CONNOR, CLARK & LUNN
FONDS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS (NON AUDITÉ)

30 juin 2024

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

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

- AVIS : L'auditeur indépendant des Fonds n'a pas effectué l'examen des présents états financiers semestriels conformément aux normes établies par les Comptables professionnels agréés du Canada.

TABLE DES MATIÈRES

Fonds mondial neutre au marché CC&L II 3

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L 91

Fonds alternatif de revenu CC&L 176

Fonds de rendement absolu PCJ II 196

Notes annexes 212

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

États de la situation financière aux

	30 juin 2024 (non audité)	31 décembre 2023 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	**455 627 $**	9 509 310 $
Placements	**55 732 382**	29 310 342
Plus-value latente des contrats de change à terme	**283 612**	664 638
Plus-value latente des contrats de swap	**1 648 920**	410 450
Marge de variation quotidienne	**11 853 055**	3 682 841
Montant à recevoir du courtier	**941 150**	1 221 163
Dividendes à recevoir	**90 233**	23 436
Souscriptions à recevoir	**73 248**	26 822
	71 078 227	44 849 002
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	**588 997**	–
Placements vendus à découvert	**26 046 360**	18 458 428
Moins-value latente des contrats de change à terme	**10 011**	85 685
Moins-value latente des contrats de swap	**1 155 262**	1 036 133
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**57 138**	23 066
Montant à payer au courtier	**1 000 621**	1 525 979
Frais d'emprunt de titres à payer	**8 682**	11 148
Charges à payer	**68 677**	60 564
Frais de gestion à payer	**22 802**	9 088
Rémunération au rendement à payer	**196 856**	68 175
Rachats à payer	**7 090**	–
	29 162 496	21 278 266
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	**41 915 731 $**	23 570 736 $
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**1 569 452 $**	417 870 $
Série F	**28 009 036 $**	11 663 995 $
Série I	**12 337 243 $**	11 488 871 $
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	**134 535**	37 609
Série F	**2 380 528**	1 044 406
Série I	**1 018 047**	1 018 642
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**11,67 $**	11,11 $
Série F	**11,77 $**	11,17 $
Série I	**12,12 $**	11,28 $

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund » ***« Tim Elliott »***

Administrateur **Administrateur**

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	**15 284 $**	(208 472) $
Variation du gain (perte) de change latent	**230 936**	(224 677)
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	**4 881**	1 205
Autres revenus (pertes)	**3 291**	7 475
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	**634 160**	320 135
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	**(259 203)**	(159 168)
Intérêts aux fins des distributions	**263 043**	156 125
Gain (perte) net réalisé sur les placements	**2 999 139**	1 315 531
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	**(1 255 452)**	22 408
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	**(570 220)**	534 436
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	**211 017**	(26 586)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	**(1 342 579)**	(120 935)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	**(93 864)**	568 502
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	**1 155 173**	(781 685)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	**(305 352)**	177 514
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	**1 119 341**	(223 730)
Gain (perte) net total sur placements	**2 555 203**	1 782 547
Total des revenus (pertes) nets	**2 809 595**	1 358 078
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	**15 976**	8 132
Honoraires des dépositaires	**37 962**	27 457
Frais de dépôt	**21 181**	12 390
Honoraires du comité d'examen indépendant	**1 975**	2 232
Charges d'intérêts	**162 080**	109 442
Frais de gestion	**106 757**	15 525
Rémunération au rendement	**295 351**	6 840
Honoraires de professionnels	**17 986**	–
Coût d'emprunt de titres	**75 880**	35 945
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	**17 953**	5 558
Coûts de transaction (note 9)	**62 446**	27 694
Total des charges d'exploitation	**815 547**	251 215
Retenues d'impôts (note 7)	**(102 371)**	(47 351)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**1 891 677 $**	1 059 512 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**42 508 $**	6 304 $
Série F	**994 062 $**	88 015 $
Série I	**855 107 $**	965 193 $
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	**71 170**	15 920
Série F	**1 723 216**	306 814
Série I	**1 018 072**	1 389 111
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**0,60 $**	0,40 $
Série F	**0,58 $**	0,29 $
Série I	**0,84 $**	0,69 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

	Série A 2024	Série A 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**417 870 $**	146 875 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**42 508**	6 304
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**1 235 615**	59 200
Rachat de parts rachetables	**(126 541)**	(197)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**1 109 074**	59 003
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**1 151 582**	65 307
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**1 569 452 $**	212 182 $

	Série F 2024	Série F 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**11 663 995 $**	1 930 574 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**994 062**	88 015
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**18 766 806**	4 616 423
Rachat de parts rachetables	**(3 415 827)**	(932 783)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**15 350 979**	3 683 640
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**16 345 041**	3 771 655
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**28 009 036 $**	5 702 229 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2024	Série I 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**11 488 871 $**	18 705 651 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**855 107**	965 193
Opérations sur les parts rachetables		
Rachat de parts rachetables	**(6 735)**	(8 689 701)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**(6 735)**	(8 689 701)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**848 372**	(7 724 508)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**12 337 243 $**	10 981 143 $

	Total 2024	Total 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**23 570 736 $**	20 783 100 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**1 891 677**	1 059 512
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**20 002 421**	4 675 623
Rachat de parts rachetables	**(3 549 103)**	(9 622 681)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**16 453 318**	(4 947 058)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**18 344 995**	(3 887 546)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**41 915 731 $**	16 895 554 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**1 891 677 $**	1 059 512 $
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	**(230 936)**	224 677
(Gain) perte net réalisé sur les placements	**(2 999 139)**	(1 315 531)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	**1 255 452**	(22 408)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	**93 864**	(568 502)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	**(1 155 173)**	781 685
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	**305 352**	(177 514)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	**(1 119 341)**	223 730
Achat de placements	**(115 776 902)**	(77 485 520)
Produit de la vente de placements	**99 502 445**	90 300 741
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	**(8 170 214)**	(26 135)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	**(66 797)**	(8 691)
(Augmentation) diminution des autres créances	**–**	(16 864)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	**(2 466)**	(8 523)
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**34 072**	31 391
Augmentation (diminution) des charges à payer	**8 113**	(44 789)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	**13 714**	2 792
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	**128 681**	(6 944)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	**(26 287 598)**	12 943 107
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	**19 955 995**	4 578 623
Rachat de parts rachetables	**(3 542 013)**	(9 625 081)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	**16 413 982**	(5 046 458)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	**(9 873 616)**	7 896 649
Variation du gain (perte) de change latent	**230 936**	(224 677)
Trésorerie, à l'ouverture de la période	**9 509 310**	3 521 869
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	**–**	(3 261 019)
	(133 370)	7 932 822
Trésorerie, à la clôture de la période	**455 627 $**	7 932 822 $
Dette bancaire, à la clôture de la période	**(588 997) $**	– $
	(133 370) $	7 932 822 $
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	**465 258 $**	264 175 $
Dividendes payés*	**(225 131)**	(127 777)
Intérêts reçus*	**263 043**	156 125
Intérêts payés*	**(162 080)**	(109 442)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 2,63 %)				
Corporation Cameco, TSE	1 600	98 776	107 696	
Canadian Natural Resources Ltd.	1 200	57 410	58 476	
Cardinal Energy Ltd.	3 300	15 296	22 110	
Cenovus Energy Inc.	12 900	345 081	346 881	
Crew Energy Inc.	600	2 547	2 574	
Ensign Energy Services Inc.	400	1 194	912	
Gear Energy Ltd.	800	952	552	
Parex Resources Inc.	2 000	32 113	43 840	
Suncor Énergie Inc.	7 800	388 632	406 770	
Corporation TC Énergie, TSE	500	25 401	25 930	
Tourmaline Oil Corp.	3 400	204 331	210 970	
VAALCO Energy Inc.	1 555	14 216	13 341	
Whitecap Resources Inc.	4 000	30 884	40 040	
Yangarra Resources Ltd.	600	1 667	636	
		1 218 500	1 280 728	3,06
Matières premières (31 décembre 2023 : 0,77 %)				
Aris Mining Corp.	900	5 151	4 653	
Cascades inc.	600	8 028	5 418	
Centerra Gold Inc.	3 400	31 785	31 280	
First Quantum Minerals Ltd.	1 200	15 051	21 564	
Interfor Corp.	1 100	32 865	18 172	
Ivanhoe Mines Ltd.	1 600	24 472	28 240	
Neo Performance Materials Inc.	300	2 840	2 475	
New Gold Inc.	2 600	4 473	7 020	
Nutrien Ltd.	3 200	235 771	222 880	
OceanaGold Corp.	6 985	15 809	21 933	
Minière Osisko Inc.	800	3 074	2 288	
Pan American Silver Corp.	100	2 729	2 719	
Silvercorp Metals Inc.	500	2 376	2 290	
Wheaton Precious Metals Corp.	500	36 584	35 865	
		421 008	406 797	0,97
Industries (31 décembre 2023 : 0,77 %)				
ATS Corp.	1 200	54 804	53 124	
Civeo Corp.	46	1 203	1 569	
Magellan Aerospace Corp.	200	1 563	1 628	
		57 570	56 321	0,13
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 0,03 %)				
BRP Inc.	300	28 256	26 295	
Les Industries Dorel Inc., cat B	300	2 976	2 085	
Martinrea International Inc.	300	2 542	3 450	
Roots Corp.	200	586	410	
		34 360	32 240	0,08
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : néant)				
Alimentation Couche-Tard inc.	3 500	265 331	268 695	0,64
Soins de santé (31 décembre 2023 : 0,06 %)				
Extendicare Inc.	400	2 929	2 896	0,01
Services financiers (31 décembre 2023 : 0,33 %)				
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 0,33 %)				
BlackBerry Ltd.	1 400	5 009	4 788	
Novanta Inc.	10	2 195	2 232	
Quarterhill Inc.	300	441	531	
		7 645	7 551	0,02
Services de communication (31 décembre 2023 : 0,08 %)				
Aimia Inc.	300	1 120	810	
BCE Inc.	4 700	214 431	208 257	
Corus Entertainment Inc.	300	1 526	45	
Lions Gate Entertainment Corp., cat. A	525	5 891	6 767	
Telesat Corp.	613	10 609	7 633	
		233 577	223 512	0,53

