement total	5 270	(201)
7	31 juill. 2024	Huron Consulting Group Inc, swap sur rendement total	949	(16)
273	31 juill. 2024	Hutchmed China, CAAE, swap sur rendement total	6 519	(203)
1 170	31 juill. 2024	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	4 349	(207)
394	31 juill. 2024	Immunovant Inc, swap sur rendement total	21 888	1 465
200	31 juill. 2024	Impulse Qingdao Health Tec, A, swap sur rendement total	615	(24)
401	31 juill. 2024	Incyte Corp, swap sur rendement total	33 201	4 009
8	31 juill. 2024	Ingevity Corp, swap sur rendement total	498	78
19	31 juill. 2024	Insmid Inc, swap sur rendement total	776	147
94	31 juill. 2024	Inspire Medical Systems Inc, swap sur rendement total	25 215	5 704
39	31 juill. 2024	Intapp Inc, swap sur rendement total	1 955	(1)
2	31 juill. 2024	Integer Holdings Corp, swap sur rendement total	261	29
1 721	31 juill. 2024	Intel Corp, swap sur rendement total	114 033	11 921
2 449	31 juill. 2024	Interloop Ltd, swap sur rendement total	825	60
11 869	31 juill. 2024	International Steels Ltd, swap sur rendement total	4 053	317
1 310	31 juill. 2024	Intevac Inc, swap sur rendement total	7 462	1 013
1 338	31 juill. 2024	Inversiones La Construccion, swap sur rendement total	12 779	1 339
844	31 juill. 2024	Invesco Ltd, swap sur rendement total	19 854	3 887
2 100	31 juill. 2024	Iochepe-Maxion S.A., swap sur rendement total	7 356	624
13 000	31 juill. 2024	Irani Sa, swap sur rendement total	38 576	2 663
12	31 juill. 2024	Iridium Communications Inc, swap sur rendement total	651	29
34	31 juill. 2024	James River Group Holdings L, swap sur rendement total	414	10
24	31 juill. 2024	Jamf Holding Corp, swap sur rendement total	572	42
158	31 juill. 2024	Jazz Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	25 626	893
76	31 juill. 2024	Jfrog Ltd, swap sur rendement total	3 468	736
200	31 juill. 2024	Jiangsu Maysta Chemical Co, A, swap sur rendement total	500	9
2 900	31 juill. 2024	Jiangxi Sanxin Medtec Co L, A, swap sur rendement total	4 109	(301)
565	31 juill. 2024	Jntc Co Ltd, swap sur rendement total	6 936	(1 336)
4 719	31 juill. 2024	Kandi Technologies Group Inc, swap sur rendement total	17 423	(83)
1 049	31 juill. 2024	Kar Auction Services Inc, swap sur rendement total	20 485	(3)
10	31 juill. 2024	Karuna Therapeutics Inc, swap sur rendement total	4 174	1 640
479	31 juill. 2024	Kc Tech Co Ltd/New, swap sur rendement total	13 110	109
2 800	31 juill. 2024	Keelson Technology Corp Ltd, A, swap sur rendement total	6 198	(118)
235	31 juill. 2024	Kg Eco Technology Service Co, swap sur rendement total	2 740	38
230	31 juill. 2024	Kiniksa Pharmaceuticals, A, swap sur rendement total	5 319	376
287	31 juill. 2024	Kiswire Ltd, swap sur rendement total	5 950	299
32	31 juill. 2024	Knowles Corp, swap sur rendement total	756	50
393	31 juill. 2024	Kohls Corp, swap sur rendement total	14 862	601
525	31 juill. 2024	Koninklijke Philips Nvr- Ny, swap sur rendement total	16 151	1 254
1 668	31 juill. 2024	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	12 180	(1 034)
6	31 juill. 2024	Kruk Sa, swap sur rendement total	959	30
87	31 juill. 2024	Kulicke & Soffa Industries, swap sur rendement total	6 300	269
1 081	31 juill. 2024	Kyndryl Holdings Inc, swap sur rendement total	29 620	3 385
3 000	31 juill. 2024	L&K Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	21 987	3 457
808	31 juill. 2024	Landsea Homes Corp, swap sur rendement total	14 000	2 974
294	31 juill. 2024	Lantheus Holdings Inc, swap sur rendement total	24 035	(2 705)
2 820 116	31 juill. 2024	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	40 637	4 024
331	31 juill. 2024	Lattice Semiconductor Corp, swap sur rendement total	30 111	3 607
14	31 juill. 2024	Leejam Sports Co Jsc, swap sur rendement total	995	179
23	31 juill. 2024	Lendingtree Inc, swap sur rendement total	920	20
133	31 juill. 2024	Lexicon Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	268	82
2	31 juill. 2024	Lg Innotek Co Ltd, swap sur rendement total	489	1
2 356	31 juill. 2024	Liberty Global Plc, A, swap sur rendement total	55 205	4 928
66	31 juill. 2024	Lifemd Inc, swap sur rendement total	721	49
38	31 juill. 2024	Lindblad Expeditions Holding, swap sur rendement total	565	158
78	31 juill. 2024	Lions Gate Entertainment, B, swap sur rendement total	1 048	185
12	31 juill. 2024	Live Nation Entertainment In, swap sur rendement total	1 481	119
130	31 juill. 2024	Liveramp Holdings Inc, swap sur rendement total	6 493	767
1 500	31 juill. 2024	Lojas Renner S.A., swap sur rendement total	7 236	650
664	31 juill. 2024	Loma Negra Cia Ind, CAAE parrainé, swap sur rendement total	6 208	239

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
172	31 juill. 2024	Lotte Non-Life Insurance Co, swap sur rendement total	420	9
73	31 juill. 2024	Louisiana-Pacific Corp, swap sur rendement total	6 818	871
4	31 juill. 2024	Lpp Sa, swap sur rendement total	21 702	1 957
188	31 juill. 2024	Lsi Industries Inc, swap sur rendement total	3 490	228
765	31 juill. 2024	Lumen Technologies Inc, swap sur rendement total	1 846	519
1 400	31 juill. 2024	Luzhou Laojiao Co Ltd, A, swap sur rendement total	46 650	1 447
600	31 juill. 2024	Macquarie Mexico Real Estate, swap sur rendement total	1 549	162
161	31 juill. 2024	Macrogenics Inc, swap sur rendement total	2 042	221
73	31 juill. 2024	Macy'S Inc, swap sur rendement total	1 953	399
89	31 juill. 2024	Madison Square Garden Sports, swap sur rendement total	21 339	1 394
92	31 juill. 2024	Madrigal Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	28 069	3 263
385	31 juill. 2024	Mannkind Corp, swap sur rendement total	1 848	4
145	31 juill. 2024	Marathon Digital Holdings In, swap sur rendement total	4 491	(971)
92	31 juill. 2024	Marathon Petroleum Corp, swap sur rendement total	17 998	(645)
51 900	31 juill. 2024	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	100 839	16 978
400	31 juill. 2024	Marfrig Global Foods Sa, swap sur rendement total	1 054	13
682	31 juill. 2024	Marvell Technology Group Ltd, swap sur rendement total	54 236	4 464
127 839	31 juill. 2024	Masisa Sa, swap sur rendement total	3 424	106
11 921	31 juill. 2024	Mcb Bank Ltd, swap sur rendement total	9 620	314
6	31 juill. 2024	Mcgrath Rentcorp, swap sur rendement total	946	138
145	31 juill. 2024	Medallion Financial Corp, swap sur rendement total	1 883	54
5 300	31 juill. 2024	Medco Energi Internacional T, swap sur rendement total	524	2
789	31 juill. 2024	Medical Properties Trust Inc, swap sur rendement total	5 264	(82)
492	31 juill. 2024	Mednax Inc, swap sur rendement total	6 033	566
38	31 juill. 2024	Medpace Holdings Inc, swap sur rendement total	15 359	1 706
175	31 juill. 2024	Merit Medical Systems Inc, swap sur rendement total	17 528	961
72	31 juill. 2024	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	4 346	248
1 000	31 juill. 2024	Merry Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	4 721	(104)
63	31 juill. 2024	Meta Platforms Inc, cat. A, swap sur rendement total	29 404	1 894
5 400	31 juill. 2024	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	15 936	1 031
1 145	31 juill. 2024	Micron Technology Inc, swap sur rendement total	129 020	7 135
347	31 juill. 2024	Middle East Healthcare Co, swap sur rendement total	10 810	1 208
87	31 juill. 2024	Millerknoll Inc, swap sur rendement total	3 082	105
1 481	31 juill. 2024	Miniso Group Holding Ltd, CAAE, swap sur rendement total	39 838	(206)
11	31 juill. 2024	Moonlake Immunotherapeutics, swap sur rendement total	876	236
15	31 juill. 2024	Morphic Holding Inc, swap sur rendement total	571	35
456	31 juill. 2024	Motorcar Parts Of America In, swap sur rendement total	5 616	(203)
500	31 juill. 2024	Muangthai Capital Pcl, swap sur rendement total	862	36
8	31 juill. 2024	National Beverage Corp, swap sur rendement total	524	20
53	31 juill. 2024	Ncino Inc, swap sur rendement total	2 350	393
183	31 juill. 2024	Nerdwallet Inc, cat. A, swap sur rendement total	3 552	706
851	31 juill. 2024	Newell Brands Inc, swap sur rendement total	9 740	1 138
353	31 juill. 2024	Nexen Tire Corp, swap sur rendement total	2 898	(278)
2 000	31 juill. 2024	Nichidenbo Corp, swap sur rendement total	5 010	(34)
181	31 juill. 2024	Nl Industries, swap sur rendement total	1 339	101
72	31 juill. 2024	Nordstrom Inc, swap sur rendement total	1 752	115
7	31 juill. 2024	Northrop Grumman Corp, swap sur rendement total	4 321	23
1 738	31 juill. 2024	Norwegian Cruise Line Holdin, swap sur rendement total	45 926	3 621
37	31 juill. 2024	Novartis Ag, CAAE parrainé, swap sur rendement total	4 926	113
715	31 juill. 2024	Novocure Ltd, swap sur rendement total	14 076	2 465
134	31 juill. 2024	Novo-Nordisk A/S, CAAE parrainé, swap sur rendement total	18 279	344
431	31 juill. 2024	Nrg Energy Inc, swap sur rendement total	29 382	2 043
88	31 juill. 2024	Nu Skin Enterprises Inc, A, swap sur rendement total	2 253	270
636	31 juill. 2024	Nutanix Inc, A, swap sur rendement total	39 994	2 677
124	31 juill. 2024	Nvidia Corp, swap sur rendement total	80 972	2 266
90	31 juill. 2024	Oci Co Ltd, swap sur rendement total	9 761	648
76	31 juill. 2024	Office Properties Income Tru, swap sur rendement total	734	102
324	31 juill. 2024	Okta Inc, swap sur rendement total	38 677	8 009
78	31 juill. 2024	Olin Corp, swap sur rendement total	5 549	102
145	31 juill. 2024	Omnib Inc, swap sur rendement total	1 180	170
106	31 juill. 2024	Omniceil Inc, swap sur rendement total	5 260	570

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
17	31 juill. 2024	On Semiconductor, swap sur rendement total	1 872	(43)
57	31 juill. 2024	Onespaworld Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 060	127
19	31 juill. 2024	Onto Innovation Inc, swap sur rendement total	3 831	256
207	31 juill. 2024	Opko Health Inc, swap sur rendement total	412	11
3 621	31 juill. 2024	Orange Polska Sa, swap sur rendement total	9 878	231
554	31 juill. 2024	Orasure Technologies Inc, swap sur rendement total	5 990	601
1 115	31 juill. 2024	Organon & Co, swap sur rendement total	21 201	4 459
352	31 juill. 2024	Pagerduty Inc, swap sur rendement total	10 745	589
2 900	31 juill. 2024	Pakistan Petroleum Ltd, swap sur rendement total	1 560	318
265	31 juill. 2024	Pan Ocean Co Ltd, swap sur rendement total	1 011	(75)
1 127	31 juill. 2024	Paramount Global, cat. B, swap sur rendement total	22 053	(1 649)
204	31 juill. 2024	Pbf Energy Inc, cat. A, swap sur rendement total	11 825	692
147	31 juill. 2024	Pdf Solutions Inc, swap sur rendement total	6 230	317
743	31 juill. 2024	Peabody Energy Corp, swap sur rendement total	23 827	212
31	31 juill. 2024	Pegasystems Inc, swap sur rendement total	1 998	(135)
1 978	31 juill. 2024	Peloton Interactive Inc, A, swap sur rendement total	15 884	1 039
7	31 juill. 2024	Penske Automotive Group Inc, swap sur rendement total	1 482	82
4	31 juill. 2024	Penumbra Inc, swap sur rendement total	1 327	95
746	31 juill. 2024	Peptron Inc, swap sur rendement total	30 665	4 352
351	31 juill. 2024	Perrigo Co Plc, swap sur rendement total	14 894	720
713	31 juill. 2024	Petco Health And Wellness Co, swap sur rendement total	2 971	164
6 658	31 juill. 2024	Pge Sa, swap sur rendement total	19 363	271
68	31 juill. 2024	Photonics Inc, swap sur rendement total	2 813	909
2 141	31 juill. 2024	Pinterest Inc, cat. A, swap sur rendement total	104 568	4 166
793	31 juill. 2024	Pixelworks Inc, swap sur rendement total	1 370	163
79	31 juill. 2024	Pko Bank Polski Sa, swap sur rendement total	1 332	65
324	31 juill. 2024	Pmv Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	1 324	344
54	31 juill. 2024	Polaris Inc, swap sur rendement total	6 748	799
322	31 juill. 2024	Poongsan Corp, swap sur rendement total	12 891	1 102
2	31 juill. 2024	Posco Holdings Inc, swap sur rendement total	1 020	30
94	31 juill. 2024	Posco, CAAE parrainé, swap sur rendement total	11 789	205
606	31 juill. 2024	Poseida Therapeutics Inc, swap sur rendement total	2 685	359
36	31 juill. 2024	Post Holdings Inc, swap sur rendement total	4 180	87
28	31 juill. 2024	Powerschool Holdings Inc, A, swap sur rendement total	870	15
1 169	31 juill. 2024	Powszechny Zaklad Ubezpiecze, swap sur rendement total	18 518	782
21	31 juill. 2024	Premier Financial Corp, swap sur rendement total	667	48
828	31 juill. 2024	Procore Technologies Inc, swap sur rendement total	75 574	10 388
4 500	31 juill. 2024	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	7 459	842
416	31 juill. 2024	Progress Software Corp, swap sur rendement total	29 786	(161)
11 000	31 juill. 2024	Promate Electronic Co Ltd, swap sur rendement total	27 553	213
261	31 juill. 2024	Protagonist Therapeutics Inc, swap sur rendement total	7 891	643
114	31 juill. 2024	Prothena Corp Plc, swap sur rendement total	5 463	539
647	31 juill. 2024	Pure Storage Inc, cat. A, swap sur rendement total	30 423	367
18	31 juill. 2024	Q2 Holdings Inc, swap sur rendement total	1 030	184
46 100	31 juill. 2024	Qilu Bank Co Ltd, A, swap sur rendement total	33 475	51
910	31 juill. 2024	Quinenco S.A., swap sur rendement total	3 934	580
126	31 juill. 2024	Ramaco Resources Inc, swap sur rendement total	2 854	128
3 500	31 juill. 2024	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	12 516	2 000
57	31 juill. 2024	Rapid7 Inc, swap sur rendement total	4 292	205
3	31 juill. 2024	Regal Beloit Corp, swap sur rendement total	1 127	103
39	31 juill. 2024	Relay Therapeutics Inc, swap sur rendement total	566	142
537	31 juill. 2024	Remitly Global Inc, swap sur rendement total	13 751	(976)
20	31 juill. 2024	Rent-A-Center Inc, swap sur rendement total	906	17
169	31 juill. 2024	Replimune Group Inc, swap sur rendement total	1 879	(574)
191	31 juill. 2024	Resmed Inc, swap sur rendement total	43 324	3 434
141	31 juill. 2024	Revance Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 634	371
187	31 juill. 2024	Reynolds Consumer Products I, swap sur rendement total	6 618	111
7	31 juill. 2024	Rh, swap sur rendement total	2 690	163
1 088	31 juill. 2024	Rithm Capital Corp, swap sur rendement total	15 681	43
1 954	31 juill. 2024	Robinhood Markets Inc, A, swap sur rendement total	32 825	8 680
1 086	31 juill. 2024	Roblox Corp, cat. A, swap sur rendement total	65 471	6 198

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 583	31 juill. 2024	Roivant Sciences Ltd, swap sur rendement total	23 441	3 120
425	31 juill. 2024	Roku Inc, swap sur rendement total	51 367	(7 075)
110	31 juill. 2024	Root Inc/Oh, cat. A, swap sur rendement total	1 520	72
20	31 juill. 2024	Rpm International Inc, swap sur rendement total	2 944	(4)
352	31 juill. 2024	Rsupport Co Ltd, swap sur rendement total	1 325	5
69	31 juill. 2024	Rush Street Interactive Inc, swap sur rendement total	409	24
268	31 juill. 2024	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	3 941	(102)
429	31 juill. 2024	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	7 575	52
217	31 juill. 2024	Sally Beauty Holdings Inc, swap sur rendement total	3 800	1 009
27	31 juill. 2024	Samsung Engineering Co Ltd, swap sur rendement total	800	101
25	31 juill. 2024	Santander Bank Polska Sa, swap sur rendement total	4 104	(62)
782	31 juill. 2024	Sapiens International Corp, swap sur rendement total	29 841	3 113
56	31 juill. 2024	Sasol Ltd, CAAE parrainé, swap sur rendement total	734	6
5	31 juill. 2024	Saudia Dairy & Foodstuff Co, swap sur rendement total	585	23
839	31 juill. 2024	Sea Ltd, CAAE, swap sur rendement total	44 805	4 311
219	31 juill. 2024	Seagate Technology, swap sur rendement total	24 855	1 807
53	31 juill. 2024	Semtech Corp, swap sur rendement total	1 531	188
960	31 juill. 2024	Sensata Technologies Holding, swap sur rendement total	47 558	6 195
27	31 juill. 2024	Sensit Technologies Corp, swap sur rendement total	2 350	123
2 000	31 juill. 2024	Ser Educacional Sa, swap sur rendement total	4 272	922
91	31 juill. 2024	Shanghai Allist Pharmaceut, A, swap sur rendement total	704	67
14 500	31 juill. 2024	Shell Pakistan Ltd (Pbs), swap sur rendement total	10 204	(945)
2 300	31 juill. 2024	Shenzhen Jianyi Decoration, A, swap sur rendement total	5 878	(276)
3 043	31 juill. 2024	Shinsung Tongsang Co Ltd, swap sur rendement total	5 721	(225)
60	31 juill. 2024	Ship Finance Intl Ltd, swap sur rendement total	892	(17)
7	31 juill. 2024	Shockwave Medical Inc, swap sur rendement total	1 759	141
15 000	31 juill. 2024	Silicon Integrated Systems, swap sur rendement total	29 489	(1 293)
107	31 juill. 2024	Silvercrest Asset Manageme, A, swap sur rendement total	2 399	133
1 000	31 juill. 2024	Sinmag Equipment Corp, swap sur rendement total	6 596	127
257	31 juill. 2024	Sk Hynix Inc, swap sur rendement total	37 138	2 738
82	31 juill. 2024	Smartrent Inc, swap sur rendement total	345	5
10 450	31 juill. 2024	Smu Sa, swap sur rendement total	2 551	(9)
3 676	31 juill. 2024	Snap Inc, A, swap sur rendement total	82 063	7 766
3 137	31 juill. 2024	Solarwinds Corp, swap sur rendement total	51 664	3 508
5 698	31 juill. 2024	Sonda Sa, swap sur rendement total	3 299	45
774	31 juill. 2024	Sonos Inc, swap sur rendement total	17 493	2 023
20	31 juill. 2024	Southwest Airlines Co, swap sur rendement total	766	86
33	31 juill. 2024	Spectrum Brands Holdings Inc, swap sur rendement total	3 471	90
168	31 juill. 2024	Spok Holdings Inc, swap sur rendement total	3 429	(289)
104	31 juill. 2024	Sprinklr Inc, A, swap sur rendement total	1 651	41
1 250	31 juill. 2024	Square Inc, A, swap sur rendement total	127 492	22 446
100	31 juill. 2024	Standard Motor Prods, swap sur rendement total	5 249	482
1 000	31 juill. 2024	Stark Technology Inc, swap sur rendement total	5 195	(127)
112	31 juill. 2024	Steelcase Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 997	108
100	31 juill. 2024	Sterling Infrastructure Inc, swap sur rendement total	11 594	3 060
198	31 juill. 2024	Sun Kwang Co Ltd, swap sur rendement total	3 628	80
76	31 juill. 2024	Suncoke Energy Inc, swap sur rendement total	1 076	71
662	31 juill. 2024	Sunpower Corp, swap sur rendement total	4 216	580
3 000	31 juill. 2024	Sunrex Technology Corp, swap sur rendement total	7 683	663
36	31 juill. 2024	Supernus Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	1 374	68
3 800	31 juill. 2024	Syarikat Takaful Malaysia Ke, swap sur rendement total	4 035	(8)
1 300	31 juill. 2024	Syn Prop E Tech Sa, swap sur rendement total	1 692	180
416	31 juill. 2024	Taboola.Com Ltd, swap sur rendement total	2 375	438
203	31 juill. 2024	Tae Kyung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	1 360	(44)
3 000	31 juill. 2024	Taiflex Scientific Co Ltd, swap sur rendement total	6 344	942
3 000	31 juill. 2024	Taiwan Fire & Marine Insuran, swap sur rendement total	3 440	276
1 000	31 juill. 2024	Taiwan Pcb Techvest Co Ltd, swap sur rendement total	1 867	2
18	31 juill. 2024	Taiwan Semiconductor, CAAE parrainé, swap sur rendement total	2 480	93
253	31 juill. 2024	Tandem Diabetes Care Inc, swap sur rendement total	9 868	2 909
505	31 juill. 2024	Tango Therapeutics Inc, swap sur rendement total	6 592	1 458
10 418	31 juill. 2024	Tauron Polska Energia Sa, swap sur rendement total	13 036	(1 187)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
743	31 juill. 2024	Technipfmc Plc, swap sur rendement total	19 732	66
864	31 juill. 2024	Teekay Corp, swap sur rendement total	8 146	(269)
492	31 juill. 2024	Teladoc Health Inc, swap sur rendement total	13 981	1 960
859	31 juill. 2024	Telephone And Data Systems, swap sur rendement total	20 785	(230)
948	31 juill. 2024	Telesat Corp, swap sur rendement total	13 038	(353)
303	31 juill. 2024	Tenable Holdings Inc, swap sur rendement total	18 403	1 748
628	31 juill. 2024	Tg Therapeutics Inc, swap sur rendement total	14 144	1 158
194	31 juill. 2024	The National Agriculture Dev, swap sur rendement total	1 903	211
90	31 juill. 2024	Third Coast Bancshares Inc, swap sur rendement total	2 358	222
200	31 juill. 2024	Tianjin Guifaxiang 18Th St, A, swap sur rendement total	424	(13)
378	31 juill. 2024	Tko Group Holdings Inc, swap sur rendement total	40 662	2 524
2 351	31 juill. 2024	Toast Inc, cat. A, swap sur rendement total	56 607	10 057
630	31 juill. 2024	Tongyang Life Insurance, swap sur rendement total	2 915	39
1 300	31 juill. 2024	Top Glove Corp Bhd, swap sur rendement total	336	(8)
100	31 juill. 2024	Transact Technologies Inc, swap sur rendement total	920	27
586	31 juill. 2024	Transocean Ltd, swap sur rendement total	4 907	73
9	31 juill. 2024	Travel + Leisure Co, swap sur rendement total	464	(12)
1 111	31 juill. 2024	Tredegar Corp, swap sur rendement total	7 925	798
56	31 juill. 2024	Tri Pointe Homes Inc, swap sur rendement total	2 614	207
39	31 juill. 2024	Trinseo Sa, swap sur rendement total	430	132
3 000	31 juill. 2024	Tripod Technology Corp, swap sur rendement total	25 221	722
240	31 juill. 2024	Twin Disc Inc, swap sur rendement total	5 114	691
1 563	31 juill. 2024	Uber Technologies Inc, swap sur rendement total	126 894	8 383
2 000	31 juill. 2024	Ubright Optronics Corp, swap sur rendement total	4 889	220
14	31 juill. 2024	Ultra Clean Holdings Inc, swap sur rendement total	630	125
90	31 juill. 2024	Ultragenyx Pharmaceutical In, swap sur rendement total	5 675	1 025
1 914	31 juill. 2024	United Bank Ltd, swap sur rendement total	1 592	(25)
910	31 juill. 2024	United Bankshares Inc, swap sur rendement total	45 501	2 571
109	31 juill. 2024	United Natural Foods Inc, swap sur rendement total	2 333	228
900	31 juill. 2024	United Tractors Tbk Pt, swap sur rendement total	1 742	58
2 315	31 juill. 2024	Unity Software Inc, swap sur rendement total	124 819	9 357
10	31 juill. 2024	Unum Group, swap sur rendement total	596	30
407	31 juill. 2024	Upwork Inc, swap sur rendement total	7 980	369
42	31 juill. 2024	Urogen Pharma Ltd, swap sur rendement total	831	32
72	31 juill. 2024	Us Bancorp, swap sur rendement total	4 155	17
274	31 juill. 2024	V One Tech Co Ltd, swap sur rendement total	3 136	(32)
78	31 juill. 2024	Vacasa Inc, cat. A, swap sur rendement total	843	21
5	31 juill. 2024	Vail Resorts Inc, swap sur rendement total	1 421	(66)
7	31 juill. 2024	Valaris Plc, swap sur rendement total	633	(3)
528	31 juill. 2024	Valero Energy Corp, swap sur rendement total	90 509	404
9 700	31 juill. 2024	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	54 036	1 003
26	31 juill. 2024	Varex Imaging Corp, swap sur rendement total	703	54
179	31 juill. 2024	Varonis Systems Inc, swap sur rendement total	10 687	150
430	31 juill. 2024	Ventyx Biosciences Inc, swap sur rendement total	1 400	176
192	31 juill. 2024	Verint Systems Inc, swap sur rendement total	6 843	452
700	31 juill. 2024	Vibra Energia Sa, swap sur rendement total	4 484	186
33	31 juill. 2024	Village Super Market, cat. A, swap sur rendement total	1 141	43
282	31 juill. 2024	Vitzrocell Co Ltd, swap sur rendement total	4 772	217
103	31 juill. 2024	Vivid Seats Inc, cat. A, swap sur rendement total	858	(244)
900	31 juill. 2024	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	4 926	(132)
2 000	31 juill. 2024	Wah Lee Industrial Corp, swap sur rendement total	8 502	(8)
205	31 juill. 2024	Walt Disney Co/The, swap sur rendement total	24 488	(482)
1 048	31 juill. 2024	Warsaw Stock Exchange, swap sur rendement total	14 926	962
28	31 juill. 2024	Waters Corp, swap sur rendement total	12 155	1 680
53	31 juill. 2024	Watsco Inc, swap sur rendement total	29 944	1 967
924	31 juill. 2024	Wayfair Inc, cat. A, swap sur rendement total	75 174	827
215	31 juill. 2024	Weave Communications Inc, swap sur rendement total	3 252	566
121	31 juill. 2024	Wee Energy Group Inc, swap sur rendement total	13 429	98
854	31 juill. 2024	Western Digital Corp, swap sur rendement total	58 973	4 606
533	31 juill. 2024	Williams Cos Inc, swap sur rendement total	24 479	(255)
51	31 juill. 2024	Willis Lease Finance Corp, swap sur rendement total	3 287	162

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
1 300	31 juill. 2024	Wilson Sons Holdings Brasil, swap sur rendement total	6 168	743
237	31 juill. 2024	Wisol Co Ltd, swap sur rendement total	1 881	92
73	31 juill. 2024	Wix.Com Ltd, swap sur rendement total	11 842	2 035
5 900	31 juill. 2024	Wiz Co, swap sur rendement total	11 624	2 235
573	31 juill. 2024	Wooree Bio Co Ltd, swap sur rendement total	1 934	401
2 000	31 juill. 2024	Wt Microelectronics Co Ltd, swap sur rendement total	9 700	(284)
300	31 juill. 2024	Xinjiang Torch Gas Co Ltd, A, swap sur rendement total	928	(74)
180	31 juill. 2024	Xperi Holding Corp, swap sur rendement total	2 616	157
55	31 juill. 2024	Xponential Fitness Inc, A, swap sur rendement total	935	250
269	31 juill. 2024	X-Trade Brokers Dom Maklersk, swap sur rendement total	3 409	437
1 000	31 juill. 2024	Yang Ming Marine Transport, swap sur rendement total	2 212	15
6 500	31 juill. 2024	Yduqs Part, swap sur rendement total	39 601	4 273
416	31 juill. 2024	Yest Co Ltd, swap sur rendement total	7 048	(612)
859	31 juill. 2024	Yext Inc, swap sur rendement total	6 671	119
2 000	31 juill. 2024	Young Fast Optoelectronics, swap sur rendement total	3 716	417
3 076	31 juill. 2024	Ypf S.A., CAAE parrainé, swap sur rendement total	69 723	(1 309)
2 000	31 juill. 2024	Ytl Corp Bhd, swap sur rendement total	1 085	181
700	31 juill. 2024	Ytl Power International Bhd, swap sur rendement total	510	41
1 000	31 juill. 2024	Yungshim Construction, swap sur rendement total	3 979	63
206	31 juill. 2024	Zai Lab Ltd, CAAE, swap sur rendement total	7 424	253
200	31 juill. 2024	Zamp Sa, swap sur rendement total	310	(3)
2 600	31 juill. 2024	Zhejiang Double Arrow Rubb, A, swap sur rendement total	3 660	(90)
13 800	31 juill. 2024	Zhejiang Giuseppe Garment, A, swap sur rendement total	13 660	(327)
1 200	31 juill. 2024	Zhejiang Tengen Electrics Co, swap sur rendement total	2 046	21
3 100	31 juill. 2024	Zhongjing Food Co Ltd, A, swap sur rendement total	23 760	(1 607)
1 648	31 juill. 2024	Zillow Group Inc, C, swap sur rendement total	125 733	22 413
3 900	31 juill. 2024	Zjmi Environmental Energy, A, swap sur rendement total	11 009	78
9	31 juill. 2024	Zoetis Inc, swap sur rendement total	2 342	168
115	31 juill. 2024	Zscaler Inc, swap sur rendement total	33 597	2 235
28	31 juill. 2024	Zuora Inc, cat. A, swap sur rendement total	347	12
64	31 juill. 2024	Zymeworks Inc, swap sur rendement total	877	109
				<u>576 738</u>
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		<u>763 264</u>