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Services publics (31 décembre 2023 : 0,90 %)				
Northland Power Inc.	2 500	68 544	58 800	
Polaris Renewable Energy Inc.	100	1 831	1 282	
Superior Plus Corp.	200	2 332	1 774	
		72 707	61 856	0,15
Immobilier (31 décembre 2023 : 0,49 %)				
FPI Granite	900	77 259	61 011	
InterRent REIT	700	8 852	8 337	
Killam Apartment REIT	800	16 523	13 632	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	200	3 216	3 096	
		105 850	86 076	0,21
Total des actions canadiennes – position acheteur		2 419 477	2 426 672	5,80
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -1,70 %)				
Baytex Energy Corp.	(8 900)	(40 888)	(42 186)	
Denison Mines Corp.	(35 300)	(66 464)	(96 722)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(4 805)	(38 259)	(39 844)	
Energy Fuels Inc., TSE	(3 300)	(30 335)	(27 357)	
Gibson Energy Inc.	(200)	(4 362)	(4 650)	
Mattr Corp.	(2 000)	(10 485)	(33 440)	
NexGen Energy Ltd.	(4 500)	(43 323)	(42 930)	
Pason Systems Inc.	(1 300)	(8 389)	(23 959)	
Spartan Delta Corp.	(100)	(313)	(403)	
Total Energy Services Inc.	(300)	(2 246)	(2 898)	
Uranium Royalty Corp.	(200)	(643)	(620)	
Vermilion Energy Inc.	(600)	(10 937)	(9 036)	
		(256 644)	(324 045)	(0,77)
Matières premières (31 décembre 2023 : -0,97 %)				
Algoma Steel Group Inc.	(1 200)	(12 214)	(11 388)	
Canfor Pulp Products Inc.	(500)	(4 627)	(530)	
Capstone Copper Corp.	(3 000)	(30 030)	(29 100)	
Endeavour Silver Corp.	(3 700)	(15 084)	(17 797)	
Equinox Gold Corp.	(11 400)	(79 479)	(81 396)	
ERO Copper Corp.	(200)	(4 253)	(5 848)	
Fortuna Silver Mines Inc.	(1 200)	(6 073)	(8 028)	
I-80 Gold Corp.	(2 900)	(5 352)	(4 176)	
Largo Inc.	(2 100)	(14 477)	(5 292)	
Lithium Americas Argentina Corp.	(9 700)	(76 563)	(42 292)	
Lundin Mining Corp.	(600)	(9 530)	(9 138)	
MAG Silver Corp.	(1 200)	(20 032)	(19 176)	
Northern Dynasty Minerals Ltd.	(22 800)	(23 149)	(9 576)	
Novagold Resources Inc.	(4 000)	(21 266)	(19 160)	
Orla Mining Ltd.	(4 800)	(21 461)	(25 200)	
Perpetua Resources Corp.	(100)	(695)	(709)	
Sandstorm Gold Ltd.	(700)	(5 167)	(5 208)	
Skeena Resources Ltd.	(1 300)	(9 903)	(9 542)	
SSR Mining Inc.	(9 400)	(63 469)	(58 092)	
		(422 824)	(361 648)	(0,86)
Industries (31 décembre 2023 : -1,62 %)				
Ballard Power Systems Inc.	(4 500)	(24 715)	(13 905)	
CAE Inc.	(3 000)	(88 609)	(76 230)	
Chorus Aviation Inc.	(5 600)	(17 840)	(13 552)	
GFL Environmental Inc., TSE	(6 700)	(298 486)	(356 976)	
K-Bro Linen Inc.	(100)	(3 748)	(3 230)	
La Compagnie Électrique Lion	(4 700)	(12 755)	(5 781)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 398)	(8 963)	(1 655)	
RB Global Inc., TSE	(700)	(75 404)	(73 038)	
Corporation Savaria	(300)	(4 435)	(5 397)	
TELUS International CDA Inc.	(1 000)	(11 738)	(7 900)	
Xebec Adsorption Inc.	(1 500)	(4 106)	(574)	
		(550 799)	(558 238)	(1,33)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -0,62 %)				
Bragg Gaming Group Inc.	(400)	(2 378)	(3 256)	
Magna International Inc.	(4 900)	(328 396)	(280 966)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(600)	(30 745)	(26 964)	
Pet Valu Holdings Ltd.	(600)	(16 763)	(15 786)	
Pollard Banknote Ltd.	(100)	(1 804)	(2 800)	
Restaurant Brands International Inc.	(1 300)	(124 638)	(125 320)	
		(504 724)	(455 092)	(1,09)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -0,14 %)				
Les Compagnies Loblaw ltée	(100)	(15 289)	(15 870)	
SunOpta Inc.	(4 300)	(28 777)	(31 648)	
		(44 066)	(47 518)	(0,11)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -1,17 %)				
Bausch Health Cos Inc.	(11 800)	(128 766)	(112 572)	
Cannabist Co Holdings Inc.	(3 500)	(1 722)	(928)	
CannTrust Holdings Inc.	(1 600)	(4 665)	–	
Cronos Group Inc.	(14 700)	(65 618)	(46 893)	
Dentalcorp Holdings Ltd.	(500)	(3 215)	(4 120)	
HLS Therapeutics Inc.	(100)	(1 007)	(335)	
Thérapeutique Knight Inc.	(3 400)	(16 974)	(19 278)	
Oncolytics Biotech Inc.	(1 400)	(3 165)	(1 890)	
Organigram Holdings Inc.	(2 225)	(6 179)	(4 695)	
SNDL Inc.	(25 583)	(82 871)	(66 512)	
Well Health Technologies Corp.	(1 800)	(7 756)	(8 478)	
		(321 938)	(265 701)	(0,63)
Services financiers (31 décembre 2023 : -0,24 %)				
ECN Capital Corp.	(4 305)	(10 780)	(7 189)	(0,02)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -0,99 %)				
Bitfarms Ltd.	(29 800)	(93 558)	(105 194)	
Canadian Solar Inc.	(595)	(11 984)	(12 009)	
Computer Modelling Group Ltd.	(2 600)	(15 464)	(34 294)	
Converge Technology Solutions Corp.	(1 600)	(7 146)	(6 880)	
Dye & Durham Ltd.	(1 100)	(17 374)	(13 552)	
Lightspeed Commerce Inc.	(3 600)	(70 922)	(67 320)	
Open Text Corp.	(300)	(12 102)	(12 324)	
		(228 550)	(251 573)	(0,60)
Services de communication (31 décembre 2023 : -0,08 %)				
IMAX Corp.	(1 302)	(29 268)	(29 877)	
TELUS Corp.	(9 300)	(206 805)	(192 603)	
WildBrain Ltd.	(2 200)	(5 252)	(2 464)	
		(241 325)	(224 944)	(0,54)
Services publics (31 décembre 2023 : néant)				
Capital Power Corp.	(100)	(4 133)	(3 899)	(0,01)
Immobilier (31 décembre 2023 : -0,19 %)				
DREAM Unlimited Corp.	(400)	(9 080)	(7 860)	
European Residential REIT	(1 100)	(3 813)	(2 563)	
Morguard REIT	(100)	(553)	(530)	
NorthWest Healthcare Properties REIT	(100)	(398)	(466)	
StorageVault Canada Inc.	(100)	(475)	(466)	
True North Commercial REIT	(138)	(2 402)	(1 180)	
		(16 721)	(13 065)	(0,03)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(2 602 504)	(2 512 912)	(5,99)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 4,14 %)				
Antero Midstream Corp.	4 171	67 132	84 127	
Antero Resources Corp.	970	45 027	43 310	
Berry Corp.	460	4 332	4 066	
Chesapeake Energy Corp.	54	6 141	6 073	
CNX Resources Corp.	1 763	58 088	58 621	
Comstock Resources Inc.	690	10 289	9 800	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
ConocoPhillips	256	39 823	40 067	
CONSOL Energy Inc.	46	6 137	6 422	
Diamondback Energy Inc.	582	143 602	159 427	
DT Midstream Inc.	516	41 846	50 152	
FutureFuel Corp.	476	5 123	3 341	
Halliburton Co.	87	3 997	4 021	
Helmerich & Payne Inc.	74	3 364	3 659	
Hess Midstream LP	697	31 614	34 754	
Magnolia Oil & Gas Corp.	4 014	141 037	139 181	