Swaps d'actions – position vendeur

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

(541)	31 juill. 2024	4D Pharma Plc, swap sur rendement total	(152)	1
(236)	31 juill. 2024	Ashtead Group Plc, swap sur rendement total	(21 668)	(2 394)
(3 008)	31 juill. 2024	Aviva Plc, swap sur rendement total	(21 980)	(666)
(5 277)	31 juill. 2024	Barclays Plc, swap sur rendement total	(13 641)	(1 073)
(884)	31 juill. 2024	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(301)	12
(5 204)	31 juill. 2024	Bmo Commercial Property Trus, swap sur rendement total	(6 342)	(468)
(3 257)	31 juill. 2024	Boohoo Group Plc, swap sur rendement total	(2 245)	(486)
(100)	31 juill. 2024	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(350)	(39)
(1 438)	31 juill. 2024	Ceres Power Holdings Plc, swap sur rendement total	(4 419)	84
(100)	31 juill. 2024	Chesnara Plc, swap sur rendement total	(440)	(9)
(1 076)	31 juill. 2024	Croda International Plc, swap sur rendement total	(91 340)	(9 446)
(1 622)	31 juill. 2024	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(2 353)	(509)
(177)	31 juill. 2024	Diageo Plc, swap sur rendement total	(8 497)	(245)
(10)	31 juill. 2024	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(187)	34
(996)	31 juill. 2024	Energean Plc, swap sur rendement total	(17 479)	(552)
(44)	31 juill. 2024	Fevertree Drinks Plc, swap sur rendement total	(776)	6
(10)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(2 343)	(245)
(1 643)	31 juill. 2024	Fresnillo Plc, swap sur rendement total	(16 416)	(278)
(398)	31 juill. 2024	Future Plc, swap sur rendement total	(5 322)	384
(111)	31 juill. 2024	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(784)	(66)
(6 745)	31 juill. 2024	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(1 118)	131
(1 139)	31 juill. 2024	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(2 033)	(127)
(6 726)	31 juill. 2024	Haleon Plc, swap sur rendement total	(36 366)	1 048
(739)	31 juill. 2024	Hilton Food Group Plc, swap sur rendement total	(9 938)	(749)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(124)	31 juill. 2024	Indivior Plc, swap sur rendement total	(2 470)	207
(6 366)	31 juill. 2024	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(6 356)	(791)
(65)	31 juill. 2024	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(337)	(24)
(1 646)	31 juill. 2024	Jubilee Metals Group Plc, swap sur rendement total	(178)	(24)
(287)	31 juill. 2024	M&G Plc, swap sur rendement total	(1 073)	(46)
(50)	31 juill. 2024	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(689)	(92)
(1 939)	31 juill. 2024	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(24 719)	(5 080)
(3 439)	31 juill. 2024	Old Mutual Ltd, swap sur rendement total	(3 185)	(403)
(2 890)	31 juill. 2024	Oxford Nanopore Technologies, swap sur rendement total	(10 114)	(670)
(777)	31 juill. 2024	Pets At Home Group Plc, swap sur rendement total	(4 215)	(14)
(2 201)	31 juill. 2024	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(19 801)	(2 528)
(100)	31 juill. 2024	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(287)	(30)
(259)	31 juill. 2024	Picton Property Income Ltd, swap sur rendement total	(301)	(22)
(526)	31 juill. 2024	Primary Health Properties, swap sur rendement total	(918)	(48)
(2 531)	31 juill. 2024	Prudential Plc, swap sur rendement total	(37 746)	(897)
(693)	31 juill. 2024	Quilter Plc, swap sur rendement total	(1 198)	(113)
(202)	31 juill. 2024	Reckitt Benckiser Group Plc, swap sur rendement total	(18 404)	(2)
(2 526)	31 juill. 2024	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(1 546)	(278)
(3 742)	31 juill. 2024	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(27 727)	(370)
(320)	31 juill. 2024	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(1 349)	(51)
(274)	31 juill. 2024	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(246)	(34)
(406)	31 juill. 2024	Serica Energy Plc, swap sur rendement total	(1 567)	(4)
(6)	31 juill. 2024	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	(1 060)	(72)
(2 046)	31 juill. 2024	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(23 511)	(1 123)
(1 578)	31 juill. 2024	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(17 645)	(988)
(656)	31 juill. 2024	Tremor International Ltd, swap sur rendement total	(2 250)	(661)
(749)	31 juill. 2024	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	(16 795)	(777)
(2)	31 juill. 2024	Woodside Energy Group, swap sur rendement total	(56)	2
(100)	31 juill. 2024	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(955)	(63)
(2 412)	31 juill. 2024	Wpp Plc, swap sur rendement total	(30 530)	(1 748)
				<u>(32 396)</u>
Euro – taux à court terme (€STR)				
(100)	31 juill. 2024	Abc Arbitrage, swap sur rendement total	(700)	40
(203)	31 juill. 2024	Adp, swap sur rendement total	(34 655)	(1 070)
(495)	31 juill. 2024	Adva Optical Networking Se, swap sur rendement total	(14 420)	25
(41)	31 juill. 2024	Adyen Nv, swap sur rendement total	(69 670)	(5 330)
(6 236)	31 juill. 2024	Aegon Nv, swap sur rendement total	(47 669)	(1 854)
(73)	31 juill. 2024	Aib Group Plc, swap sur rendement total	(413)	21
(287)	31 juill. 2024	Ald Sa, swap sur rendement total	(2 694)	(26)
(432)	31 juill. 2024	Alfen Nv, swap sur rendement total	(37 931)	(8 662)
(25)	31 juill. 2024	Altearea, swap sur rendement total	(2 913)	(408)
(333)	31 juill. 2024	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	(11 069)	(435)
(5 725)	31 juill. 2024	Amper Sa, swap sur rendement total	(697)	123
(597)	31 juill. 2024	Anora Group Oyj, swap sur rendement total	(3 791)	(153)
(15)	31 juill. 2024	Aperam, swap sur rendement total	(718)	(48)
(1 387)	31 juill. 2024	Basf Se, swap sur rendement total	(98 550)	(9 479)
(438)	31 juill. 2024	Beiersdorf Ag, swap sur rendement total	(86 575)	(4 225)
(78)	31 juill. 2024	Bike24 Holding Ag, swap sur rendement total	(167)	4
(4)	31 juill. 2024	Carl Zeiss Meditec Ag - Br, swap sur rendement total	(576)	(16)
(2 498)	31 juill. 2024	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(129 751)	(1 905)
(7)	31 juill. 2024	Construcc Y Aux De Ferrocarr, swap sur rendement total	(332)	(3)
(689)	31 juill. 2024	Cropenergies Ag, swap sur rendement total	(11 541)	(4 144)
(34)	31 juill. 2024	Cts Eventim Ag & Co Kгаа, swap sur rendement total	(3 100)	19
(449)	31 juill. 2024	Daimler Truck Holding Ag, swap sur rendement total	(22 249)	(2 180)
(14)	31 juill. 2024	Danone, swap sur rendement total	(1 197)	9
(55)	31 juill. 2024	Dassault Systemes Sa, swap sur rendement total	(3 544)	(51)
(848)	31 juill. 2024	Deutsche Lufthansa, actions ord., swap sur rendement total	(9 941)	(42)
(214)	31 juill. 2024	Deutsche Wohnen Se, swap sur rendement total	(7 462)	(486)
(27)	31 juill. 2024	Draegerwerk Ag, actions priv., swap sur rendement total	(2 037)	2
(4)	31 juill. 2024	Energiekontor Ag, swap sur rendement total	(482)	(96)
(76)	31 juill. 2024	Eurobio-Scientific, swap sur rendement total	(1 822)	(2)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(133)	31 juill. 2024	Evotee Se, swap sur rendement total	(4 123)	(474)
(12)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(2 797)	(185)
(201)	31 juill. 2024	Forfarmers Nv, swap sur rendement total	(697)	11
(2 017)	31 juill. 2024	Fortum Oyj, swap sur rendement total	(38 370)	(399)
(12)	31 juill. 2024	Galapagos Nv, swap sur rendement total	(647)	(49)
(10)	31 juill. 2024	Gaztransport Et Techniga Sa, swap sur rendement total	(1 746)	59
(186)	31 juill. 2024	Hamborner Reit Ag, swap sur rendement total	(1 845)	(87)
(11)	31 juill. 2024	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(1 227)	(81)
(966)	31 juill. 2024	Heineken Nv, swap sur rendement total	(129 366)	(10 971)
(198)	31 juill. 2024	Hella Gmbh & Co Kгаа, swap sur rendement total	(23 793)	(716)
(71)	31 juill. 2024	Hellofresh Se, swap sur rendement total	(1 480)	71
(118)	31 juill. 2024	Immobel, swap sur rendement total	(5 122)	(339)
(1 689)	31 juill. 2024	Just Eat Takeaway.Com Nv, swap sur rendement total	(33 906)	1 437
(333)	31 juill. 2024	Kamux Corp, swap sur rendement total	(2 721)	(79)
(102)	31 juill. 2024	Kerry Group Plc, A, swap sur rendement total	(11 687)	(587)
(65)	31 juill. 2024	Kesko Oyj, actions, B, swap sur rendement total	(1 697)	(29)
(205)	31 juill. 2024	Kws Saat Se & Co Kгаа, swap sur rendement total	(16 035)	(775)
(250)	31 juill. 2024	Lassila & Tikanoja Oyj, swap sur rendement total	(3 569)	(86)
(50)	31 juill. 2024	Lectra, swap sur rendement total	(2 276)	(217)
(27)	31 juill. 2024	Lna Sante, swap sur rendement total	(790)	(27)
(324)	31 juill. 2024	Mercialys, swap sur rendement total	(4 693)	(403)
(185)	31 juill. 2024	Mtu Aero Engines Ag, swap sur rendement total	(52 614)	(1 684)
(8)	31 juill. 2024	Musti Group Oy, swap sur rendement total	(304)	3
(410)	31 juill. 2024	Neoen Sa, swap sur rendement total	(18 083)	(1 275)
(43)	31 juill. 2024	Neste Oyj, swap sur rendement total	(2 017)	13
(100)	31 juill. 2024	Orange Belgium, swap sur rendement total	(1 966)	2
(487)	31 juill. 2024	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(772)	(29)
(261)	31 juill. 2024	Orion Oyj, cat. B, swap sur rendement total	(14 929)	(1 030)
(45)	31 juill. 2024	Pernod Ricard Sa, swap sur rendement total	(10 471)	23
(21)	31 juill. 2024	Pne Ag, swap sur rendement total	(423)	(50)
(1 853)	31 juill. 2024	Porsche Automobil Hldg, actions priv., swap sur rendement total	(125 021)	(3 472)
(119)	31 juill. 2024	Prosus Nv, swap sur rendement total	(4 677)	517
(800)	31 juill. 2024	Qiagen N.V., swap sur rendement total	(45 912)	(1 875)
(191)	31 juill. 2024	Raisio Oyj, actions, V, swap sur rendement total	(550)	(1)
(1)	31 juill. 2024	Robertet Sa, swap sur rendement total	(1 209)	(90)
(35)	31 juill. 2024	Sartorius Stedim Biotech, swap sur rendement total	(12 210)	(1 598)
(7)	31 juill. 2024	Secunet Security Networks Ag, swap sur rendement total	(1 489)	(57)
(55)	31 juill. 2024	Ses, swap sur rendement total	(477)	(39)
(889)	31 juill. 2024	Siemens Healthineers Ag, swap sur rendement total	(68 112)	670
(91)	31 juill. 2024	Sif Holding Nv, swap sur rendement total	(1 384)	(147)
(34)	31 juill. 2024	Stratec Se, swap sur rendement total	(2 256)	(284)
(17)	31 juill. 2024	Suedzucker Ag, swap sur rendement total	(351)	(2)
(408)	31 juill. 2024	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(4 600)	(267)
(29)	31 juill. 2024	Universal Music Group Nv, swap sur rendement total	(1 090)	(54)
(493)	31 juill. 2024	Verbio Vereinigte Bioenergi, swap sur rendement total	(21 457)	1 222
(267)	31 juill. 2024	Volitalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(4 052)	(282)
(25)	31 juill. 2024	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(927)	(110)
(14)	31 juill. 2024	Zeal Network Se, swap sur rendement total	(679)	(7)
				<u>(64 201)</u>
Dollar de Hong Kong – taux interbancaire offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(4)	31 juill. 2024	Wuxi Xdc Cayman Inc, swap sur rendement total	(22)	(2)
(4 500)	31 juill. 2024	Anhui Conch Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(13 709)	223
(4 000)	31 juill. 2024	Beijing Capital Intl Airpo, H, swap sur rendement total	(1 547)	227
(19 000)	31 juill. 2024	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	(13 700)	966
(1 400)	31 juill. 2024	China Gas Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 823)	(125)
(36 000)	31 juill. 2024	China Modern Dairy Holdings, swap sur rendement total	(4 499)	124
(2 000)	31 juill. 2024	China National Building Ma, H, swap sur rendement total	(1 128)	15
(2 500)	31 juill. 2024	Cosco Shipping Holdings Co, H, swap sur rendement total	(3 314)	(260)
(100)	31 juill. 2024	Enn Energy Holdings Ltd, swap sur rendement total	(971)	(52)
(5 000)	31 juill. 2024	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(11 128)	(313)
(1 000)	31 juill. 2024	Galaxy Entertainment Group L, swap sur rendement total	(7 388)	(401)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L) Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(11 800)	31 juill. 2024	Ganfeng Lithium Co Ltd, H, swap sur rendement total	(58 782)	(8 470)
(12 000)	31 juill. 2024	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(29 464)	227
(200)	31 juill. 2024	Hangzhou Tigermed Consulti, H, swap sur rendement total	(1 194)	177
(36 000)	31 juill. 2024	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(36 353)	(3 599)
(600)	31 juill. 2024	Hygeia Healthcare Holdings C, swap sur rendement total	(3 577)	255
(600)	31 juill. 2024	Nongfu Spring Co Ltd, H, swap sur rendement total	(4 575)	(44)
(1 000)	31 juill. 2024	Power Assets Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 641)	(736)
(4 400)	31 juill. 2024	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(16 978)	(2 403)
(3 500)	31 juill. 2024	Shanghai Fosun Pharmaceuti, H, swap sur rendement total	(10 048)	195
(5 200)	31 juill. 2024	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(17 957)	(972)
(2 000)	31 juill. 2024	Sjm Holdings Ltd, swap sur rendement total	(834)	(50)
(6 000)	31 juill. 2024	Smooere International Holding, swap sur rendement total	(6 586)	337
(2 000)	31 juill. 2024	Tsingtao Brewery Co Ltd, H, swap sur rendement total	(17 697)	(459)
(2 000)	31 juill. 2024	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(1 594)	(54)
(1 000)	31 juill. 2024	Wharf Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 247)	(691)
(51 000)	31 juill. 2024	Wheelock & Co Ltd, swap sur rendement total	(9 990)	1 566
(6 500)	31 juill. 2024	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	(32 490)	544
				(13 775)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(315)	31 juill. 2024	Astral Foods Ltd, swap sur rendement total	(3 329)	318
(4 484)	31 juill. 2024	Attacq Ltd, swap sur rendement total	(2 981)	(168)
(949)	31 juill. 2024	Blue Label Telecoms Ltd, swap sur rendement total	(265)	(7)
(3 030)	31 juill. 2024	Dis-Chem Pharmacies Pty Ltd, swap sur rendement total	(6 705)	(461)
(1 933)	31 juill. 2024	Fortress Reit Ltd, A, swap sur rendement total	(1 925)	(6)
(993)	31 juill. 2024	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	(188)	(13)
(812)	31 juill. 2024	Lighthouse Properties Plc, swap sur rendement total	(430)	(79)
(608)	31 juill. 2024	Northam Platinum Ltd, swap sur rendement total	(6 156)	(798)
(6 341)	31 juill. 2024	Pepkor Holdings Ltd, swap sur rendement total	(8 975)	(407)
(6 800)	31 juill. 2024	Pick N Pay Stores Ltd, swap sur rendement total	(11 409)	316
(1 349)	31 juill. 2024	Redefine Properties Ltd, swap sur rendement total	(374)	(34)
(7 422)	31 juill. 2024	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	(23 702)	(2 169)
(363)	31 juill. 2024	Shoprite Holdings Ltd, swap sur rendement total	(7 199)	(415)
(4 255)	31 juill. 2024	Sibanye Stillwater Ltd, swap sur rendement total	(7 639)	(1 164)
(1 534)	31 juill. 2024	Spar Group Limited/The, swap sur rendement total	(13 041)	(101)
(1 126)	31 juill. 2024	Telkom Sa Soc Ltd, swap sur rendement total	(2 415)	(349)
				(5 537)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(252)	31 juill. 2024	Assa Abloy Ab, B, swap sur rendement total	(9 572)	(635)
(474)	31 juill. 2024	Atlas Copco Ab, actions, A, swap sur rendement total	(10 763)	(310)
(15)	31 juill. 2024	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(454)	(58)
(2 063)	31 juill. 2024	Beijer Ref Ab, swap sur rendement total	(36 413)	(4 488)
(837)	31 juill. 2024	Billerudkorsnas Ab, swap sur rendement total	(11 214)	57
(114)	31 juill. 2024	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	(3 994)	(518)
(154)	31 juill. 2024	Boliden Ab, swap sur rendement total	(6 337)	(519)
(897)	31 juill. 2024	Bonava Ab, actions, B, swap sur rendement total	(1 541)	41
(118)	31 juill. 2024	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(3 273)	(530)
(1 992)	31 juill. 2024	Cint Group Ab, swap sur rendement total	(3 026)	(648)
(11 932)	31 juill. 2024	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(42 706)	(4 479)
(105)	31 juill. 2024	Epiroc Ab, A, swap sur rendement total	(2 778)	(19)
(262)	31 juill. 2024	Ericsson Lm, actions, B, swap sur rendement total	(2 163)	(69)
(21)	31 juill. 2024	Evolution Gaming Group, swap sur rendement total	(3 303)	(10)
(322)	31 juill. 2024	Garo Ab, swap sur rendement total	(1 834)	(349)
(565)	31 juill. 2024	Getinge Ab, actions, B, swap sur rendement total	(16 581)	12
(3 495)	31 juill. 2024	Hexagon Ab, actions, B, swap sur rendement total	(55 309)	(5 270)
(5 263)	31 juill. 2024	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	(18 813)	(4 456)
(20)	31 juill. 2024	Hms Networks Ab, swap sur rendement total	(1 302)	(143)
(53)	31 juill. 2024	Investment Ab Latour, actions, B, swap sur rendement total	(1 819)	(171)
(102)	31 juill. 2024	Jm Ab, swap sur rendement total	(2 369)	(408)
(336)	31 juill. 2024	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(1 054)	(366)
(182)	31 juill. 2024	Kindred Group Plc, swap sur rendement total	(2 221)	(45)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(144)	31 juill. 2024	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(5 586)	(50)
(727)	31 juill. 2024	Pandex Ab, swap sur rendement total	(14 306)	(2 144)
(100)	31 juill. 2024	Platzer Fastigheter Hold, B, swap sur rendement total	(1 102)	(111)
(2 056)	31 juill. 2024	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(12 447)	(1 177)
(1 158)	31 juill. 2024	Sedana Medical Ab, swap sur rendement total	(3 509)	(428)
(4 653)	31 juill. 2024	Sinch Ab, swap sur rendement total	(22 836)	(4 634)
(879)	31 juill. 2024	Skf Ab, actions, B, swap sur rendement total	(23 151)	(39)
(861)	31 juill. 2024	Ssab Ab, actions, B, swap sur rendement total	(8 683)	162
(326)	31 juill. 2024	Stillfront Group Ab, swap sur rendement total	(5 119)	(15)
(711)	31 juill. 2024	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(18 113)	(1 089)
(248)	31 juill. 2024	Volvo Ab, actions, B, swap sur rendement total	(8 492)	(342)
(1 600)	31 juill. 2024	Volvo Car Ab, B, swap sur rendement total	(6 816)	315
(1 168)	31 juill. 2024	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(8 359)	(1 356)
				<u>(34 289)</u>
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(280)	31 juill. 2024	Adecco Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(18 104)	373
(163)	31 juill. 2024	Avolta Ag, swap sur rendement total	(8 448)	(536)
(80)	31 juill. 2024	Baloise Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(16 519)	282
(31)	31 juill. 2024	Barry Callebaut Ag, actions ord., swap sur rendement total	(68 917)	1 601
(696)	31 juill. 2024	Cie Financière Richemont, actions ord., swap sur rendement total	(126 215)	(4 282)
(70)	31 juill. 2024	Cosmo Pharmaceuticals Nv, swap sur rendement total	(5 582)	(819)
(22)	31 juill. 2024	Daetwyler Holding Ag-Br, swap sur rendement total	(6 728)	120
(2)	31 juill. 2024	Givaudan, actions ord., swap sur rendement total	(10 917)	(652)
(58)	31 juill. 2024	Lonza Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(32 140)	(1 362)
(30 735)	31 juill. 2024	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(9 414)	678
(82)	31 juill. 2024	Molecular Partners Ag, swap sur rendement total	(442)	60
(461)	31 juill. 2024	Polypeptide Group Ag, swap sur rendement total	(12 654)	738
(38)	31 juill. 2024	Sensirion Holding Ag, swap sur rendement total	(4 965)	(195)
(46)	31 juill. 2024	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(1 182)	102
(160)	31 juill. 2024	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(33 991)	(3 448)
(1 588)	31 juill. 2024	Ubs Group Ag, actions ord., swap sur rendement total	(64 934)	(3 584)
(118)	31 juill. 2024	Zurich Insurance Group Ag, swap sur rendement total	(81 268)	713
				<u>(10 211)</u>
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(6 100)	31 juill. 2024	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(43 562)	5 462
(1 000)	31 juill. 2024	Advanced Energy Solution Hol, swap sur rendement total	(32 464)	(840)
(14)	31 juill. 2024	Al Moammar Information Syste, swap sur rendement total	(655)	(39)
(862)	31 juill. 2024	Allegro.Eu Sa, swap sur rendement total	(9 627)	(1 063)
(3 700)	31 juill. 2024	Alpek Sa De Cv, swap sur rendement total	(3 632)	58
(248)	31 juill. 2024	Alteogen Inc, swap sur rendement total	(24 947)	(4 615)
(1 132)	31 juill. 2024	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(9 722)	(966)
(1 400)	31 juill. 2024	Ambipar Participacoes E Empr, swap sur rendement total	(6 182)	(498)
(258)	31 juill. 2024	Anglogold Ashanti, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(6 358)	215
(100)	31 juill. 2024	Arca Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 440)	(88)
(5)	31 juill. 2024	Ash-Sharqiyah Development Co, swap sur rendement total	(32)	-
(45)	31 juill. 2024	Astrazeneca Plc, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(3 996)	(138)
(300)	31 juill. 2024	Banco Bradesco S.A., swap sur rendement total	(1 297)	(146)
(1 700)	31 juill. 2024	Banco Pan Sa, swap sur rendement total	(3 991)	(362)
(1 174)	31 juill. 2024	Bank Albilad, swap sur rendement total	(18 555)	(2 687)
(13 802)	31 juill. 2024	Becele Sab De Cv, swap sur rendement total	(35 660)	(4 325)
(32 400)	31 juill. 2024	Bts Group Holdings Pel, swap sur rendement total	(9 000)	(158)
(1 000)	31 juill. 2024	Century Iron & Steel Indus, swap sur rendement total	(7 523)	(447)
(35)	31 juill. 2024	Chunbo Co Ltd, swap sur rendement total	(3 939)	(73)
(12 700)	31 juill. 2024	Cosan Sa Industria Comercio, swap sur rendement total	(66 814)	(6 192)
(4 200)	31 juill. 2024	Cp Aextra Pel, swap sur rendement total	(4 345)	(76)
(18)	31 juill. 2024	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	(1 303)	(316)
(28 700)	31 juill. 2024	Cvc Brasil Operadora E Agenc, swap sur rendement total	(27 296)	272
(1 714)	31 juill. 2024	Cyfrowy Polsat Sa, swap sur rendement total	(7 082)	241
(11)	31 juill. 2024	Dallah Healthcare Co, swap sur rendement total	(664)	(19)
(208)	31 juill. 2024	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(4 928)	250
(7 400)	31 juill. 2024	Dufu Technology Corp Bhd, swap sur rendement total	(4 035)	(322)
(6 700)	31 juill. 2024	Duopharma Biotech Bhd, swap sur rendement total	(2 423)	(122)
(484)	31 juill. 2024	Dutch Bros Inc, cat. A, swap sur rendement total	(20 212)	(2 303)
(207)	31 juill. 2024	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(60 883)	(2 750)
(58)	31 juill. 2024	Ecopro Co Ltd, swap sur rendement total	(38 324)	6 150