Mammoth Energy Services Inc.	259	1 721	1 162	
Matador Resources Co.	332	30 409	27 076	
Murphy Oil Corp.	1 297	68 450	73 190	
Natural Gas Services Group Inc.	15	487	413	
Oil States International Inc.	1 346	11 897	8 178	
PBF Energy Inc.	615	48 003	38 727	
Peabody Energy Corp.	3 434	110 315	103 940	
PHX Minerals Inc.	308	1 420	1 374	
Viper Energy Inc.	293	15 841	15 047	
		896 095	916 128	2,20
Matières premières (31 décembre 2023 : 1,51 %)				
Advanced Emissions Solutions Inc.	254	2 618	2 110	
Alcoa Corp.	29	1 561	1 579	
Celanese Corp.	174	35 354	32 116	
CF Industries Holdings Inc.	45	4 656	4 564	
Clearwater Paper Corp.	287	16 323	19 035	
Eastman Chemical Co.	150	20 514	20 109	
Ecovyst Inc.	703	9 149	8 629	
Graphic Packaging Holding Co.	517	19 295	18 542	
Greif Inc.	23	1 975	1 809	
HB Fuller Co.	365	39 323	38 437	
Hecla Mining Co.	4 167	29 857	27 654	
Huntsman Corp.	572	17 809	17 822	
Ingevity Corp.	390	24 213	23 326	
International Flavors & Fragrances Inc.	133	17 108	17 327	
International Paper Co.	404	23 801	23 854	
McEwen Mining Inc.	1 230	16 609	15 437	
Minerals Technologies Inc.	47	4 709	5 348	
O-I Glass Inc.	788	15 658	12 001	
Quaker Chemical Corp.	9	2 064	2 090	
Rayonier Advanced Materials Inc.	132	917	983	
Sensient Technologies Corp.	44	3 441	4 467	
SunCoke Energy Inc.	773	11 403	10 366	
Tredegar Corp.	535	3 891	3 507	
TriMas Corp.	23	765	804	
Universal Stainless & Alloy Products Inc.	28	1 074	1 049	
Warrior Met Coal Inc.	433	39 587	37 191	
		363 674	350 156	0,84
Industries (31 décembre 2023 : 6,47 %)				
3M Co.	1 790	247 608	250 298	
AAON Inc.	460	51 528	54 912	
ABM Industries Inc.	159	9 541	11 002	
Acuity Brands Inc.	12	3 967	3 964	
Alamo Group Inc.	17	4 102	4 024	
Alaska Air Group Inc.	122	7 273	6 744	
Albany International Corp.	74	8 990	8 551	
Allient Inc.	25	975	864	
American Superconductor Corp.	2 459	45 003	78 702	
American Woodmark Corp.	48	5 436	5 162	
AMETEK Inc.	85	19 762	19 390	
Apogee Enterprises Inc.	27	1 496	2 321	
Argan Inc.	188	16 103	18 820	
Aris Water Solutions Inc.	298	5 579	6 390	
Armstrong World Industries Inc.	16	2 706	2 479	
ASGN Inc.	166	19 925	20 027	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Astronics Corp.	136	2 369	3 727	
Atkore Inc.	112	22 394	20 679	
Barnes Group Inc.	562	23 853	31 845	
BGSF Inc.	18	358	211	
Blue Bird Corp.	78	3 996	5 747	
Boeing Co.	1 645	432 533	409 691	
Boise Cascade Co.	275	54 095	44 862	
Builders FirstSource Inc.	420	97 668	79 545	
Caterpillar Inc.	138	61 557	62 900	
CECO Environmental Corp.	49	1 359	1 934	
Comfort Systems USA Inc.	186	48 283	77 402	
Commercial Vehicle Group Inc.	67	669	449	
Construction Partners Inc.	34	2 315	2 569	
CSG Systems International Inc.	85	5 761	4 788	
CSW Industrials Inc.	82	25 830	29 769	
CSX Corp.	2 139	108 638	97 904	
Deluxe Corp.	340	9 324	10 449	
Ducommun Inc.	116	8 018	9 216	
Dun & Bradstreet Holdings Inc.	5 126	68 394	64 951	
DXP Enterprises Inc.	46	2 683	2 885	
Eastern Co.	40	1 155	1 394	
EMCOR Group Inc.	20	10 112	9 991	
Emerson Electric Co.	739	112 741	111 395	
EnerSys	358	44 672	50 711	
Ennis Inc.	260	7 279	7 788	
Enpro Inc.	23	4 769	4 581	
Enviri Corp.	1 115	9 353	13 167	
Expeditors International of Washington Inc.	154	25 616	26 296	
Exponent Inc.	1	124	130	
Fastenal Co.	704	61 867	60 535	
FedEx Corp.	8	2 770	3 282	
Fortune Brands Innovations Inc.	216	19 709	19 194	
Frontier Group Holdings Inc.	1 682	18 759	11 347	
Gorman-Rupp Co.	231	8 801	11 604	
Graham Corp.	20	818	771	
Great Lakes Dredge & Dock Corp.	930	11 718	11 173	
GXO Logistics Inc.	1	64	69	
H&E Equipment Services Inc.	139	9 690	8 401	
Healthcare Services Group Inc.	100	1 477	1 448	
HEICO Corp.	229	55 991	70 068	
Hertz Global Holdings Inc.	1 113	12 584	5 376	
Hexcel Corp.	744	66 677	63 577	
Hillenbrand Inc.	37	2 070	2 026	
HNI Corp.	846	47 248	52 116	
Howmet Aerospace Inc.	292	26 600	31 018	
Ingersoll Rand Inc.	111	13 616	13 797	
Janus International Group Inc.	245	4 361	4 234	
JB Hunt Transport Services Inc.	264	58 280	57 799	
John Bean Technologies Corp.	109	13 854	14 165	
Kennametal Inc.	1 531	53 091	49 315	
LSI Industries Inc.	408	7 085	8 078	
Lyft Inc.	15 013	333 975	289 656	
Manitowoc Co Inc.	197	3 781	3 108	
Matrix Service Co.	322	5 431	4 375	
Matthews International Corp.	155	5 327	5 313	
Mayville Engineering Co Inc.	26	563	593	
MillerKnoll Inc.	521	11 706	18 885	
Mistras Group Inc.	136	1 027	1 543	
Moog Inc.	92	20 296	21 061	
MRC Global Inc.	47	764	830	
MSC Industrial Direct Co Inc.	308	33 124	33 425	
NL Industries Inc.	130	1 114	1 073	
OPENLANE Inc.	2 991	66 277	67 898	
Orion Group Holdings Inc.	352	4 122	4 581	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
PACCAR Inc.	118	17 324	16 621	
Parker-Hannifin Corp.	4	2 799	2 768	
Paycor HCM Inc.	165	3 200	2 867	
Powell Industries Inc.	357	66 166	70 051	
Primoris Services Corp.	279	16 832	19 046	
Proto Labs Inc.	60	2 651	2 536	
Quad/Graphics Inc.	615	2 683	4 586	
Quanex Building Products Corp.	51	2 119	1 930	
RBC Bearings Inc.	142	49 208	52 420	
Regal Rexnord Corp.	77	14 826	14 247	
Robert Half Inc.	403	35 784	35 281	
Rockwell Automation Inc.	132	46 926	49 721	
Rush Enterprises Inc.	145	9 223	8 307	
Science Applications International Corp.	85	13 685	13 672	
Shyft Group Inc.	94	1 488	1 525	
Southwest Airlines Co.	1 758	68 756	68 823	
Spire Global Inc.	29	417	430	
Steelcase Inc.	266	3 754	4 717	
Sterling Infrastructure Inc.	542	45 457	87 766	
Sun Country Airlines Holdings Inc.	76	1 204	1 306	
Timken Co.	128	14 365	14 035	
TransDigm Group Inc.	19	29 881	33 216	
TransUnion	661	66 120	67 076	
Triumph Group Inc.	1 883	33 467	39 705	
TrueBlue Inc.	473	6 637	6 666	
TTEC Holdings Inc.	201	2 704	1 617	
Tutor Perini Corp.	683	14 193	20 355	
Ultralife Corp.	30	486	436	
UniFirst Corp.	29	6 655	6 807	
United Rentals Inc.	168	151 438	148 672	
Universal Logistics Holdings Inc.	6	373	333	
Upwork Inc.	1 597	27 997	23 491	
V2X Inc.	25	1 449	1 641	
Verra Mobility Corp.	1 156	39 132	43 025	
Vertiv Holdings Co.	229	25 333	27 127	
Virgin Galactic Holdings Inc.	869	10 463	10 024	
Wabash National Corp.	661	22 198	19 754	
Watsco Inc.	233	122 603	147 692	