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(7 800)	31 juill. 2024	Eneva Sa, swap sur rendement total	(28 848)	(2 201)
(600)	31 juill. 2024	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(1 378)	(248)
(1 500)	31 juill. 2024	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(7 622)	(221)
(976)	31 juill. 2024	Fitaihi Holding Group, swap sur rendement total	(1 060)	(10)
(16 800)	31 juill. 2024	Fleury Sa, swap sur rendement total	(82 357)	(4 865)
(300)	31 juill. 2024	Gafisa Sa, swap sur rendement total	(849)	(286)
(18 800)	31 juill. 2024	Genting Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(14 513)	(268)
(38)	31 juill. 2024	Grand Korea Leisure Co Ltd, swap sur rendement total	(524)	(13)
(153)	31 juill. 2024	Groupon Inc, swap sur rendement total	(2 590)	(299)
(20)	31 juill. 2024	Gruma S.A.B., B, swap sur rendement total	(483)	5
(485)	31 juill. 2024	Grupo Aeroport Del Pacific, B, swap sur rendement total	(11 165)	(1 261)
(565)	31 juill. 2024	Grupo Aeroport Del Sureste, B, swap sur rendement total	(21 827)	(4 172)
(15 600)	31 juill. 2024	Grupo De Moda Soma Sa, swap sur rendement total	(31 582)	(6 521)
(7 724)	31 juill. 2024	Grupo Televisa Sa, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(34 017)	(1 070)
(5 700)	31 juill. 2024	Guan Chong Bhd, swap sur rendement total	(3 026)	61
(1 800)	31 juill. 2024	Hap Seng Plantations Hldgs, swap sur rendement total	(888)	26
(57 600)	31 juill. 2024	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(69 653)	(2 044)
(1 000)	31 juill. 2024	Hextar Global Bhd, swap sur rendement total	(222)	(15)
(8 000)	31 juill. 2024	Htc Corp, swap sur rendement total	(17 693)	(805)
(6)	31 juill. 2024	Humasis Co Ltd, swap sur rendement total	(12)	1
(2)	31 juill. 2024	Hyatt Hotels Corp, cat. A, swap sur rendement total	(344)	(40)
(100)	31 juill. 2024	Industrias Penoles Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 928)	15
(13 500)	31 juill. 2024	Infracommerce Cxaas Sa, swap sur rendement total	(6 787)	(770)
(16)	31 juill. 2024	Intellian Technologies Inc, swap sur rendement total	(1 185)	68
(344)	31 juill. 2024	Jastrzebska Spolka Weglowa S, swap sur rendement total	(4 845)	(257)
(36 500)	31 juill. 2024	Jwd Infologistics Pcl, swap sur rendement total	(21 537)	(1 755)
(468)	31 juill. 2024	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	(7 647)	(214)
(992)	31 juill. 2024	Kghm Polska Miedz Sa, swap sur rendement total	(40 790)	(2 768)
(23 000)	31 juill. 2024	Kinsus Interconnect Tech, swap sur rendement total	(98 862)	(1 678)
(576)	31 juill. 2024	Kt&G Corp, swap sur rendement total	(51 118)	944
(368)	31 juill. 2024	L&C Bio Co Ltd, swap sur rendement total	(10 962)	1 629
(1 100)	31 juill. 2024	La Comer Sab De Cv, swap sur rendement total	(3 733)	(528)
(40)	31 juill. 2024	Lg Energy Solution, swap sur rendement total	(17 463)	1 168
(700)	31 juill. 2024	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(4 337)	(15)
(3 000)	31 juill. 2024	Lotus Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(35 180)	(2 347)
(119)	31 juill. 2024	Lucid Group Inc, swap sur rendement total	(661)	11
(10 000)	31 juill. 2024	Macronix International, swap sur rendement total	(13 516)	(1 334)
(5)	31 juill. 2024	Match Group Inc, swap sur rendement total	(241)	(14)
(1)	31 juill. 2024	Methanol Chemicals Co, swap sur rendement total	(7)	-
(106)	31 juill. 2024	Moderna Inc, swap sur rendement total	(13 900)	(2 948)
(16)	31 juill. 2024	MongodB Inc, swap sur rendement total	(8 626)	195
(12 000)	31 juill. 2024	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(3 978)	307
(200)	31 juill. 2024	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	(610)	(90)
(3 000)	31 juill. 2024	Nan Ya Plastics Corp, swap sur rendement total	(8 601)	22
(65)	31 juill. 2024	Ncsoft Co, swap sur rendement total	(15 965)	1 490
(45 500)	31 juill. 2024	Nemak Sab De Cv, swap sur rendement total	(14 629)	(1 054)
(1 500)	31 juill. 2024	Omega Energia Sa, swap sur rendement total	(4 162)	(348)
(1 000)	31 juill. 2024	Oneness Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	(8 385)	288
(4 200)	31 juill. 2024	Operadora De Sites Mex, A-1, swap sur rendement total	(7 808)	(817)
(900)	31 juill. 2024	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(2 629)	(84)
(90)	31 juill. 2024	Oscotec Inc, swap sur rendement total	(2 119)	(357)
(36 400)	31 juill. 2024	Pet Center Comercio E Partic, swap sur rendement total	(39 135)	1 285
(2 000)	31 juill. 2024	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(11 804)	(1 007)
(3 000)	31 juill. 2024	Pharmaessentia Corp, swap sur rendement total	(44 751)	1 536
(5 920)	31 juill. 2024	Polski Koncern Naftowy Orlen, swap sur rendement total	(129 946)	(13 984)
(212)	31 juill. 2024	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	(77 725)	(7 223)
(14 000)	31 juill. 2024	Powerchip Semiconductor Manu, swap sur rendement total	(17 775)	32
(800)	31 juill. 2024	Precious Shipping Pcl, swap sur rendement total	(265)	(11)
(2)	31 juill. 2024	Qassim Cement/The, swap sur rendement total	(45)	-
(900)	31 juill. 2024	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(4 913)	(1 230)
(3 000)	31 juill. 2024	Quanta Computer Inc, swap sur rendement total	(29 036)	(3 445)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Swaps sur rendement total (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché \$	Plus-value (moins-value) latente \$
(149)	31 juill. 2024	Red Sea International Co, swap sur rendement total	(1 208)	7
(2)	31 juill. 2024	Sadr Logistics Co, swap sur rendement total	(2)	–
(200)	31 juill. 2024	Santos Brasil Participacoes, swap sur rendement total	(513)	(61)
(5)	31 juill. 2024	Saudi Airlines Catering Co, swap sur rendement total	(222)	(22)
(3 682)	31 juill. 2024	Saudi Arabian Mining Co, swap sur rendement total	(57 159)	(5 408)
(371)	31 juill. 2024	Saudi Tadawul Group Holding, swap sur rendement total	(23 951)	(23)
(322)	31 juill. 2024	Saudi Vitrified Clay Pipe Co, swap sur rendement total	(5 474)	(623)
(15)	31 juill. 2024	Sk Biopharmaceuticals Co Ltd, swap sur rendement total	(1 538)	(214)
(205)	31 juill. 2024	Takween Advanced Industries, swap sur rendement total	(1 101)	(57)
(17)	31 juill. 2024	Trade Desk Inc/The, cat. A, swap sur rendement total	(1 613)	(23)
(400)	31 juill. 2024	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(4 172)	(260)
(15)	31 juill. 2024	Umm Al-Qura Cement Co, swap sur rendement total	(90)	(2)
(720)	31 juill. 2024	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(67)	(1)
(9 000)	31 juill. 2024	Unimicron Technology Corp, swap sur rendement total	(68 290)	(912)
(800)	31 juill. 2024	Uwc Bhd, swap sur rendement total	(808)	(37)
(17 700)	31 juill. 2024	Vamos Locacao De Caminhoes M, swap sur rendement total	(49 970)	(6 005)
(17)	31 juill. 2024	Vaxcell-Bio Therapeutics, swap sur rendement total	(390)	(66)
(13 700)	31 juill. 2024	Vgi Pcl, swap sur rendement total	(1 013)	13
(4 000)	31 juill. 2024	Walsin Lihwa Corp, swap sur rendement total	(6 665)	(86)
(2 000)	31 juill. 2024	Wan Hai Lines Ltd, swap sur rendement total	(4 742)	(789)
(1 000)	31 juill. 2024	Win Semiconductors Corp, swap sur rendement total	(6 855)	573
Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur				<u>(89 427)</u>
				<u>(249 836)</u>
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total				<u>922 862</u>
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total				<u>(409 434)</u>
Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net				<u>513 428</u>

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

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

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

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

Parallèlement au changement de raison sociale indiqué ci-dessus, l'objectif du Fonds a également changé. L'objectif de placement du Fonds est de procurer une appréciation du capital à long terme et un rendement attrayant redressé en fonction du risque sur une longue période de temps, en investissant dans un portefeuille composé de titres et de contrats dérivés ainsi qu'en employant des stratégies d'actions longues/courtes.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 31 décembre 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	1 356 952 \$	– \$	– \$	1 356 952 \$
Actions américaines – position acheteur	1 577 277	344	–	1 577 621
Actions étrangères – position acheteur	6 546 909	14 641	–	6 561 550
Contrats de change à terme	–	362 813	–	362 813
Contrats de swap	–	922 862	–	922 862
	9 481 138 \$	1 300 660 \$	– \$	10 781 798 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 008 634 \$	1 645 \$	– \$	1 010 279 \$
Actions américaines – position vendeur	6 343 029	–	–	6 343 029
Actions étrangères – position vendeur	4 329 094	1 779	–	4 330 873
Contrats de change à terme	–	112 715	–	112 715
Contrats de swap	–	409 434	–	409 434
	11 680 757 \$	525 573 \$	– \$	12 206 330 \$

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

Au 31 décembre 2022

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

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

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

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, 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
2023					
Série A	48 055	4 852	–	(8 315)	44 592
Série F	313 938	125 901	211	(280 971)	159 079
Série I	1 454 887	1 381	14 136	(453 293)	1 017 111
2022					
Série A	41 855	4 013	4 215	(2 028)	48 055
Série F	35 406	333 401	32 164	(87 033)	313 938
Série I	2 004 975	2 763	157 173	(710 024)	1 454 887

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2023, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de néant (néant en 2022) 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 2022).