Watts Water Technologies Inc.	18	4 734	4 516	
WESCO International Inc.	141	31 341	30 584	
Willdan Group Inc.	17	764	671	
Willis Lease Finance Corp.	29	777	2 750	
Zurn Elkay Water Solutions Corp.	400	17 393	16 092	
		3 665 554	3 757 265	8,96
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 9,78%)				
Adtalem Global Education Inc.	202	17 575	18 854	
Amazon.com Inc.	697	175 575	184 310	
American Axle & Manufacturing Holdings Inc.	4 122	40 211	39 426	
American Eagle Outfitters Inc.	4 439	140 775	121 239	
American Public Education Inc.	232	5 500	5 581	
Beazer Homes USA Inc.	442	9 530	16 620	
Beyond Inc.	2 827	96 225	50 598	
Big Lots Inc.	817	5 252	1 934	
Boot Barn Holdings Inc.	548	59 272	96 679	
BorgWarner Inc.	311	14 054	13 720	
CarMax Inc.	3 993	400 025	400 715	
Carriage Services Inc.	18	703	661	
Chegg Inc.	6 614	51 518	28 599	
Chewy Inc.	4 625	136 643	172 391	
China Automotive Systems Inc.	3 916	24 634	19 022	
Dana Inc.	2 636	46 974	43 716	
Dillard's Inc.	5	2 824	3 013	
DoorDash Inc.	1 195	181 028	177 874	
DraftKings Inc.	2 269	120 385	118 509	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Dream Finders Homes Inc.	253	9 651	8 939	
El Pollo Loco Holdings Inc.	120	1 683	1 857	
Etsy Inc.	742	72 942	59 883	
Foot Locker Inc.	1 092	33 448	37 236	
Frontdoor Inc.	666	29 263	30 793	
Genesco Inc.	62	2 050	2 194	
Gentex Corp.	184	8 540	8 487	
Grand Canyon Education Inc.	55	10 205	10 529	
Hanesbrands Inc.	405	3 237	2 732	
Harley-Davidson Inc.	935	43 743	42 911	
Hasbro Inc.	824	68 941	65 960	
Hilton Worldwide Holdings Inc.	110	32 113	32 843	
Hovnanian Enterprises Inc.	3	604	583	
Installed Building Products Inc.	229	66 357	64 450	
J Jill Inc.	132	4 791	6 316	
Jack in the Box Inc.	342	26 795	23 839	
JAKKS Pacific Inc.	66	2 154	1 617	
Kohl's Corp.	2 423	84 821	76 223	
Landsea Homes Corp.	429	5 094	5 395	
Laureate Education Inc.	430	8 509	8 791	
Lear Corp.	385	61 262	60 167	
Leggett & Platt Inc.	4 176	80 076	65 485	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	280	3 082	3 697	
Macy's Inc.	3 884	86 214	102 041	
Malibu Boats Inc.	198	9 900	9 493	
Marriott Vacations Worldwide Corp.	435	59 537	51 975	
Newell Brands Inc.	4 254	45 540	37 312	
Nordstrom Inc.	2 133	49 952	61 934	
Papa John's International Inc.	437	35 363	28 092	
Penn Entertainment Inc.	4 772	115 682	126 383	
Perdoceo Education Corp.	900	22 699	26 379	
Petco Health & Wellness Co Inc.	8 083	40 670	41 808	
Polaris Inc.	1 036	139 309	111 013	
Qurate Retail Inc.	3 311	8 623	2 854	
Red Robin Gourmet Burgers Inc.	248	2 412	2 569	
Revolve Group Inc.	297	8 028	6 466	
Rush Street Interactive Inc.	1 922	22 416	25 221	
Sabre Corp.	790	2 479	2 886	
Sleep Number Corp.	129	2 049	1 689	
Sonos Inc.	4 024	88 540	81 272	
Steven Madden Ltd.	653	35 038	37 796	
Stitch Fix Inc.	2 261	11 426	12 839	
Strategic Education Inc.	143	21 848	21 653	
Sturm Ruger & Co Inc.	213	13 200	12 139	
Superior Group of Cos Inc.	15	403	388	
Sweetgreen Inc.	1 315	46 798	54 233	
TopBuild Corp.	125	69 084	65 898	
Universal Technical Institute Inc.	196	2 573	4 219	
Upbound Group Inc.	293	13 163	12 308	
Vail Resorts Inc.	33	8 065	8 134	
Vera Bradley Inc.	243	2 374	2 082	
VF Corp.	15 271	280 520	282 096	
Warby Parker Inc.	188	4 372	4 131	
Whirlpool Corp.	713	99 886	99 709	
Williams-Sonoma Inc.	30	12 285	11 591	
WW International Inc.	5 530	17 831	8 853	
Xponential Fitness Inc.	250	3 494	5 337	
YETI Holdings Inc.	1 107	56 172	57 788	
Zumiez Inc.	59	1 537	1 573	
		3 627 546	3 556 542	8,48
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : 2,68 %)				
Altria Group Inc.	568	35 367	35 402	
BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	938	94 795	112 743	
Boston Beer Co Inc.	46	18 869	19 201	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Brown-Forman Corp., cat. B	1 031	62 433	60 931	
Casey's General Stores Inc.	39	19 988	20 362	
Central Garden & Pet Co., cat. A	50	2 474	2 260	
Constellation Brands Inc.	87	29 889	30 628	
Coty Inc.	3 349	45 284	45 918	
Edgewell Personal Care Co.	122	6 432	6 709	
Energizer Holdings Inc.	1 266	50 266	51 173	
Estée Lauder Cos Inc.	1 966	392 757	286 234	
Freshpet Inc.	655	112 547	115 968	
Hain Celestial Group Inc.	468	4 048	4 425	
Hershey Co.	85	22 972	21 381	
Honest Co Inc.	1 308	7 028	5 226	
Ingles Markets Inc.	65	7 840	6 102	
J M Smucker Co.	138	21 073	20 590	
LifeMD Inc.	3 255	37 557	30 554	
Molson Coors Beverage Co.	545	40 811	37 906	
National Beverage Corp.	28	1 972	1 963	
Nu Skin Enterprises Inc.	732	21 790	10 557	
Oil-Dri Corp. of America	57	1 922	4 999	
Pilgrim's Pride Corp.	37	1 845	1 949	
SpartanNash Co.	46	1 186	1 181	
Tyson Foods Inc.	2 334	179 740	182 489	
United Natural Foods Inc.	414	8 733	7 421	
Vector Group Ltd.	134	2 052	1 938	
Village Super Market Inc.	140	4 215	5 059	
Vital Farms Inc.	1 352	68 430	86 525	
		1 304 315	1 217 794	2,91
Soins de santé (31 décembre 2023 : 9,96 %)				
ABIOMED Inc., droits	13	–	–	
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	8 706	211 104	193 583	
Accolade Inc.	537	9 174	2 631	
Aclaris Therapeutics Inc.	720	1 211	1 084	
Adicet Bio Inc.	2 415	8 312	3 999	
ADMA Biologics Inc.	3 520	35 722	53 849	
Agenus Inc.	691	6 104	15 838	
Agilent Technologies Inc.	186	33 246	32 992	
Agios Pharmaceuticals Inc.	158	9 553	9 322	
Akebia Therapeutics Inc.	2 840	7 499	3 964	
Akero Therapeutics Inc.	257	9 135	8 250	
Alnylam Pharmaceuticals Inc.	392	81 951	130 343	
Alphatec Holdings Inc.	1 518	25 976	21 706	
ALX Oncology Holdings Inc.	76	686	627	
Amicus Therapeutics Inc.	1 209	16 121	16 411	
AMN Healthcare Services Inc.	366	29 707	25 657	
Amneal Pharmaceuticals Inc.	1 955	7 015	16 987	
Amphastar Pharmaceuticals Inc.	888	52 437	48 604	
Amylyx Pharmaceuticals Inc.	2 633	32 900	6 845	
AngioDynamics Inc.	401	4 918	3 320	
ANI Pharmaceuticals Inc.	28	2 445	2 440	
Anika Therapeutics Inc.	12	414	416	
Annexon Inc.	106	869	711	
Arcellx Inc.	94	6 860	7 099	
Arcturus Therapeutics Holdings Inc.	381	15 449	12 695	
Atossa Therapeutics Inc.	509	1 243	829	
AtriCure Inc.	487	19 467	15 174	
Aura Biosciences Inc.	37	466	383	
Axogen Inc.	217	2 015	2 150	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	2 027	19 966	17 141	
Biogen Inc.	550	156 504	174 465	
Black Diamond Therapeutics Inc.	1 807	11 381	11 522	
Blueprint Medicines Corp.	15	2 213	2 212	
Brookdale Senior Living Inc.	622	3 111	5 813	
CareDx Inc.	1 870	32 142	39 738	
Castle Biosciences Inc.	452	14 178	13 465	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Chimerix Inc.	980	3 330	1 175	
Clover Health Investments Corp.	7 995	10 958	13 456	
Compass Therapeutics Inc.	690	2 244	944	
Cooper Cos Inc.	46	5 592	5 495	
Corcept Therapeutics Inc.	4 288	142 814	190 634	
Corvus Pharmaceuticals Inc.	138	415	344	
Crinetics Pharmaceuticals Inc.	220	13 689	13 483	
Cytek Biosciences Inc.	1 413	11 338	10 789	
CytomX Therapeutics Inc.	1 153	3 974	1 925	
DENTSPLY SIRONA Inc.	1 219	42 955	41 550	
Editas Medicine Inc.	1 062	14 179	6 786	
Edwards Lifesciences Corp.	393	47 135	49 673	
Embecta Corp.	432	12 306	7 389	
Emergent BioSolutions Inc.	4 814	22 219	44 925	
Enovis Corp.	910	65 683	56 283	
Entrada Therapeutics Inc.	30	581	585	
Erasca Inc.	628	2 391	2 028	
Esperion Therapeutics Inc.	2 823	10 755	8 576	
Eton Pharmaceuticals Inc.	65	358	293	
Exact Sciences Corp.	2 836	188 119	163 956	
EyePoint Pharmaceuticals Inc.	375	10 840	4 464	
Flexion Therapeutics Inc., droits	87	–	–	
G1 Therapeutics Inc.	2 214	11 028	6 907	
Gilead Sciences Inc.	763	67 249	71 632	
Glaukos Corp.	332	29 179	53 765	
GoodRx Holdings Inc.	3 702	31 761	39 512	
GRAIL Inc.	78	1 985	1 640	
Haemonetics Corp.	447	52 277	50 602	
Halozyme Therapeutics Inc.	285	20 265	20 419	
Health Catalyst Inc.	77	694	673	
Hims & Hers Health Inc.	7 194	147 991	198 748	
Ideaya Biosciences Inc.	710	41 220	34 110	
Illumina Inc.	381	57 207	54 417	
Immunovant Inc.	1 525	63 505	55 090	
Inari Medical Inc.	518	30 863	34 129	
Incyte Corp.	4 494	362 958	372 773	
Inogen Inc.	195	1 794	2 169	
Insmed Inc.	160	14 797	14 669	
Inspire Medical Systems Inc.	439	104 868	80 392	
Integer Holdings Corp.	18	2 859	2 852	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	769	45 332	50 151	
iRadimed Corp.	175	9 770	10 522	
Ironwood Pharmaceuticals Inc.	346	2 920	3 087	
Johnson & Johnson	1 977	398 047	395 395	
KORU Medical Systems Inc.	100	533	363	
Kura Oncology Inc.	60	1 682	1 690	
Larimar Therapeutics Inc.	258	4 085	2 559	
Ligand Pharmaceuticals Inc., cat. B	143	14 793	16 487	
MacroGenics Inc.	2 067	38 634	12 021	
Madrigal Pharmaceuticals Inc.	504	163 622	193 211	
MannKind Corp.	7 474	48 210	53 385	
Maravai LifeSciences Holdings Inc.	2 893	31 528	28 344	
Medpace Holdings Inc.	101	41 830	56 919	
Merit Medical Systems Inc.	19	2 144	2 235	
Mesa Laboratories Inc.	5	625	594	
MiMedx Group Inc.	1 157	9 523	10 971	
Mirum Pharmaceuticals Inc.	227	10 087	10 620	
Morphic Holding Inc.	421	18 829	19 627	
Myriad Genetics Inc.	115	3 853	3 849	
Nektar Therapeutics	415	857	704	
Novavax Inc.	448	11 079	7 761	
Nuvalent Inc.	392	37 582	40 691	
Nuvation Bio Inc.	1 011	4 816	4 040	
Olema Pharmaceuticals Inc.	79	1 544	1 170	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Omnicell Inc.	211	9 295	7 816	
Option Care Health Inc.	319	12 329	12 091	
OraSure Technologies Inc.	1 157	10 351	6 744	
Organogenesis Holdings Inc.	425	1 849	1 628	
Orthofix Medical Inc.	92	1 944	1 669	
Owens & Minor Inc.	80	1 514	1 478	
PDL BioPharma Inc.	467	567	–	
Pediatrix Medical Group Inc.	768	12 270	7 934	
PMV Pharmaceuticals Inc.	1 098	3 377	2 434	
Poseida Therapeutics Inc.	715	2 973	2 857	
Protagonist Therapeutics Inc.	313	10 725	14 840	
PTC Therapeutics Inc.	463	21 767	19 374	
Puma Biotechnology Inc.	994	7 928	4 434	
Repligen Corp.	55	10 607	9 487	
Replimune Group Inc.	372	6 439	4 581	
ResMed Inc.	61	15 232	15 978	
REVOLUTION Medicines Inc.	266	12 940	14 126	
Revvity Inc.	138	19 770	19 801	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	33	1 827	1 854	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	53	972	596	
Sarepta Therapeutics Inc.	500	87 417	108 099	
Savara Inc.	1 158	4 146	6 386	
Seer Inc.	56	394	129	
Shattuck Labs Inc.	570	5 814	3 011	
SIGA Technologies Inc.	722	7 954	7 499	
Silk Road Medical Inc.	94	2 303	3 478	
Sotera Health Co.	55	862	893	
STAAR Surgical Co.	50	3 090	3 257	
Supernus Pharmaceuticals Inc.	156	6 952	5 710	
Tandem Diabetes Care Inc.	843	41 495	46 475	
Tarsus Pharmaceuticals Inc.	178	7 629	6 620	
Teladoc Health Inc.	9 137	213 519	122 275	
Teleflex Inc.	237	66 073	68 210	
TG Therapeutics Inc.	1 412	30 777	34 372	
Tilray Brands Inc.	5 300	14 570	12 031	
TransMedics Group Inc.	206	37 350	42 457	
Travere Therapeutics Inc.	1 526	32 691	17 164	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	784	48 803	44 091	
United Therapeutics Corp.	296	96 007	129 022	
Utah Medical Products Inc.	8	770	731	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	2 144	12 851	16 576	
Vaxcyte Inc.	372	34 875	38 436	
Veeva Systems Inc.	195	48 648	48 832	
Ventyx Biosciences Inc.	2 376	17 982	7 510	
Veracyte Inc.	790	23 639	23 425	
Viking Therapeutics Inc.	180	15 657	13 056	
Waters Corp.	324	131 489	128 623	
West Pharmaceutical Services Inc.	80	41 360	36 058	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	398	4 626	6 579	
Zentalis Pharmaceuticals Inc.	710	6 744	3 974	
Zimmer Biomet Holdings Inc.	229	35 907	34 008	
Zoetis Inc.	1 020	234 440	241 961	
		4 909 304	4 958 583	11,83
Services financiers (31 décembre 2023 : 5,02 %)				
Affirm Holdings Inc.	1 599	68 483	66 099	
AG Mortgage Investment Trust Inc.	917	8 120	8 332	
Arrow Financial Corp.	12	457	428	
Artisan Partners Asset Management Inc.	348	19 036	19 652	
AvidXchange Holdings Inc.	1 909	28 552	31 503	
Axos Financial Inc.	168	13 100	13 138	
Bancorp Inc.	75	3 212	3 875	
Bank OZK	87	4 906	4 881	
Block Inc.	4 603	421 721	406 190	
Bread Financial Holdings Inc.	467	21 036	28 475	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Byline Bancorp Inc.	79	2 343	2 566	
Camden National Corp.	256	11 146	11 560	
Central Pacific Financial Corp.	74	1 885	2 147	
Civista Bancshares Inc.	100	2 921	2 120	
CNB Financial Corp.	12	357	335	
CNO Financial Group Inc.	1 940	70 484	73 585	
Coinbase Global Inc.	936	271 842	284 626	