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

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

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

Frais de gestion

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

Rémunération au rendement

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

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 31 décembre 2023, CCLFGII détenait 975 715 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 733 063 \$ (1 412 779 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 14 387 318 \$ en 2022). Au 31 décembre 2023, GFCC&L détenait 6 867 parts de série A, 7 047 parts de série F et 7 380 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 73 372 \$, de 76 887 \$ et de 81 185 \$ (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 \$ en 2022).

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

Le Fonds a payé 36 864 \$ (23 511 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Les paiements indirects effectués pour l'exercice se sont élevés à 7 673 \$ (4 401 \$ en 2022).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

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

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

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

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar australien	26 572	(360 798)	(334 226)	(2,5)	(16 711)
Réal brésilien	10	–	10	–	1
Livre sterling	48 903	141 200	190 103	1,4	9 505
Renminbi chinois	30	(86 454)	(86 424)	(0,6)	(4 321)
Couronne danoise	214 189	(330 610)	(116 421)	(0,9)	(5 821)
Euro	87 782	(184 987)	(97 205)	(0,7)	(4 860)
Dollar de Hong Kong	56 667	(198 418)	(141 751)	(1,0)	(7 088)
Forint hongrois	12 165	–	12 165	0,1	608
Roupie indonésienne	3 288	–	3 288	–	164
Nouveau shekel israélien	11 456	(221 543)	(210 087)	(1,6)	(10 504)
Yen japonais	176 249	(1 237 714)	(1 061 465)	(7,9)	(53 073)
Ringgit malaisien	427	–	427	–	21
Peso mexicain	96	–	96	–	5
Dollar néo-zélandais	11 564	(131 075)	(119 511)	(0,9)	(5 976)
Couronne norvégienne	97 029	(424 182)	(327 153)	(2,4)	(16 358)
Zloty polonais	12 390	–	12 390	0,1	620
Dollar de Singapour	5 000	(410 844)	(405 844)	(3,0)	(20 292)
Rand sud-africain	15 236	–	15 236	0,1	762
Won sud-coréen	107	–	107	–	5
Couronne suédoise	106 198	(142 879)	(36 681)	(0,3)	(1 834)
Franc suisse	53 155	–	53 155	0,4	2 658
Lire turque	(25 864)	–	(25 864)	(0,2)	(1 293)
Dollar américain	14 224 750	(9 021 905)	5 202 845	38,8	260 142
Total	15 137 399	(12 610 209)	2 527 190	18,9	126 360

Au 31 décembre 2022

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

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

Risque de taux d'intérêt

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

Autre risque de prix

Aux 31 décembre 2023 et 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix, principalement en raison de ses placements en actions négociées sur des bourses. La quasi-totalité de l'actif net du Fonds attribuable aux porteurs de parts rachetables est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions négociées avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 219 000 \$ (augmenté ou diminué d'environ 1 734 000 \$ en 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2023 et 2022, le risque de crédit était négligeable, car l'exposition du Fonds aux titres de créance n'était pas importante. Le Fonds était exposé au risque de crédit du fait de ses placements dans des instruments dérivés. Les gains latents sur les obligations contractuelles avec les contreparties correspondaient à 9,6 % (1,9 % en 2022) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Les contreparties aux instruments dérivés avaient toutes obtenu une notation de A ou mieux (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 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023	2022
	(\$)	(\$)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	3 055	3 276
Charges liées au prêt de titres	(609)	(650)
Revenus nets tirés du prêt de titres	2 446	2 626
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(56)	(132)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	2 390	2 494

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

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

	2023	2022
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	125	909
Garanties reçues	131	954
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

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

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 63,2 % à 141,5 % (de 65,4 % à 130,8 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 123,8 % (73,7 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 6 661 984 \$ (de 2 518 906 \$ à 12 262 358 \$ en 2022) avec un taux d'intérêt moyen de 5,43 % (1,98 % en 2022). Au 31 décembre 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,0 % (18,3 % en 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2023	2022
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	36 586 \$	39 867 \$
Placements à court terme	1 395 867	428 412
Placements	50 537 522	50 654 800
Plus-value latente des contrats de change à terme	111 191	114 467
Plus-value latente des contrats à terme normalisés	487 170	232 781
Plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit	544	573
Marge de variation quotidienne	1 362 651	770 090
Montant à recevoir du courtier	–	69 357
Intérêts à recevoir	442 801	559 924
Autres créances	50	47
Souscriptions à recevoir	231 912	300
	54 606 294	52 870 618
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	–	526 167
Placements à court terme vendus à découvert	–	4 820 910
Placements vendus à découvert	25 888 103	19 391 897
Moins-value latente des contrats de change à terme	244 182	22 483
Moins-value latente des contrats à terme sur obligations	92 887	–
Moins-value latente des contrats à terme normalisés	903 028	180 575
Moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit	–	218
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	333 237	287 527
Montant à payer au courtier	–	542 781
Frais d'emprunt de titres à payer	6 903	9 001
Charges à payer	49 934	58 002
Frais de gestion à payer	574	748
	27 518 848	25 840 309
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	27 087 446 \$	27 030 309 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	266 718 \$	105 001 \$
Série F	925 166 \$	1 630 088 \$
Série I	25 895 562 \$	25 295 220 \$
	<hr/>	<hr/>
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	33 497	13 264
Série F	111 213	199 147
Série I	2 961 119	2 959 236
	<hr/>	<hr/>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	7,96 \$	7,92 \$
Série F	8,32 \$	8,19 \$
Série I	8,75 \$	8,55 \$
	<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

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(13 519) \$	(96 512) \$
Variation du gain (perte) de change latent	26 009	(19 820)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	1 967	3 390
Autres revenus (pertes)	–	12 000
Gain (perte) net sur placements		
Intérêts aux fins des distributions	2 176 565	2 282 060
Charges d'intérêts sur les titres vendus à découvert	(1 110 955)	(1 100 102)
Gain (perte) net réalisé sur les placements	(26 102)	(2 781 790)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(71 732)	1 338 662
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	109 206	(701 177)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	(419 195)	233 303
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	(5 940)	(441 324)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	3 095 022	(1 706 523)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(1 266 042)	833 651
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	(224 975)	54 330
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme sur obligations	(92 887)	–
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés	(468 064)	32 365
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	189	70 320
Gain (perte) net total sur placements	<u>1 695 090</u>	<u>(1 886 225)</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>1 709 547</u>	<u>(1 987 167)</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	25 611	32 167
Honoraires des dépositaires	61 101	73 686
Frais de dépôt	19 047	22 251
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 464	4 711
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	578	642
Charges d'intérêts	890	2 980
Frais de gestion	10 528	12 687
Rémunération au rendement	37	13
Honoraires de professionnels	10 679	13 620
Coût d'emprunt de titres	103 590	139 317
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	14 039	11 647
Coûts de transaction (note 9)	17 046	9 322
Total des charges d'exploitation	<u>267 610</u>	<u>323 043</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>1 441 937 \$</u>	<u>(2 310 210) \$</u>

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	6 592 \$	(7 349) \$
Série F	58 909 \$	(193 917) \$
Série I	1 376 436 \$	(2 108 944) \$
	<hr/>	<hr/>
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	25 832	11 866
Série F	152 941	253 358
Série I	3 002 393	3 038 482
	<hr/>	<hr/>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	0,26 \$	(0,62) \$
Série F	0,39 \$	(0,77) \$
Série I	0,46 \$	(0,69) \$
	<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 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	105 001 \$	99 388 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	6 592	(7 349)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	193 000	26 000
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	2 608	7 021
Rachat de parts rachetables	(34 143)	(11 089)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	161 465	21 932
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(5 845)	(8 970)
Remboursement de capital	(495)	–
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(6 340)	(8 970)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	161 717	5 613
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	266 718 \$	105 001 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	1 630 088 \$	2 781 622 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	58 909	(193 917)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	56 718	760 371
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	23 480	101 500
Rachat de parts rachetables	(806 415)	(1 657 342)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(726 217)	(795 471)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(34 675)	(162 146)
Remboursement de capital	(2 939)	–
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(37 614)	(162 146)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(704 922)	(1 151 534)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	925 166 \$	1 630 088 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

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 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	25 295 220 \$	33 901 148 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 376 436	(2 108 944)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	483 122	1 909 847
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	778 894	2 290 430
Rachat de parts rachetables	(1 259 216)	(8 406 831)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	2 800	(4 206 554)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(718 043)	(2 290 430)
Remboursement de capital	(60 851)	—
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(778 894)	(2 290 430)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	600 342	(8 605 928)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	25 895 562 \$	25 295 220 \$
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	27 030 309 \$	36 782 158 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 441 937	(2 310 210)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	732 840	2 696 218
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	804 982	2 398 951
Rachat de parts rachetables	(2 099 774)	(10 075 262)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(561 952)	(4 980 093)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	(758 563)	(2 461 546)
Remboursement de capital	(64 285)	—
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(822 848)	(2 461 546)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	57 137	(9 751 849)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	27 087 446 \$	27 030 309 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 441 937 \$	(2 310 210) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(26 009)	19 820
(Gain) perte net réalisé sur les placements	26 102	2 781 790
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	71 732	(1 338 662)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(3 095 022)	1 706 523
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	1 266 042	(833 651)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	224 975	(54 330)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme sur obligations	92 887	-
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme normalisés	468 064	(32 365)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	(189)	(70 320)
Achat de placements	(430 883 651)	(490 774 669)
Produit des placements vendus	432 966 492	497 768 458
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	(592 561)	(220 660)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	117 123	(9 683)
(Augmentation) diminution des autres créances	(3)	(47)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	(2 098)	8 890
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	45 710	119 882
Augmentation (diminution) des charges à payer	(8 068)	22 605
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(174)	(618)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	-	(4 408)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	2 113 289	6 778 345
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	501 228	2 704 867
Rachat de parts rachetables**	(2 099 774)	(10 074 211)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	(17 866)	(62 595)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(1 616 412)	(7 431 939)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	496 877	(653 594)
Variation du gain (perte) de change latent	26 009	(19 820)
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	39 867	852 931
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(526 167)	(665 817)
	36 586	(486 300)
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	36 586 \$	39 867 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	- \$	(526 167) \$
	36 586 \$	(486 300) \$
Intérêts reçus*	2 293 688 \$	2 272 377 \$
Intérêts payés*	(1 066 135)	(983 200)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Placements à court terme – position acheteur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : 1,58 %)						
Bons du Trésor du Canada*	10,066	4 janv. 2024	700 000	693 252	699 420	
Bons du Trésor du Canada	5,099	29 fév. 2024	5 000	4 941	4 958	
Bons du Trésor du Canada	5,078	14 mars 2024	40 000	39 494	39 585	
Bons du Trésor du Canada	5,068	28 mars 2024	660 000	651 459	651 904	
				<u>1 389 146</u>	<u>1 395 867</u>	5,15
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>1 389 146</u>	<u>1 395 867</u>	5,15
Placements à court terme – position vendeur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : -17,84 %)						
Obligations – position acheteur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2022 : 16,20 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	3,500	1 ^{er} août 2025	3 121 000	3 056 456	3 094 348	
Obligations du gouvernement du Canada	0,500	1 ^{er} sept. 2025	492 000	459 967	465 205	
Obligations du gouvernement du Canada	4,500	1 ^{er} nov. 2025	5 448 000	5 484 267	5 506 610	
Obligations du gouvernement du Canada	1,500	1 ^{er} déc. 2031	13 837 000	11 381 708	12 285 115	
Obligations du gouvernement du Canada	2,500	1 ^{er} déc. 2032	24 000	22 866	22 882	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} déc. 2064	211 000	239 795	200 234	
Obligations à rendement réel du gouvernement du Canada	0,610	1 ^{er} déc. 2050	755 000	670 645	736 686	
				<u>21 315 704</u>	<u>22 311 080</u>	82,37
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2022 : 5,60 %)						
Province de Québec	3,250	1 ^{er} sept. 2032	2 045 000	1 977 883	1 977 310	7,30
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : 46,55 %)						
AltaLink LP	1,509	11 sept. 2030	55 000	45 997	46 842	
ARC Resources Ltd.	2,354	10 mars 2026	138 000	127 955	131 599	
Banque de Montréal	3,650	1 ^{er} avril 2027	594 000	566 633	579 368	
Capital Power Corp.	4,986	23 janv. 2026	155 000	151 767	154 632	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	2,057	17 juin 2027	73 000	63 366	66 455	
Société en commandite Sommet Industriel Dream	2,250	12 janv. 2027	40 000	35 567	37 010	
Emera Inc.	6,750	15 juin 2076	505 000	658 605	654 553	
Enbridge Inc.	5,375	27 sept. 2077	91 000	85 030	85 779	
Enbridge Inc.	6,625	12 avril 2078	17 000	16 768	16 769	
Enbridge Inc.	5,000	19 janv. 2082	45 000	38 728	38 429	
Inter Pipeline Ltd.	4,232	1 ^{er} juin 2027	536 000	508 716	526 930	
Inter Pipeline Ltd.	5,760	17 fév. 2028	1 120 000	1 128 332	1 156 311	
Inter Pipeline Ltd.	6,590	9 fév. 2034	60 000	59 977	64 585	
Keyera Corp.	6,875	13 juin 2079	14 000	13 195	13 594	
Keyera Corp.	5,950	10 mars 2081	103 000	89 739	91 379	
Banque Nationale du Canada	5,296	3 nov. 2025	438 000	440 439	442 135	
Banque Nationale du Canada	5,219	14 juin 2028	461 000	459 940	474 798	
Banque Nationale du Canada	5,426	16 août 2032	486 000	481 297	491 522	
Nova Scotia Power Inc.	4,951	15 nov. 2032	344 000	345 256	347 670	
Nova Scotia Power Inc.	6,950	25 août 2033	25 000	28 744	28 757	
Nova Scotia Power Inc.	4,150	6 mars 2042	18 000	14 331	16 130	
Nova Scotia Power Inc.	3,307	25 avril 2050	57 000	41 365	43 170	
Pembina Pipeline Corp.	4,800	25 janv. 2081	290 000	241 710	245 486	
Primaris REIT	5,934	29 mars 2028	14 000	13 774	14 259	
Fonds de placement immobilier RioCan	5,962	1 ^{er} oct. 2029	210 000	209 929	216 120	
Rogers Communications Inc.	4,400	2 nov. 2028	314 000	299 477	312 734	
Rogers Communications Inc.	3,300	10 déc. 2029	13 000	11 344	12 132	
Rogers Communications Inc.	5,000	17 déc. 2081	192 000	192 000	183 106	
Banque Royale du Canada	5,235	2 nov. 2026	194 000	194 025	198 045	
La Banque Toronto-Dominion	5,423	10 juil. 2026	218 000	218 000	222 754	
La Banque Toronto-Dominion	2,260	7 janv. 2027	312 000	281 802	293 609	
TransCanada Trust	4,650	18 mai 2077	226 000	220 526	206 637	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Transcanada Trust	4,200	4 mars 2081	80 000	65 235	66 022	
				7 349 569	7 479 321	27,61
Obligations de sociétés américaines (31 décembre 2022 : 112,77 %)						
AdaptHealth LLC	6,125	1 ^{er} août 2028	53 000	60 398	60 393	
AdaptHealth LLC	4,625	1 ^{er} août 2029	161 000	177 495	164 113	
AdaptHealth LLC	5,125	1 ^{er} mars 2030	413 000	445 127	425 511	
Albertsons Cos Inc.	3,500	15 mars 2029	361 000	417 471	432 770	
American Axle & Manufacturing Inc.	6,875	1 ^{er} juil. 2028	309 000	391 821	400 767	
Avis Budget Car Rental LLC	4,750	1 ^{er} avril 2028	70 000	86 013	85 068	
Avis Budget Car Rental LLC	8,000	15 fév. 2031	519 000	696 147	684 001	
Cable One Inc.	4,000	15 nov. 2030	732 000	806 932	782 677	
Charter Communications Operating LLC	5,050	30 mars 2029	9 000	11 368	11 751	
CHS/Community Health Systems Inc.	8,000	15 mars 2026	311 000	401 433	409 087	
Cinemark USA Inc.	5,875	15 mars 2026	318 000	395 352	410 803	
Cinemark USA Inc.	5,250	15 juil. 2028	868 000	1 041 753	1 051 127	
CSC Holdings LLC	11,250	15 mai 2028	17 000	22 952	23 113	
CSC Holdings LLC	4,500	15 nov. 2031	41 000	38 398	40 942	
Dana Inc.	5,625	15 juin 2028	293 000	380 633	381 261	
Dana Inc.	4,250	1 ^{er} sept. 2030	75 000	80 584	87 780	
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8,500	1 ^{er} mai 2028	79 000	102 477	102 718	
Ford Motor Co.	3,250	12 fév. 2032	773 000	823 316	848 163	
Ford Motor Credit Co LLC	4,271	9 janv. 2027	152 000	193 728	192 341	
Ford Motor Credit Co LLC	2,900	10 fév. 2029	69 000	78 273	79 756	
Ford Motor Credit Co LLC	5,113	3 mai 2029	28 000	35 390	35 937	
Ford Motor Credit Co LLC	4,000	13 nov. 2030	72 000	83 689	85 258	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,250	30 avril 2031	74 000	87 147	89 400	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,250	15 juil. 2031	67 000	79 645	80 267	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,625	30 avril 2033	83 000	98 408	98 231	
Gray Escrow II Inc.	5,375	15 nov. 2031	287 000	260 726	285 947	
Gray Television Inc.	7,000	15 mai 2027	133 000	150 165	166 860	
Hertz Corp.	5,000	1 ^{er} déc. 2029	580 000	619 484	628 352	
iHeartCommunications Inc.	6,375	1 ^{er} mai 2026	131 000	142 881	147 438	
iHeartCommunications Inc.	5,250	15 août 2027	273 000	269 190	286 370	
LifePoint Health Inc.	9,875	15 août 2030	382 000	511 384	509 669	
LifePoint Health Inc.	11,000	15 oct. 2030	315 000	416 980	437 955	
Nexstar Media Inc.	4,750	1 ^{er} nov. 2028	247 000	280 642	300 383	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	6,375	15 août 2025	118 000	157 016	156 694	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	7,250	15 mai 2031	376 000	510 481	503 300	
Premier Entertainment Sub LLC	5,625	1 ^{er} sept. 2029	67 000	65 907	70 762	
Scripps Escrow Inc.	5,875	15 juil. 2027	471 000	512 352	552 350	
Sinclair Television Group Inc.	5,500	1 ^{er} mars 2030	57 000	42 314	56 469	
Sinclair Television Group Inc.	4,125	1 ^{er} déc. 2030	80 000	70 150	74 500	
Station Casinos LLC	4,500	15 fév. 2028	466 000	559 438	579 805	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	15 juin 2030	153 000	195 890	204 235	
United Rentals North America Inc.	5,250	15 janv. 2030	194 000	249 953	252 167	
United Rentals North America Inc.	3,875	15 fév. 2031	701 000	810 779	840 963	
Obligation du Trésor des États-Unis	3,875	15 août 2033	172 000	217 512	226 587	
Obligation du Trésor des États-Unis	4,500	15 nov. 2033	347 000	483 557	480 503	
Obligation du Trésor des États-Unis	4,375	15 août 2043	80 000	100 489	107 713	
Obligation du Trésor des États-Unis	3,625	15 mai 2053	2 138 000	2 356 253	2 607 069	
Verizon Communications Inc.	2,550	21 mars 2031	157 000	190 670	178 560	
VMware LLC	1,800	15 août 2028	729 000	881 165	843 400	
				17 091 328	17 561 286	64,83
Obligations étrangères (31 décembre 2022 : 6,28 %)						
NXP BV / NXP Funding LLC	4,300	18 juin 2029	353 000	442 972	452 554	
NXP BV / NXP Funding LLC	3,400	1 ^{er} mai 2030	256 000	303 882	310 368	
Perrigo Finance Unlimited Co.	3,150	15 juin 2030	371 000	446 012	445 603	
				1 192 866	1 208 525	4,46
Total des obligations – position acheteur				48 927 350	50 537 522	186,57

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Obligations – position vendeur						
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2022 : -6,19 %)						
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1 ^{er} juin 2033	(26 000)	(25 266)	(25 269)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,000	1 ^{er} déc. 2051	(1 109 000)	(826 891)	(893 268)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,750	1 ^{er} déc. 2053	(2 249 000)	(1 556 788)	(1 690 092)	
				(2 408 945)	(2 608 629)	(9,63)
Obligations provinciales canadiennes (31 décembre 2022 : -12,96 %)						
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : -14,86 %)						
407 International Inc.	2,840	7 mars 2050	(91 000)	(65 183)	(68 788)	
Aéroports de Montréal	3,441	26 avril 2051	(49 000)	(39 111)	(42 182)	
Air Canada	3,875	15 août 2026	(11 000)	(14 005)	(13 867)	
Autorité aéroportuaire de Calgary	3,554	7 oct. 2053	(366 000)	(303 517)	(315 276)	
Enbridge Gas Inc.	4,950	22 nov. 2050	(37 000)	(39 003)	(39 165)	
Enbridge Inc.	4,100	21 sept. 2051	(44 000)	(35 209)	(36 676)	
EPCOR Utilities Inc.	4,725	2 sept. 2052	(21 000)	(21 257)	(22 008)	
Great-West Lifeco Inc.	2,981	8 juil. 2050	(230 000)	(201 512)	(178 562)	
Hydro One Inc.	4,460	27 janv. 2053	(53 000)	(51 017)	(53 310)	
Intact Corporation financière	3,765	20 mai 2053	(432 000)	(330 821)	(380 907)	
Inter Pipeline Ltd.	5,091	27 nov. 2051	(379 000)	(305 974)	(343 712)	
Les Compagnies Loblaw ltée	5,336	13 sept. 2052	(158 000)	(172 002)	(171 594)	
Ontario Power Generation Inc.	3,651	13 sept. 2050	(462 000)	(470 598)	(396 610)	
Toronto Hydro Corp.	4,950	13 oct. 2052	(232 000)	(238 132)	(253 193)	
La Banque Toronto-Dominion	2,667	9 sept. 2025	(46 000)	(43 359)	(44 490)	
TransCanada PipeLines Ltd.	5,920	12 mai 2052	(148 000)	(145 834)	(161 284)	
				(2 476 534)	(2 521 624)	(9,31)
Obligations américaines (31 décembre 2022 : -37,73 %)						
Allison Transmission Inc.	5,875	1 ^{er} juin 2029	(372 000)	(472 484)	(489 340)	
Allison Transmission Inc.	3,750	30 janv. 2031	(2 000)	(2 271)	(2 333)	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	6,000	15 juin 2027	(461 000)	(602 694)	(606 077)	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	4,000	1 ^{er} sept. 2029	(25 000)	(27 323)	(27 946)	
Asbury Automotive Group Inc.	4,625	15 nov. 2029	(706 000)	(819 854)	(862 714)	
Asbury Automotive Group Inc.	5,000	15 fév. 2032	(18 000)	(20 366)	(21 598)	
AT&T Inc.	5,400	15 fév. 2034	(450 000)	(614 059)	(612 191)	
AT&T Inc.	3,500	15 sept. 2053	(30 000)	(29 252)	(28 740)	
Ball Corp.	6,875	15 mars 2028	(141 000)	(197 945)	(193 279)	
Ball Corp.	6,000	15 juin 2029	(586 000)	(792 333)	(790 026)	
Bloomin' Brands Inc.	5,125	15 avril 2029	(191 000)	(226 711)	(232 573)	
Centene Corp.	2,500	1 ^{er} mars 2031	(227 000)	(233 076)	(249 791)	
Century Communities Inc.	3,875	15 août 2029	(369 000)	(430 629)	(440 953)	
Charter Communications Operating LLC	2,300	1 ^{er} fév. 2032	(386 000)	(384 095)	(405 413)	
Charter Communications Operating LLC	5,250	1 ^{er} avril 2053	(292 000)	(293 190)	(322 982)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	5,125	15 août 2027	(589 000)	(714 445)	(741 905)	
CNX Resources Corp.	7,375	15 janv. 2031	(658 000)	(872 138)	(874 642)	
Conagra Brands Inc.	5,400	1 ^{er} nov. 2048	(22 000)	(32 573)	(28 133)	
Crown Americas LLC	5,250	1 ^{er} avril 2030	(139 000)	(175 600)	(180 703)	
Encompass Health Corp.	4,750	1 ^{er} fév. 2030	(195 000)	(241 375)	(242 426)	
General Motors Co.	5,400	1 ^{er} avril 2048	(156 000)	(179 906)	(188 218)	
Griffon Corp.	5,750	1 ^{er} mars 2028	(1 008 000)	(1 255 314)	(1 307 597)	
HCA Inc.	5,900	1 ^{er} juin 2053	(375 000)	(472 290)	(507 594)	
HP Inc.	6,000	15 sept. 2041	(116 000)	(155 189)	(161 301)	
KB Home	7,250	15 juil. 2030	(92 000)	(118 014)	(125 722)	
KB Home	4,000	15 juin 2031	(150 000)	(163 576)	(177 428)	
LGI Homes Inc.	4,000	15 juil. 2029	(47 000)	(46 399)	(53 526)	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	9,000	15 mai 2028	(248 000)	(336 477)	(339 591)	
M/I Homes Inc.	4,950	1 ^{er} fév. 2028	(14 000)	(17 927)	(17 787)	
M/I Homes Inc.	3,950	15 fév. 2030	(47 000)	(53 503)	(55 219)	
Matador Resources Co.	6,875	15 avril 2028	(153 000)	(206 506)	(204 832)	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 nov. 2030	(226 000)	(264 011)	(268 213)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 mai 2032	(523 000)	(572 446)	(603 358)	
Nordstrom Inc.	4,250	1 ^{er} août 2031	(5 000)	(5 576)	(5 494)	
Outfront Media Capital LLC	7,375	15 fév. 2031	(1 222 000)	(1 706 535)	(1 693 128)	
Owens & Minor Inc.	6,625	1 ^{er} avril 2030	(86 000)	(112 063)	(108 417)	
Performance Food Group Inc.	4,250	1 ^{er} août 2029	(752 000)	(890 227)	(910 488)	
Scripps Escrow II Inc.	3,875	15 janv. 2029	(99 000)	(106 784)	(115 591)	
Sonic Automotive Inc.	4,625	15 nov. 2029	(608 000)	(706 522)	(730 562)	
Sonic Automotive Inc.	4,875	15 nov. 2031	(306 000)	(340 551)	(360 103)	
Sysco Corp.	4,450	15 mars 2048	(95 000)	(104 653)	(110 266)	
Sysco Corp.	3,150	14 déc. 2051	(366 000)	(320 616)	(346 133)	
Taylor Morrison Communities Inc.	5,125	1 ^{er} août 2030	(383 000)	(472 477)	(489 103)	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	1 ^{er} oct. 2028	(482 000)	(633 292)	(634 326)	
T-Mobile USA Inc.	5,050	15 juil. 2033	(345 000)	(454 338)	(458 623)	
US Foods Inc.	4,750	15 fév. 2029	(1 000 000)	(1 232 820)	(1 253 335)	
US Foods Inc.	7,250	15 janv. 2032	(687 000)	(940 432)	(945 703)	
Verizon Communications Inc.	5,050	9 mai 2033	(589 000)	(790 284)	(792 704)	
Verizon Communications Inc.	3,550	22 mars 2051	(76 000)	(72 261)	(77 289)	
Warnermedia Holdings Inc.	5,141	15 mars 2052	(320 000)	(337 845)	(362 434)	
				<u>(20 251 247)</u>	<u>(20 757 850)</u>	(76,63)
Total des obligations – position vendeur				<u>(25 136 726)</u>	<u>(25 888 103)</u>	(95,57)
Total des placements				<u>25 179 770</u>	<u>26 045 286</u>	96,15
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					111 191	0,41
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)					(244 182)	(0,90)
Total de la moins-value latente des contrats à terme sur obligations (Annexe 2)					(92 887)	(0,34)
Total de la plus-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 3)					487 170	1,80
Total de la moins-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 3)					(903 028)	(3,33)
Total de la plus-value latente des contrats sur indice de swaps sur défaillance de crédit (Annexe 4)					544	–
Autres actifs, moins les passifs					<u>1 683 352</u>	6,21
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					<u>27 087 446</u>	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 2023

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente \$
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(165 000)	CAD	224 141	19 mars 2024	6 741
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(181 338)	CAD	246 410	19 mars 2024	7 482
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(335 158)	CAD	454 202	19 mars 2024	12 620
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(21 148)	CAD	28 245	19 mars 2024	386
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(225 000)	CAD	299 699	19 mars 2024	3 309
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(461 000)	CAD	614 155	19 mars 2024	6 884
Banque Royale du Canada	USD	(200 000)	CAD	267 107	19 mars 2024	3 641
Banque Royale du Canada	USD	(157 000)	CAD	208 284	19 mars 2024	1 479
La Banque Toronto-Dominion	USD	(1 650 792)	CAD	2 243 707	19 mars 2024	68 649
						111 191
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(483 602)	USD	356 000	19 mars 2024	(14 545)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(120 497)	USD	90 000	19 mars 2024	(1 935)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(70 960)	USD	53 000	19 mars 2024	(1 139)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(98 840)	USD	74 000	19 mars 2024	(1 358)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(238 131)	USD	178 000	19 mars 2024	(3 643)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(209 701)	USD	158 000	19 mars 2024	(1 578)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(189 793)	USD	143 000	19 mars 2024	(1 428)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(845 856)	USD	636 320	19 mars 2024	(7 657)
Banque Royale du Canada	CAD	(383 816)	USD	284 000	19 mars 2024	(9 646)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(1 306 195)	USD	961 024	19 mars 2024	(39 965)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(5 250 492)	USD	3 863 013	19 mars 2024	(160 646)
La Banque Toronto-Dominion	CAD	(191 632)	USD	145 000	19 mars 2024	(642)
						(244 182)
						(132 991)

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

Contrats à terme sur obligations (Annexe 2)

Au 31 décembre 2023

Description	Taux d'intérêt nominal (%)	Date d'échéance	Type de contrat à terme	Contrepartie*	Date d'échéance du contrat à terme	Nombre de contrats	Prix contractuel	Juste valeur \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Gouvernement du Canada	1,75	1 ^{er} déc. 2053	Obligations	BMO	8 mars 2024	(3 750 000)	73,04	(2 806 189)	(92 887)
								(2 806 189)	(92 887)

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats à terme normalisés (Annexe 3)

Au 31 décembre 2023

Description	Date d'échéance	Nombre de contrats	Juste valeur \$	Plus-value (moins-value) latente \$
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 2 ans	19 mars 2024	316	32 737 600	234 974
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	19 mars 2024	8	1 409 254	116 779
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 5 ans, CBOT	28 mars 2024	36	5 163 432	77 880
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, MTL	19 mars 2024	22	2 731 960	57 043
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	19 mars 2024	8	1 190 861	494
			43 233 107	487 170
Contrat à terme normalisé sur devises, CAD	19 mars 2024	(7)	(698 034)	(17 344)
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 5 ans	19 mars 2024	(343)	(38 652 670)	(885 684)
			(39 350 704)	(903 028)
			3 882 403	(415 858)

Contrats sur indice de swaps sur défaillance de crédit (Annexe 4)

Au 31 décembre 2023

Description	Date d'entrée en vigueur	Date d'expiration	Notionnel	Juste valeur \$	Plus-value (moins-value) latente \$
CDX-NAHYS41V2-5Y SP 5 %	14 déc. 2023	20 déc. 2028	91 080 USD	7 169	544
				7 169	544

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

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 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	1 395 867 \$	– \$	1 395 867 \$
Obligations – position acheteur	–	50 537 522	–	50 537 522
Contrats de change à terme	–	111 191	–	111 191
Contrats à terme normalisés	487 170	–	–	487 170
Swaps sur défaillance de crédit	544	–	–	544
	487 714 \$	52 044 580 \$	– \$	52 532 294 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations – position vendeur	– \$	25 888 103 \$	– \$	25 888 103 \$
Contrats de change à terme	–	244 182	–	244 182
Contrats à terme sur obligations	–	92 887	–	92 887
Contrats à terme normalisés	903 028	–	–	903 028
	903 028 \$	26 225 172 \$	– \$	27 128 200 \$

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2022

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

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

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

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, 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
2023					
Série A	13 264	24 181	327	(4 275)	33 497
Série F	199 147	6 849	2 831	(97 614)	111 213
Série I	2 959 236	55 585	89 685	(143 387)	2 961 119

2022

Série A	10 663	2 975	858	(1 232)	13 264
Série F	291 593	84 777	11 871	(189 094)	199 147
Série I	3 416 269	205 049	259 383	(921 465)	2 959 236

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2023, le Fonds disposait de pertes en capital inutilisées de 3 353 879 \$ (3 272 949 \$ en 2022) 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 2022).