Commerce Bancshares Inc.	218	16 040	16 639	
Community Financial System Inc.	58	3 554	3 747	
CrossFirst Bankshares Inc.	29	564	556	
CVB Financial Corp.	606	12 565	14 296	
Eagle Bancorp Inc.	180	4 124	4 655	
East West Bancorp Inc.	217	21 504	21 744	
eHealth Inc.	369	4 115	2 287	
Enact Holdings Inc.	78	2 819	3 272	
Enova International Inc.	659	55 351	56 133	
Erie Indemnity Co.	11	5 382	5 455	
ESSA Bancorp Inc.	14	369	337	
FactSet Research Systems Inc.	78	43 595	43 575	
Fifth Third Bancorp	240	11 712	11 983	
First Community Corp.	103	2 663	2 431	
First Financial Corp.	91	4 638	4 592	
First Hawaiian Inc.	276	8 112	7 840	
First of Long Island Corp.	24	416	329	
Franklin Resources Inc.	1 500	46 832	45 874	
Genworth Financial Inc.	559	4 560	4 620	
Globe Life Inc.	2 332	239 108	262 554	
Green Dot Corp.	955	11 533	12 349	
Hanmi Financial Corp.	54	1 334	1 235	
HCI Group Inc.	43	6 503	5 423	
Heritage Insurance Holdings Inc.	1 024	9 544	9 920	
Hippo Holdings Inc.	129	3 177	3 034	
International Money Express Inc.	35	983	998	
Jackson Financial Inc.	35	3 479	3 556	
Kemper Corp.	76	6 201	6 170	
LendingTree Inc.	108	7 062	6 146	
Lincoln National Corp.	901	35 845	38 343	
MarketAxess Holdings Inc.	23	6 193	6 311	
Medallion Financial Corp.	128	1 240	1 345	
Merchants Bancorp/IN	635	34 857	35 225	
Mercury General Corp.	70	3 739	5 090	
Moelis & Co.	473	31 455	36 801	
National Bankshares Inc.	69	2 777	2 670	
NerdWallet Inc.	630	10 153	12 586	
NMI Holdings Inc.	823	32 302	38 334	
Old Second Bancorp Inc.	531	10 258	10 761	
OP Bancorp	100	1 545	1 312	
Origin Bancorp Inc.	117	5 224	5 078	
Orrstown Financial Services Inc.	317	11 544	11 868	
Pathward Financial Inc.	15	1 006	1 161	
Paymentus Holdings Inc.	56	1 571	1 456	
Peoples Bancorp Inc.	294	12 242	12 069	
PRA Group Inc.	15	506	404	
Preferred Bank	28	2 433	2 892	
Premier Financial Corp.	551	14 981	15 426	
Primis Financial Corp.	26	389	373	
Regions Financial Corp.	3 056	81 565	83 800	
Remitly Global Inc.	2 497	67 567	41 411	
Robinhood Markets Inc.	9 286	199 522	288 563	
Root Inc.	356	21 514	25 141	
Safety Insurance Group Inc.	59	6 527	6 057	
SoFi Technologies Inc.	10 195	102 710	92 211	
Southside Bancshares Inc.	213	7 633	8 047	
Starwood Property Trust Inc.	2 327	62 687	60 308	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
StepStone Group Inc.	69	4 130	4 333	
Toast Inc.	3 994	111 374	140 837	
TPG RE Finance Trust Inc.	927	9 995	10 959	
Truist Financial Corp.	155	7 753	8 240	
United Bankshares Inc.	1 647	73 692	73 109	
Universal Insurance Holdings Inc.	1 173	31 522	30 111	
Upstart Holdings Inc.	3 387	116 942	109 330	
UWM Holdings Corp.	923	8 055	8 752	
Virtus Investment Partners Inc.	93	27 072	28 741	
Westamerica BanCorp	29	1 874	1 926	
Western New England Bancorp Inc.	396	3 581	3 728	
		2 653 415	2 786 371	6,65
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 17,28 %)				
8x8 Inc.	3 730	16 085	11 331	
A10 Networks Inc.	1 955	36 007	37 050	
Alarm.com Holdings Inc.	508	41 383	44 168	
Alkami Technology Inc.	30	1 118	1 169	
Altair Engineering Inc.	324	32 446	43 483	
American Software Inc.	282	4 170	3 523	
Appfolio Inc.	6	1 806	2 008	
Appian Corp.	339	17 044	14 315	
Arlo Technologies Inc.	3 794	54 810	67 697	
Arteris Inc.	24	291	247	
AudioEye Inc.	42	835	1 012	
Autodesk Inc.	345	99 695	116 816	
AvePoint Inc.	718	7 588	10 237	
Axcelis Technologies Inc.	1 019	166 010	198 262	
AXT Inc.	2 180	12 342	10 083	
Backblaze Inc.	389	5 638	3 279	
Badger Meter Inc.	320	80 935	81 597	
Benchmark Electronics Inc.	211	7 750	11 393	
BigCommerce Holdings Inc.	596	6 333	6 573	
BILL Holdings Inc.	353	23 695	25 417	
Blackbaud Inc.	324	31 572	33 769	
BlackLine Inc.	557	35 565	36 927	
Box Inc.	739	27 426	26 736	
Braze Inc.	263	14 977	13 978	
Brightcove Inc., droits	137	1 164	444	
Broadcom Inc.	159	352 989	349 310	
Cadence Design Systems Inc.	28	11 088	11 791	
Calix Inc.	138	5 724	6 690	
Cerence Inc.	1 333	23 500	5 162	
CEVA Inc.	153	4 979	4 038	
Cirrus Logic Inc.	522	60 649	91 184	
Clear Secure Inc.	6 600	180 134	168 971	
Clearwater Analytics Holdings Inc.	3 184	78 593	80 688	
Cohu Inc.	362	17 726	16 396	
Consensus Cloud Solutions Inc.	78	1 474	1 834	
Couchbase Inc.	236	5 600	5 897	
CPI Card Group Inc.	15	764	559	
Crane NXT Co.	169	13 677	14 203	
Crowdstrike Holdings Inc.	16	8 415	8 389	
Daktronics Inc.	66	1 203	1 260	
DocuSign Inc.	1 075	74 123	78 697	
Domo Inc.	177	2 343	1 870	
Dropbox Inc.	4 536	147 203	139 467	
Dynatrace Inc.	724	44 449	44 323	
Envestnet Inc.	179	15 436	15 330	
Expensify Inc.	259	804	528	
Extreme Networks Inc.	2 737	56 227	50 372	
Fabrinet	171	46 715	57 278	
FARO Technologies Inc.	182	5 136	3 985	
Five9 Inc.	502	33 233	30 293	
FormFactor Inc.	268	19 202	22 197	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Freshworks Inc.	464	11 301	8 057	
Gitlab Inc.	585	35 429	39 800	
Guidewire Software Inc.	368	39 559	69 435	
Hewlett Packard Enterprise Co.	152	4 220	4 403	
Immersion Corp.	342	4 001	4 404	
Insight Enterprises Inc.	4	1 078	1 086	
Intapp Inc.	597	29 952	29 956	
Intel Corp.	4 411	211 185	186 928	
Intevac Inc.	743	4 270	3 924	
Itron Inc.	404	55 819	54 706	
Jamf Holding Corp.	154	3 894	3 477	
Keysight Technologies Inc.	171	31 936	31 998	
Kimball Electronics Inc.	84	2 472	2 526	
Knowles Corp.	1 011	22 798	23 877	
Kulicke & Soffa Industries Inc.	599	38 649	40 318	
Kyndryl Holdings Inc.	4 186	142 679	150 701	
LiveRamp Holdings Inc.	335	14 043	14 183	
Lumentum Holdings Inc.	764	46 785	53 233	
Magnachip Semiconductor Corp.	90	1 030	600	
Marvell Technology Inc.	2 515	246 660	240 553	
MaxLinear Inc.	608	16 408	16 756	
Methode Electronics Inc.	117	1 689	1 657	
Micron Technology Inc.	1 952	268 188	351 318	
nCino Inc.	1 148	42 106	49 404	
NCR Voyix Corp.	1 553	25 960	26 244	
NETGEAR Inc.	233	4 067	4 878	
NetScout Systems Inc.	1 421	35 959	35 563	
nLight Inc.	324	5 365	4 846	
Nutanix Inc.	4 785	316 688	372 227	
Okta Inc.	1 502	173 907	192 392	
Olo Inc.	1 567	11 669	9 477	
OneSpan Inc.	936	15 038	16 419	
OSI Systems Inc.	28	5 234	5 269	
PagerDuty Inc.	2 789	93 103	87 508	
PDF Solutions Inc.	291	12 923	14 486	