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

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

Frais de gestion

Le Fonds paie des frais de gestion, qui sont comptabilisés quotidiennement et payés mensuellement. 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 2023, GFCC&L détenait 6 620 parts de série A, 6 684 parts de série F et 2 359 944 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 52 715 \$, de 55 603 \$ et de 20 638 178 \$ (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 \$ en 2022).

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

Le Fonds a payé 17 046 \$ (9 322 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant l'exercice (aucun en 2022).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

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

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	Contrats dérivés de change (\$)	Exposition nette (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(1 280 788)	4 674 334	3 393 546	12,5	169 677
Total	(1 280 788)	4 674 334	3 393 546	12,5	169 677

Au 31 décembre 2022

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

Risque de taux d'intérêt

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

Au 31 décembre 2023

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	1 395 867	5,2
De 1 à 3 ans	11 280 993	41,6
De 3 à 5 ans	4 442 036	16,4
Plus de 5 ans	8 926 390	33,0
Total	26 045 286	96,2

Au 31 décembre 2022

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

Si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1,0 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait diminué ou augmenté d'environ 738 000 \$ (995 000 \$ en 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Autre risque de prix

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

Risque de crédit

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

Au 31 décembre 2023

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	27 202 588	100,4
AA	2 014 732	7,4
A	1 340 618	4,9
BBB	7 988 673	29,5
BB	5 759 526	21,3
B	7 667 681	28,3
CCC	70 762	0,3
Total	52 044 580	192,1

Au 31 décembre 2022

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

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
31 décembre 2023 et 2022

Prêt de titres (note 12)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2023	2022
	\$	\$
Revenus bruts tirés du prêt de titres	2 459	4 237
Charges liées au prêt de titres	(492)	(847)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 967	3 390
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	–	–
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 967	3 390

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

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

	2023	2022
	(en milliers de \$)	(en milliers de \$)
Titres prêtés	6 323	693
Garanties reçues	6 639	727
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier (note 13)

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 111,3 % à 263,9 % (de 85,2 % à 191,1 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 251,2 % (182,4 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur titres à revenu fixe, de positions vendeur sur placements à court terme, de contrats à terme sur obligations et d'emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 11 856 996 \$ (de néant à 7 973 344 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 9,11 % (6,21 % en 2022). Au 31 décembre 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,0 % (2,0 % en 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de la situation financière

Aux 31 décembre

	2023	2022
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	– \$	596 221 \$
Placements à court terme	60 218 952	51 167 098
Placements	47 535 593	36 554 059
Montant à recevoir du courtier	205 611	339 809
Dividendes à recevoir	140 756	43 326
Intérêts à recevoir	22 379	30 960
Autres créances	31 959	17 929
Souscriptions à recevoir	42 337	104 529
	108 197 587	88 853 931
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	8 523 552	2 162 647
Placements vendus à découvert	42 380 508	33 683 725
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	146 032	105 676
Montant à payer au courtier	79 033	197 856
Frais d'emprunt de titres à payer	12 760	9 511
Charges à payer	52 266	58 511
Frais de gestion à payer	44 755	42 799
Rachats à payer	–	9 283
	51 238 906	36 270 008
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	56 958 681 \$	52 583 923 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	1 266 403 \$	1 948 885 \$
Série F	51 240 865 \$	46 400 923 \$
Série I	4 451 413 \$	4 234 115 \$
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	133 223	210 804
Série F	5 239 467	4 933 501
Série I	440 000	440 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	9,51 \$	9,25 \$
Série F	9,78 \$	9,41 \$
Série I	10,12 \$	9,62 \$

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États du résultat global

Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	(92 659) \$	20 250 \$
Variation du gain (perte) de change latent	183 433	(39 763)
Autres revenus (pertes)	1 256	1 500
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	481 936	252 738
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	(990 753)	(614 363)
Intérêts aux fins des distributions	2 627 587	626 272
Gain (perte) net réalisé sur les placements	2 980 018	(1 382 757)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	(2 495 359)	1 823 574
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	2 863 496	(1 021 446)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	(1 953 285)	830 432
Gain (perte) net total sur placements	<u>3 513 640</u>	<u>514 450</u>
Total des revenus (pertes) nets	<u>3 605 670</u>	<u>496 437</u>
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	25 289	32 167
Honoraires des dépositaires	27 666	51 313
Frais de dépôt	21 579	22 251
Honoraires de FundSERV	1 796	-
Honoraires du comité d'examen indépendant	4 464	4 711
Frais d'assurance du comité d'examen indépendant	578	642
Charges d'intérêts	227 852	34 211
Frais de gestion	597 860	480 932
Honoraires de professionnels	10 678	15 941
Coût d'emprunt de titres	142 768	129 933
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	62 518	47 785
Coûts de transaction (note 9)	179 394	208 560
Total des charges d'exploitation	<u>1 302 442</u>	<u>1 028 446</u>
Retenues d'impôts (note 7)	<u>(27 429)</u>	<u>(17 096)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>2 275 799 \$</u>	<u>(549 105) \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	42 567 \$	(40 334) \$
Série F	2 015 934 \$	(480 267) \$
Série I	217 298 \$	(28 504) \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	185 794	174 526
Série F	5 350 222	4 409 990
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 \$	(0,23) \$
Série F	0,38 \$	(0,11) \$
Série I	<u>0,49 \$</u>	<u>(0,06) \$</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 les exercices clos les 31 décembre

	Série A 2023	Série A 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	1 948 885 \$	1 716 918 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	42 567	(40 334)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	19 087	413 217
Rachat de parts rachetables	(744 136)	(140 916)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	(725 049)	272 301
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	(682 482)	231 967
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	1 266 403 \$	1 948 885 \$
	Série F 2023	Série F 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	46 400 923 \$	31 876 784 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	2 015 934	(480 267)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	15 002 542	26 066 062
Rachat de parts rachetables	(12 178 534)	(11 061 656)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	2 824 008	15 004 406
Total distributions to holders of redeemable units		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	4 839 942	14 524 139
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	51 240 865 \$	46 400 923 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

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

	Série I 2023	Série I 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	<u>4 234 115 \$</u>	<u>4 262 619 \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>217 298</u>	<u>(28 504)</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	<u>217 298</u>	<u>(28 504)</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	<u>4 451 413 \$</u>	<u>4 234 115 \$</u>
	Total 2023	Total 2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de l'exercice	<u>52 583 923 \$</u>	<u>37 856 321 \$</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	<u>2 275 799</u>	<u>(549 105)</u>
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	<u>15 021 629</u>	<u>26 479 279</u>
Rachat de parts rachetables	<u>(12 922 670)</u>	<u>(11 202 572)</u>
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	<u>2 098 959</u>	<u>15 276 707</u>
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant l'exercice	<u>4 374 758</u>	<u>14 727 602</u>
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de l'exercice	<u>56 958 681 \$</u>	<u>52 583 923 \$</u>

Fonds de rendement absolu PCJ II

Tableaux des flux de trésorerie Pour les exercices clos les 31 décembre

	2023	2022
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	2 275 799 \$	(549 105) \$
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	(183 433)	39 763
(Gain) perte net réalisé sur les placements	(2 980 018)	1 382 757
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	2 495 359	(1 823 574)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	(2 863 496)	1 021 446
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	1 953 285	(830 432)
Achat de placements	(492 413 218)	(475 196 155)
Produit de la vente de placements	482 486 858	462 082 066
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(97 430)	(14 427)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	8 581	(30 960)
(Augmentation) diminution des autres créances	(14 030)	(11 140)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	3 249	5 008
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	40 356	49 238
Augmentation (diminution) des charges à payer	(6 245)	31 207
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1 956	13 115
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(9 292 427)	(13 831 193)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	14 998 693	26 475 510
Rachat de parts rachetables**	(12 846 825)	(11 253 009)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	2 151 868	15 222 501
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	(7 140 559)	1 391 308
Variation du gain (perte) de change latent	183 433	(39 763)
Trésorerie, à l'ouverture de l'exercice	596 221	9
Dette bancaire, à l'ouverture de l'exercice	(2 162 647)	(2 917 980)
	(8 523 552)	(1 566 426)
Trésorerie, à la clôture de l'exercice	– \$	596 221 \$
Dette bancaire, à la clôture de l'exercice	(8 523 552) \$	(2 162 647) \$
	(8 523 552) \$	(1 566 426) \$
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	357 077 \$	221 215 \$
Dividendes payés*	(950 397)	(565 125)
Intérêts reçus*	2 636 168	595 312
Intérêts payés*	(227 852)	(34 211)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 85 128 \$ (néant en 2022).

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Placements à court terme – position acheteur						
Bons du Trésor du Canada (31 décembre 2022 : 97,31 %)						
Bons du Trésor du Canada	10,066	4 janv. 2024	20 000 000	19 766 558	19 983 422	
Bons du Trésor du Canada	5,401	18 janv. 2024	2 500 000	2 470 891	2 493 144	
Bons du Trésor du Canada	5,173	1 ^{er} fév. 2024	6 250 000	6 180 246	6 220 844	
Bons du Trésor du Canada	5,122	15 fév. 2024	3 750 000	3 707 791	3 725 349	
Bons du Trésor du Canada	5,099	29 fév. 2024	19 650 000	19 428 093	19 483 372	
Bons du Trésor du Canada	5,078	14 mars 2024	8 400 000	8 303 548	8 312 821	
				<u>59 857 127</u>	<u>60 218 952</u>	105,72
Total des placements à court terme – position acheteur				<u>59 857 127</u>	<u>60 218 952</u>	105,72
Obligations – position acheteur						
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2022 : 1,84 %)						
Chorus Aviation Inc.	6,000	30 juin 2026	748 000	770 023	721 783	1,27
Total des obligations – position acheteur				<u>770 023</u>	<u>721 783</u>	1,27
Actions canadiennes – position acheteur						
Énergie (31 décembre 2022 : 5,53 %)						
Corporation Cameco, NYSE			4 390	152 120	249 491	
Cenovus Energy Inc.			46 680	1 205 888	1 030 694	
Crescent Point Energy Corp.			28 430	253 330	261 272	
Enerflex Ltd.			96 310	764 306	590 380	
Tamarack Valley Energy Ltd.			125 310	478 812	384 702	
Corporation TC Énergie, NYSE			16 140	844 839	831 921	
				<u>3 699 295</u>	<u>3 348 460</u>	5,88
Matières premières (31 décembre 2022 : 4,81 %)						
Mines Agnico Eagle Ltée, NYSE			19 160	1 253 190	1 385 751	2,43
Industries (31 décembre 2022 : 10,25 %)						
Black Diamond Group Ltd.			90 020	581 293	735 463	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, NYSE			14 960	1 600 897	1 559 558	
Element Fleet Management Corp.			22 710	437 433	489 628	
GFL Environmental Inc., NYSE			12 460	546 566	566 991	
Parkit Enterprise Inc.			265 952	318 013	170 209	
RB Global Inc., NYSE			20 870	1 767 415	1 840 758	
Groupe SNC-Lavalin inc.			77 940	3 235 070	3 324 921	
				<u>8 486 687</u>	<u>8 687 528</u>	15,24
Bien de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 2,02 %)						
Les Vêtements de Sport Gildan Inc., NYSE			2 410	93 440	105 059	
Restaurant Brands International Inc., NYSE			6 320	585 115	651 101	
				<u>678 555</u>	<u>756 160</u>	1,33
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : 2,37 %)						
Soins de santé (31 décembre 2022 : néant)						
Chartwell Résidences pour retraités			226 332	2 310 647	2 652 611	4,66
Services financiers (31 décembre 2022 : 10,46 %)						
Fairfax Financial Holdings Ltd.			1 040	1 229 796	1 271 410	
Société Financière Manuvie, NYSE			16 550	464 960	482 285	
				<u>1 694 756</u>	<u>1 753 695</u>	3,08
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : 4,70 %)						
Coveo Solutions Inc.			45 300	419 931	434 880	
Docebo Inc.			7 980	409 611	510 640	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Kinaxis Inc.			1 960	300 670	291 472	
TECSYS Inc.			17 740	507 947	582 049	
				1 638 159	1 819 041	3,19
Services de communication (31 décembre 2022 : 1,74 %)						
Rogers Communications Inc., NYSE			63 064	3 709 225	3 892 542	6,83
Services publics (31 décembre 2022 : 1,74 %)						
Immobilier (31 décembre 2022 : 3,95 %)						
Boardwalk REIT			23 570	1 589 295	1 681 484	
Fonds de placement immobilier d'immeubles résidentiels canadiens			4 160	210 252	203 008	
DREAM Unlimited Corp.			6 560	149 788	148 584	
InterRent REIT			203 860	2 636 707	2 697 068	
				4 586 042	4 730 144	8,30
Total des actions canadiennes – position acheteur				28 056 556	29 025 932	50,94
Actions canadiennes – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2022 : -4,40 %)						
Birchcliff Energy Ltd.			(21 450)	(161 296)	(123 981)	
Enbridge Inc.			(15 960)	(819 229)	(761 622)	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée			(7 850)	(611 588)	(592 518)	
Suncor Énergie Inc.			(14 440)	(644 782)	(612 978)	
Whitecap Resources Inc.			(29 070)	(290 371)	(257 851)	
				(2 527 266)	(2 348 620)	(4,12)
Matières premières (31 décembre 2022 : -1,70 %)						
ERO Copper Corp.			(10 900)	(217 284)	(228 355)	(0,40)
Industries (31 décembre 2022 : -2,02 %)						
Groupe Aecon Inc.			(26 620)	(316 465)	(347 923)	
CAE inc.			(6 300)	(176 705)	(180 180)	
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada			(12 540)	(1 972 714)	(2 088 537)	
Stantec Inc.			(7 320)	(734 636)	(778 702)	
				(3 200 520)	(3 395 342)	(5,96)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -1,52 %)						
Boston Pizza Royalties Income Fund			(7 780)	(128 382)	(119 267)	
La Société Canadian Tire Ltée			(6 100)	(955 987)	(858 392)	
Les Vêtements de Sport Gildan Inc., TSE			(2 410)	(106 440)	(105 606)	
Sleep Country Canada Holdings Inc.			(17 600)	(439 438)	(450 736)	
				(1 630 247)	(1 534 001)	(2,69)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -0,88 %)						
Les Compagnies Loblaw Ltée			(2 170)	(257 974)	(278 368)	
Metro inc.			(22 690)	(1 546 517)	(1 556 307)	
Premium Brands Holdings Corp.			(5 340)	(505 667)	(502 120)	
				(2 310 158)	(2 336 795)	(4,10)
Services financiers (31 décembre 2022 : -5,76 %)						
Intact Corporation financière			(6 750)	(1 410 088)	(1 376 055)	
Power Corporation du Canada			(4 400)	(161 040)	(166 716)	
Groupe TMX Ltée			(4 350)	(127 824)	(139 418)	
				(1 698 952)	(1 682 189)	(2,95)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -2,41 %)						
Descartes Systems Group Inc.			(5 020)	(440 615)	(558 877)	(0,98)
Services de communication (31 décembre 2022 : néant)						
BCE Inc.			(37 350)	(2 091 898)	(1 948 547)	
Cogeco Communications inc.			(5 090)	(274 337)	(302 092)	
TELUS Corp.			(79 660)	(1 969 318)	(1 878 383)	
				(4 335 553)	(4 129 022)	(7,25)
Services publics (31 décembre 2022 : -2,02 %)						
Northland Power Inc.			(6 170)	(148 317)	(148 512)	(0,26)
Immobilier (31 décembre 2022 : -1,61 %)						
Allied Properties REIT			(13 970)	(259 440)	(281 915)	
Automotive Properties REIT			(2 050)	(27 151)	(22 099)	
CT REIT			(18 640)	(286 501)	(273 076)	
Fiducie de placement immobilier de bureaux Dream			(7 910)	(110 103)	(82 897)	
FPI Granite			(4 140)	(281 172)	(315 799)	
Fonds de placement immobilier RioCan			(29 290)	(601 530)	(545 380)	
SmartCentres REIT			(4 930)	(145 999)	(122 708)	
				(1 711 896)	(1 643 874)	(2,89)
Total des actions canadiennes – position vendeur				(18 220 808)	(18 005 587)	(31,60)
Actions américaines – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2022 : 1,53 %)						
Industries (31 décembre 2022 : 9,64 %)						
Builders FirstSource Inc.			4 140	909 402	911 326	
General Electric Co.			2 690	412 809	452 708	
Howmet Aerospace Inc.			6 330	437 395	451 726	
Parker-Hannifin Corp.			1 080	596 647	656 077	
Uber Technologies Inc.			27 949	1 790 347	2 269 073	
Union Pacific Corp.			2 020	590 694	654 227	
United Rentals Inc.			3 630	1 989 454	2 744 686	
XPO Inc.			4 030	349 743	465 450	
				7 076 491	8 605 273	15,11
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : 3,56 %)						
Amazon.com Inc.			2 680	473 093	536 933	
TJX Cos Inc.			4 690	575 943	580 143	
				1 049 036	1 117 076	1,96
Soins de santé (31 décembre 2022 : 1,23 %)						
Services financiers (31 décembre 2022 : 3,76 %)						
Bank of America Corp.			20 710	877 647	919 467	
Wells Fargo & Co.			5 420	313 828	351 766	
				1 191 475	1 271 233	2,23
Services de communication (31 décembre 2022 : 0,36 %)						
Total des actions américaines – position acheteur						
				9 317 002	10 993 582	19,30
Actions américaines – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2022 : -0,55 %)						
Martin Marietta Materials Inc.			(1 160)	(728 219)	(763 121)	
Vulcan Materials Co.			(3 510)	(1 018 496)	(1 050 667)	
				(1 746 715)	(1 813 788)	(3,18)
Industries (31 décembre 2022 : -10,45 %)						
Alaska Air Group Inc.			(1 180)	(58 399)	(60 791)	
Allegiant Travel Co.			(570)	(59 203)	(62 090)	
Caterpillar Inc.			(1 040)	(355 322)	(405 465)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
CH Robinson Worldwide Inc.			(1 970)	(259 606)	(224 410)	
Copart Inc.			(3 730)	(215 282)	(241 001)	
CSX Corp.			(4 320)	(186 097)	(197 493)	
Deere & Co.			(1 090)	(555 648)	(574 723)	
Emerson Electric Co.			(980)	(114 537)	(125 773)	
Expeditors International of Washington Inc.			(2 110)	(318 030)	(353 902)	
JB Hunt Transport Services Inc.			(290)	(66 453)	(76 379)	
Kennametal Inc.			(16 608)	(551 859)	(564 783)	
Landstar System Inc.			(370)	(89 715)	(94 478)	
Norfolk Southern Corp.			(570)	(167 019)	(177 664)	
Old Dominion Freight Line Inc.			(740)	(319 323)	(395 506)	
Oshkosh Corp.			(6 840)	(816 345)	(977 774)	
PACCAR Inc.			(1 890)	(173 098)	(243 359)	
Rockwell Automation Inc.			(320)	(112 469)	(131 008)	
Schneider National Inc.			(3 220)	(113 959)	(108 058)	
Southwest Airlines Co.			(1 550)	(58 101)	(59 026)	
United Airlines Holdings Inc.			(1 030)	(58 746)	(56 038)	
Werner Enterprises Inc.			(1 890)	(112 605)	(105 593)	
				(4 761 816)	(5 235 314)	(9,19)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -5,22 %)						
BJ's Restaurants Inc.			(5 950)	(206 588)	(282 523)	
Booking Holdings Inc.			(100)	(429 799)	(467 736)	
Cracker Barrel Old Country Store Inc.			(1 380)	(127 467)	(140 260)	
Helen of Troy Ltd.			(770)	(100 148)	(122 661)	
Home Depot Inc.			(1 640)	(703 656)	(749 416)	
Leggett & Platt Inc.			(8 850)	(286 029)	(305 394)	
MarineMax Inc.			(4 090)	(184 581)	(209 791)	
Polaris Inc.			(2 930)	(389 257)	(366 144)	
Pool Corp.			(310)	(145 853)	(162 979)	
Ralph Lauren Corp.			(980)	(146 382)	(186 339)	
Tesla Inc.			(430)	(123 550)	(140 888)	
Thor Industries Inc.			(1 820)	(246 042)	(283 783)	
				(3 089 352)	(3 417 914)	(6,00)
Biens de consommation de base (31 décembre 2022 : -2,73 %)						
Hershey Co.			(640)	(174 017)	(157 337)	
J M Smucker Co.			(4 230)	(734 523)	(704 907)	
PepsiCo Inc.			(770)	(172 114)	(172 442)	
				(1 080 654)	(1 034 686)	(1,82)
Services financiers (31 décembre 2022 : -6,47 %)						
American Express Co.			(1 710)	(348 493)	(422 415)	
Blackstone Inc.			(930)	(124 274)	(160 547)	
CVB Financial Corp.			(8 490)	(173 266)	(226 025)	
German American Bancorp Inc.			(2 210)	(87 828)	(94 446)	
SEI Investments Co.			(5 260)	(389 189)	(440 772)	
ServisFirst Bancshares Inc.			(1 627)	(109 237)	(142 946)	
T Rowe Price Group Inc.			(2 150)	(316 557)	(305 300)	
W R Berkley Corp.			(3 150)	(302 331)	(293 742)	
				(1 851 175)	(2 086 193)	(3,66)
Technologies de l'information (31 décembre 2022 : -0,51 %)						
Immobilier (31 décembre 2022 : -3,00 %)						
Total des actions américaines – position vendeur				<u>(12 529 712)</u>	<u>(13 587 895)</u>	(23,85)
Actions étrangères – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2022 : néant)						
CRH PLC			41 530	<u>3 433 234</u>	<u>3 787 303</u>	6,65

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille

Au 31 décembre 2023

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen \$	Juste valeur \$	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2022 : néant)						
AerCap Holdings NV			7 360	681 321	721 268	
Brookfield Business Partners LP, NYSE			27 448	644 436	744 851	
Eaton Corp. PLC			2 130	634 637	676 371	
				<u>1 960 394</u>	<u>2 142 490</u>	3,76
Services publics (31 décembre 2022 : néant)						
Brookfield Infrastructure Partners LP, NYSE			20 820	799 519	864 503	1,52
Total des actions étrangères – position acheteur				<u>6 193 147</u>	<u>6 794 296</u>	11,93
Actions étrangères – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2022 : néant)						
Gold Fields Ltd.			(48 300)	(884 912)	(920 934)	(1,62)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2022 : -0,53 %)						
Total des actions étrangères – position vendeur				<u>(884 912)</u>	<u>(920 934)</u>	(1,62)
Fonds négociés en bourse – position vendeur (31 décembre 2022 : -12,26 %)						
BMO S&P 500 Index ETF			(11 120)	(687 807)	(768 281)	
Industrial Select Sector SPDR Fund			(8 779)	(1 199 588)	(1 319 547)	
Invesco QQQ Trust Series 1			(1 230)	(592 074)	(664 192)	
iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF			(92 040)	(2 926 062)	(3 071 375)	
iShares MSCI USA Momentum Factor ETF			(5 180)	(1 051 861)	(1 071 613)	
iShares Russell 2000 ETF			(3 120)	(727 285)	(825 727)	
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF			(5 530)	(740 412)	(690 758)	
SPDR Dow Jones Industrial Average ETF Trust			(720)	(315 143)	(357 797)	
SPDR S&P 500 ETF Trust			(1 750)	(1 054 018)	(1 096 802)	
Total des fonds négociés en bourse – position vendeur				<u>(9 294 250)</u>	<u>(9 866 092)</u>	(17,32)
Commissions de courtage intégrées (note 3)				<u>(34 305)</u>		
Total des placements				<u>63 229 868</u>	<u>65 374 037</u>	114,77
Autres actifs, moins les passifs					<u>(8 415 356)</u>	(14,77)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					<u>56 958 681</u>	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 2023 et 2022

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

Renseignements généraux (note 1)

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

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

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

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 31 décembre 2023

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– \$	60 218 952 \$	– \$	60 218 952 \$
Obligations – position acheteur	–	721 783	–	721 783
Actions canadiennes – position acheteur	29 025 932	–	–	29 025 932
Actions américaines – position acheteur	10 993 582	–	–	10 993 582
Actions étrangères – position acheteur	6 794 296	–	–	6 794 296
	46 813 810 \$	60 940 735 \$	– \$	107 754 545 \$

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	18 005 587 \$	– \$	– \$	18 005 587 \$
Actions américaines – position vendeur	13 587 895	–	–	13 587 895
Actions étrangères – position vendeur	920 934	–	–	920 934
Fonds négociés en bourse – position vendeur	9 866 092	–	–	9 866 092
	42 380 508 \$	– \$	– \$	42 380 508 \$

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Au 31 décembre 2022

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

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

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

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, 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
2023					
Série A	210 804	2 011	–	(79 592)	133 223
Série F	4 933 501	1 586 831	–	(1 280 865)	5 239 467
Série I	440 000	–	–	–	440 000
2022					
Série A	180 637	45 312	–	(15 145)	210 804
Série F	3 330 483	2 790 816	–	(1 187 798)	4 933 501
Série I	440 000	–	–	–	440 000

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

Imposition du Fonds (note 7)

Au 31 décembre 2023, le Fonds avait des pertes en capital inutilisées de 1 143 830 \$ (1 208 368 \$ en 2022), qui peuvent être reportées indéfiniment et servir à réduire le montant des gains en capital réalisés futurs. Il ne disposait d'aucune perte autre qu'en capital inutilisée pouvant être reportée aux fins de l'impôt (32 595 \$ en 2022).

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

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

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

Frais de gestion

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

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

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

Rémunération au rendement

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

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

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

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

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

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 2023, GFCC&L détenait 5 000 parts de série A, 5 000 parts de série F et 440 000 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 47 529 \$, 48 889 \$ et 4 451 413 \$ (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 \$ en 2022).

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

Le Fonds a payé 179 394 \$ (208 560 \$ en 2022) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant l'exercice. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant l'exercice (aucun en 2022).

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

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

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

Au 31 décembre 2023

Devise	Actifs (passifs) monétaires (\$)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net (\$)
Dollar américain	(8 568 805)	(15,0)	(428 440)
	(8 568 805)	(15,0)	(428 440)

Au 31 décembre 2022

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

Risque lié aux taux d'intérêt

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

Au 31 décembre 2023

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total \$	% de l'actif net
Moins de 1 an	60 218 952	105,7
De 1 à 3 ans	721 783	1,3
Total	60 940 735	107,0

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

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

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 53 000 \$ (35 000 \$ en 2022). 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 2023, environ 7,8 % (4,0 % en 2022) de l'actif net du Fonds est exposé à l'autre risque de prix en raison de son exposition aux fluctuations du marché (ne découlant pas d'autres facteurs précités). Si les cours des actions détenues au sein du portefeuille avaient augmenté ou diminué de 10 %, tous les autres facteurs demeurant inchangés, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué d'environ 443 000 \$ (192 000 \$ en 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être importante.

Risque de crédit

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

Au 31 décembre 2023

Notations des créances et des contreparties	Total \$	% de l'actif net
AAA	60 218 952	105,7
Non notées	721 783	1,3
Total	60 940 735	107,0

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

Placements dans des entités structurées (note 11)

Au 31 décembre 2023, la valeur comptable des fonds négociés en bourse comptabilisée aux postes « Placements » et « Placements vendus à découvert » dans les états de la situation financière était de néant et de 9 866 092 \$, respectivement (néant et 6 439 637, respectivement, en 2022). La variation de la juste valeur des fonds négociés en bourse est comptabilisée dans les états du résultat global au poste « Variation nette de la (plus-value) moins-valeur latente des placements ».

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

31 décembre 2023 et 2022

Effet de levier (note 13)

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 59,1 % à 91,2 % (de 37,6 % à 84,5 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds correspondait à 89,4 % (68,2 % en 2022) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 10 283 034 \$ (de néant à 4 841 032 \$ en 2022), avec un taux d'intérêt moyen de 5,17 % (1,91 % en 2022). Au 31 décembre 2023, les emprunts en trésorerie correspondaient à 15,0 % (4,1 % en 2022) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

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

1 Renseignements généraux

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

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

Fiducie RBC Services aux investisseurs en est le fiduciaire.

Le gestionnaire a approuvé la publication des états financiers le 22 mars 2024.

2 Mode de présentation

a) Déclaration de conformité :

Les états financiers annuels ont été préparés conformément aux normes IFRS de comptabilité. 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 états financiers sont présentés en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle du Fonds.

3 Informations significatives sur les méthodes comptables

Les Fonds ont appliqué uniformément les méthodes comptables ci-après 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 2023 et 2022

Les Fonds classent et évaluent les instruments financiers conformément à la Norme internationale d'information financière (« IFRS ») 9, *Instruments financiers*. 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, 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 JVRN.

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 la Norme comptable internationale (« 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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

d) 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.

e) 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.

f) 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.

g) Coûts de transaction :

Les coûts de transaction, 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.

h) 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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

i) 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.

j) 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 ».

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

Les Fonds ont adopté *Informations à fournir sur les méthodes comptables* (modifications de l'IAS 1 et de l'énoncé de pratiques en IFRS 2) le 1^{er} janvier 2023. Les modifications exigent la fourniture d'informations « significatives » sur les méthodes comptables plutôt que la fourniture d'informations sur les « principales » méthodes comptables. Bien que les modifications n'aient pas entraîné de changements de méthodes comptables en soi, elles ont eu, dans certains cas, une incidence sur les informations fournies sur les méthodes comptables (dans la présente note).

4 Estimations et jugements comptables critiques

La préparation d'états financiers conformes aux normes IFRS de comptabilité 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 2023 et 2022

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, de la marge de variation quotidienne, 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, le cas échéant, 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 2023 et 2022

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 normalisés et les contrats sur indice de swaps sur défaillance de crédit sont classés au niveau 1, car les cours utilisés reposent sur des données de marché observables.

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

6 Parts rachetables des Fonds

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

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

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

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

8 Transactions avec des parties liées et autres charges

Frais de gestion

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

Rémunération au rendement

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

Honoraires du comité d'examen indépendant

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

Autres charges

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

Placements dans des parties liées

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

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

9 Commissions de courtage et accords de paiement indirect

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

10 Gestion des risques financiers

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

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

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

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

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

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

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

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.

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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

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 2023 et 2022, la totalité des autres créances, des montants à recevoir de courtiers, de la trésorerie et des dépôts à court terme étaient détenus soit par des contreparties ayant une notation allant de AAA à A, soit par des contreparties non notées. Le risque de crédit lié aux transactions non réglées est considéré comme peu élevé en raison de la brièveté de la période de règlement en cause. Le gestionnaire pense que la probabilité de défaillance de ces instruments est presque nulle, car la capacité des contreparties à s'acquitter de leurs obligations contractuelles à court terme est élevée.

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, Fiducie RBC Services aux investisseurs, 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 2023, à l'exception des parts rachetables, qui sont remboursables à vue, des positions vendeur sur obligations et de certains dérivés. Au 31 décembre 2022, tous les passifs financiers des Fonds venaient à échéance dans les trois mois suivant la date des états financiers.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

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 des Fonds respectifs décrit en détail l'exposition des Fonds au risque de concentration aux 31 décembre 2023 et 2022.

Gestion du risque lié au capital

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

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.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.

Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

31 décembre 2023 et 2022

Au cours des exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, les Fonds n'ont pas soutenu financièrement d'entités structurées non consolidées et ils n'ont pas l'intention d'offrir un soutien financier ou d'une autre nature.

12 Prêt de titres

Les Fonds peuvent conclure un programme de prêt de titres avec leur dépositaire, Fiducie RBC Services aux investisseurs, 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.

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.