Pegasystems Inc.	755	55 113	62 534	
Photronics Inc.	403	10 301	13 604	
Pixelworks Inc.	733	2 662	986	
Power Integrations Inc.	138	13 859	13 254	
Procore Technologies Inc.	1 648	140 246	149 531	
Progress Software Corp.	277	20 089	20 566	
Pure Storage Inc.	4 500	282 201	395 376	
Q2 Holdings Inc.	1 109	67 451	91 550	
Qualys Inc.	112	21 489	21 854	
QuickLogic Corp.	92	1 980	1 308	
Rapid7 Inc.	403	22 242	23 839	
Ribbon Communications Inc.	222	986	999	
Rimini Street Inc.	1 045	5 252	4 390	
RingCentral Inc.	2 313	98 403	89 252	
Rogers Corp.	8	1 288	1 320	
Roper Technologies Inc.	64	46 584	49 362	
Sanmina Corp.	417	33 057	37 802	
SecureWorks Corp.	19	345	182	
SEMrush Holdings Inc.	122	1 865	2 235	
Semtech Corp.	1 641	71 317	67 094	
SentinelOne Inc.	723	17 265	20 825	
SmartRent Inc.	418	1 699	1 367	
Smartsheet Inc.	1 395	78 171	84 142	
Snowflake Inc.	44	7 550	8 133	
SolarEdge Technologies Inc.	73	2 566	2 523	
SolarWinds Corp.	127	1 957	2 094	
SoundThinking Inc.	27	434	450	
Sprout Social Inc.	1 457	67 970	71 134	
Synaptics Inc.	295	38 518	35 603	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Telos Corp.	312	1 694	1 716	
Tenable Holdings Inc.	84	4 890	5 009	
Texas Instruments Inc.	249	66 651	66 280	
TTM Technologies Inc.	95	2 407	2 526	
Turtle Beach Corp.	1 138	25 761	22 330	
Unity Software Inc.	4 740	180 491	105 462	
Varonis Systems Inc.	921	44 071	60 454	
Veeco Instruments Inc.	301	12 994	19 239	
Verint Systems Inc.	323	10 304	14 232	
Viasat Inc.	111	2 344	1 929	
Viavi Solutions Inc.	1 385	13 898	13 020	
Weave Communications Inc.	469	6 713	5 789	
Western Digital Corp.	1 067	105 061	110 626	
Wolfspeed Inc.	618	25 183	19 247	
Workiva Inc.	206	22 529	20 574	
Xperi Inc.	237	3 310	2 662	
Yext Inc.	3 584	36 217	26 237	
Zeta Global Holdings Corp.	3 077	45 748	74 314	
Zscaler Inc.	1 117	308 021	293 751	
Zuora Inc.	3 450	40 245	46 877	
		5 985 527	6 350 418	15,15
Services de communication (31 décembre 2023 : 4,98 %)				
Alphabet Inc., cat. C	28	7 155	7 027	
Angi Inc.	1 495	17 353	3 928	
Bandwidth Inc.	705	18 297	16 284	
Cable One Inc.	7	3 337	3 391	
Cinemark Holdings Inc.	150	4 348	4 438	
Eventbrite Inc.	1 156	12 430	7 656	
EverQuote Inc.	31	968	885	
Iridium Communications Inc.	438	15 708	15 954	
John Wiley & Sons Inc.	29	1 583	1 615	
Lumen Technologies Inc.	6 326	36 895	9 522	
Madison Square Garden Sports Corp.	119	29 663	30 634	
Meta Platforms Inc.	277	189 728	191 115	
NII Holdings Inc.	500	1 424	178	
Ooma Inc.	51	898	693	
Pinterest Inc.	1 900	107 042	114 576	
Roku Inc.	4 435	386 496	363 692	
Shutterstock Inc.	630	36 664	33 362	
Snap Inc.	13 620	240 383	309 558	
Spok Holdings Inc.	461	5 773	9 342	
Telephone and Data Systems Inc.	1 338	36 563	37 953	
Vimeo Inc.	2 758	14 818	14 077	
Vivid Seats Inc.	615	6 366	4 839	
WideOpenWest Inc.	933	6 540	6 907	
		1 180 432	1 187 626	2,83
Services publics (31 décembre 2023 : 1,68 %)				
Avista Corp.	240	11 279	11 366	
Black Hills Corp.	242	17 869	18 007	
California Water Service Group	118	8 343	7 829	
Constellation Energy Corp.	561	142 428	153 736	
IDACORP Inc.	160	20 030	20 394	
National Fuel Gas Co.	291	20 878	21 578	
NRG Energy Inc.	579	34 519	61 686	
Ormat Technologies Inc.	220	19 893	21 584	
Pinnacle West Capital Corp.	1 127	112 154	117 787	
Sunnova Energy International Inc.	10	72	76	
UGI Corp.	948	29 337	29 706	
Vistra Corp.	232	27 722	27 295	
		444 524	491 044	1,17
Immobilier (31 décembre 2023 : 1,60 %)				
Anywhere Real Estate Inc.	2 941	19 477	13 320	
CBRE Group Inc.	760	92 766	92 669	
CoStar Group Inc.	304	37 336	30 841	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Forestar Group Inc.	65	3 019	2 845	
Four Corners Property Trust Inc.	488	15 546	16 473	
Host Hotels & Resorts Inc.	959	26 509	23 594	
JBG SMITH Properties	78	1 571	1 626	
Jones Lang LaSalle Inc.	14	3 828	3 933	
Office Properties Income Trust	1 830	8 473	5 108	
Outfront Media Inc.	1 041	15 996	20 370	
RE/MAX Holdings Inc.	484	10 009	5 364	
Redfin Corp.	573	5 680	4 712	
RMR Group Inc.	157	4 864	4 855	
Service Properties Trust	1 568	14 009	11 028	
Summit Hotel Properties Inc.	611	5 374	5 008	
Universal Health Realty Income Trust	233	12 272	12 479	
Zillow Group Inc.	2 817	174 909	178 816	
		451 638	433 041	1,03
Total des actions américaines – position acheteur		25 482 024	26 004 968	62,05
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -0,98 %)				
Aemetis Inc.	(931)	(5 067)	(3 835)	
Centrus Energy Corp.	(19)	(1 108)	(1 111)	
Core Laboratories Inc.	(216)	(6 386)	(5 997)	
Delek US Holdings Inc.	(2)	(70)	(68)	
Gevo Inc.	(4 456)	(8 684)	(3 397)	
Gulfport Energy Corp.	(59)	(8 073)	(12 191)	
KLX Energy Services Holdings Inc.	(358)	(2 474)	(2 425)	
New Fortress Energy Inc.	(1 970)	(67 965)	(59 250)	
NextDecade Corp.	(855)	(6 346)	(9 289)	
Nine Energy Service Inc.	(242)	(1 819)	(556)	
Ovintiv Inc.	(600)	(39 022)	(38 478)	
Patterson-UTI Energy Inc.	(567)	(8 886)	(8 038)	
RPC Inc.	(1 352)	(12 910)	(11 563)	
TETRA Technologies Inc.	(628)	(4 003)	(2 973)	
Tidewater Inc.	(1)	(117)	(130)	
Vertex Energy Inc.	(2 120)	(9 433)	(2 740)	
		(182 363)	(162 041)	(0,39)
Matières premières (31 décembre 2023 : -1,58 %)				
Albemarle Corp.	(112)	(14 678)	(14 639)	
American Vanguard Corp.	(512)	(8 520)	(6 025)	
AptarGroup Inc.	(138)	(24 625)	(26 589)	
Aspen Aerogels Inc.	(447)	(8 110)	(14 588)	
Carpenter Technology Corp.	(949)	(87 039)	(142 296)	
Century Aluminum Co.	(709)	(14 819)	(16 250)	
Chemours Co.	(1 497)	(53 987)	(46 233)	
Corteva Inc.	(94)	(5 747)	(6 938)	
Danimer Scientific Inc.	(302)	(559)	(249)	
Danimer Scientific Inc., bons de souscription, éch. le 3 mai 2029	(101)	–	–	
Flotek Industries Inc.	(238)	(2 186)	(1 599)	
Kaiser Aluminum Corp.	(68)	(7 547)	(8 179)	
Loop Industries Inc.	(842)	(2 913)	(2 408)	
LSB Industries Inc.	(270)	(3 111)	(3 022)	
Materion Corp.	(167)	(28 364)	(24 709)	
Mosaic Co.	(30)	(1 468)	(1 186)	
MP Materials Corp.	(6)	(128)	(105)	
Pactiv Evergreen Inc.	(60)	(1 104)	(929)	
Piedmont Lithium Inc.	(731)	(23 781)	(9 983)	
PureCycle Technologies Inc.	(2 835)	(21 373)	(22 965)	
Sylvamo Corp.	(155)	(9 864)	(14 550)	
		(319 923)	(363 442)	(0,87)
Industries (31 décembre 2023 : -4,59 %)				
3D Systems Corp.	(633)	(3 647)	(2 659)	
AAR Corp.	(43)	(3 733)	(4 278)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
AerSale Corp.	(132)	(2 327)	(1 250)	
Allegiant Travel Co.	(23)	(2 424)	(1 581)	
Ameresco Inc.	(323)	(17 559)	(12 733)	
Array Technologies Inc.	(74)	(1 506)	(1 039)	
Babcock & Wilcox Enterprises Inc.	(516)	(978)	(1 024)	
Blink Charging Co.	(3 182)	(18 714)	(11 930)	
Bloom Energy Corp.	(2 117)	(40 931)	(35 457)	
BlueLinx Holdings Inc.	(5)	(691)	(637)	
Carlisle Cnos Inc.	(4)	(1 806)	(2 218)	
ChargePoint Holdings Inc.	(5 763)	(12 085)	(11 908)	
Core & Main Inc.	(1)	(69)	(67)	
Crane Co.	(2)	(202)	(397)	
Custom Truck One Source Inc.	(283)	(1 771)	(1 685)	
Delta Air Lines Inc.	(961)	(50 791)	(62 383)	
Desktop Metal Inc.	(53)	(313)	(300)	
Driven Brands Holdings Inc.	(48)	(957)	(836)	
Eos Energy Enterprises Inc.	(7 455)	(11 079)	(12 955)	
Fluence Energy Inc.	(1 368)	(37 113)	(32 459)	
FuelCell Energy Inc.	(32 260)	(49 440)	(28 198)	
Gibraltar Industries Inc.	(63)	(4 874)	(5 909)	
Graco Inc.	(3)	(342)	(325)	
Hayward Holdings Inc.	(2 483)	(41 307)	(41 790)	
Heartland Express Inc.	(60)	(831)	(1 012)	
Herc Holdings Inc.	(6)	(1 280)	(1 094)	
Hub Group Inc.	(793)	(46 737)	(46 713)	
ICF International Inc.	(55)	(8 127)	(11 173)	
ITT Inc.	(43)	(7 277)	(7 601)	
JELD-WEN Holding Inc.	(145)	(2 589)	(2 673)	
Kelly Services Inc.	(51)	(1 105)	(1 494)	
Korn Ferry	(184)	(14 923)	(16 904)	
Landstar System Inc.	(296)	(74 202)	(74 720)	
Lindsay Corp.	(78)	(13 281)	(13 115)	
Mastech Digital Inc.	(100)	(1 822)	(1 026)	
Matson Inc.	(7)	(918)	(1 254)	
MDU Resources Group Inc.	(85)	(2 588)	(2 919)	
Nikola Corp.	(1 924)	(56 863)	(21 562)	
NuScale Power Corp.	(4 501)	(44 364)	(71 998)	
Oshkosh Corp.	(358)	(44 660)	(53 004)	
Owens Corning	(168)	(32 360)	(39 935)	
Plug Power Inc.	(14 037)	(64 332)	(44 753)	
Preformed Line Products Co.	(4)	(716)	(682)	
Shoals Technologies Group Inc.	(1 429)	(34 460)	(12 201)	
Standex International Corp.	(25)	(4 577)	(5 513)	
Stem Inc.	(6 462)	(14 350)	(9 815)	
Sunrun Inc.	(161)	(2 114)	(2 613)	
Symbotic Inc.	(1 556)	(81 901)	(74 861)	
TriNet Group Inc.	(931)	(116 609)	(127 393)	
Viad Corp.	(74)	(2 186)	(3 443)	
Wheels Up Experience Inc.	(1 769)	(5 262)	(4 575)	
Xometry Inc.	(152)	(3 841)	(2 404)	
		(988 934)	(930 468)	(2,22)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -4,55 %)				
1-800-Flowers.com Inc.	(296)	(3 961)	(3 856)	
America's Car-Mart Inc.	(120)	(13 849)	(9 887)	
AMMO Inc.	(1 613)	(8 993)	(3 708)	
BARK Inc.	(1 302)	(2 737)	(3 225)	
Bassett Furniture Industries Inc.	(151)	(3 571)	(2 936)	
Bowlero Corp.	(457)	(7 572)	(9 061)	
Caleres Inc.	(178)	(7 133)	(8 184)	
Camping World Holdings Inc.	(404)	(12 280)	(9 873)	
Canoo Inc.	(1 514)	(3 504)	(4 413)	
Cavco Industries Inc.	(23)	(10 770)	(10 895)	
Citi Trends Inc.	(184)	(5 663)	(5 353)	
Designer Brands Inc.	(474)	(5 618)	(4 430)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Dorman Products Inc.	(76)	(8 846)	(9 513)	
Dutch Bros Inc.	(1 858)	(73 439)	(105 255)	
Escalade Inc.	(297)	(4 696)	(5 604)	
European Wax Center Inc.	(114)	(2 708)	(1 549)	
EVgo Inc.	(4 320)	(16 548)	(14 483)	
Expedia Group Inc.	(505)	(81 881)	(87 061)	
Flexsteel Industries Inc.	(26)	(745)	(1 105)	
Freyr Battery Inc.	(2 106)	(5 339)	(4 899)	
GameStop Corp.	(732)	(13 611)	(24 660)	
Gentherm Inc.	(126)	(8 634)	(8 503)	
G-III Apparel Group Ltd.	(461)	(19 120)	(17 076)	
GrowGeneration Corp.	(542)	(10 136)	(1 595)	
Guess? Inc.	(79)	(2 499)	(2 205)	
Haverty Furniture Cos Inc.	(179)	(6 544)	(6 194)	
Kura Sushi USA Inc.	(33)	(2 675)	(2 849)	
Light & Wonder Inc.	(73)	(8 530)	(10 476)	
Lucid Group Inc.	(7 798)	(74 644)	(27 850)	
Mohawk Industries Inc.	(570)	(79 060)	(88 595)	
Movado Group Inc.	(59)	(2 122)	(2 007)	
National Vision Holdings Inc.	(415)	(12 274)	(7 433)	
ODP Corp.	(91)	(6 011)	(4 890)	
Patrick Industries Inc.	(6)	(794)	(891)	
PetMed Express Inc.	(147)	(827)	(815)	
PLBY Group Inc.	(468)	(686)	(498)	
Purple Innovation Inc.	(517)	(705)	(736)	
RealReal Inc.	(577)	(2 671)	(2 519)	
Rivian Automotive Inc.	(935)	(11 433)	(17 170)	
Solid Power Inc.	(687)	(2 547)	(1 551)	
Sonic Automotive Inc.	(118)	(8 558)	(8 795)	
Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	(318)	(1 617)	(1 049)	
Strattec Security Corp.	(124)	(3 987)	(4 242)	
Tempur Sealy International Inc.	(523)	(29 139)	(33 879)	
Tilly's Inc.	(111)	(1 245)	(916)	
Unifi Inc.	(110)	(1 712)	(887)	
Valvoline Inc.	(868)	(50 213)	(51 310)	
VOXX International Corp.	(91)	(1 449)	(393)	
Vuzix Corp.	(809)	(6 761)	(1 494)	
Weyco Group Inc.	(109)	(3 658)	(4 522)	
XPEL Inc.	(846)	(44 012)	(41 165)	
		(697 727)	(682 455)	(1,63)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -1,31 %)				
Alico Inc.	(151)	(5 839)	(5 354)	
Andersons Inc.	(229)	(16 558)	(15 542)	
B&G Foods Inc.	(757)	(8 202)	(8 370)	
BRC Inc.	(479)	(3 227)	(4 018)	
Calavo Growers Inc.	(170)	(7 149)	(5 280)	
Cal-Maine Foods Inc.	(16)	(1 261)	(1 338)	
Ingredion Inc.	(715)	(103 578)	(112 219)	
Lifecore Biomedical Inc.	(921)	(7 575)	(6 465)	
Limoneira Co.	(50)	(1 117)	(1 424)	
Utz Brands Inc.	(419)	(9 435)	(9 540)	
Veru Inc.	(1 690)	(2 060)	(1 946)	
		(166 001)	(171 496)	(0,41)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -5,69 %)				
10X Genomics Inc.	(259)	(15 949)	(6 893)	
89bio Inc.	(27)	(346)	(296)	
AdaptHealth Corp.	(736)	(11 902)	(10 071)	
Adaptive Biotechnologies Corp.	(97)	(693)	(480)	
Agilon health Inc.	(312)	(3 044)	(2 792)	
Aldeyra Therapeutics Inc.	(248)	(800)	(1 123)	
Allogene Therapeutics Inc.	(1 174)	(8 201)	(3 743)	
Allovir Inc.	(838)	(5 001)	(829)	
American Well Corp.	(164)	(721)	(73)	
Apellis Pharmaceuticals Inc.	(1)	(70)	(52)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Arcus Biosciences Inc.	(152)	(3 846)	(3 168)	
Arcutis Biotherapeutics Inc.	(574)	(7 607)	(7 305)	
ARS Pharmaceuticals Inc.	(22)	(111)	(256)	
Arvinas Inc.	(227)	(8 420)	(8 269)	
Asensus Surgical Inc.	(1 965)	(2 663)	(895)	
Astrana Health Inc.	(55)	(2 301)	(3 053)	
Avid Bioservices Inc.	(361)	(3 933)	(3 527)	
Beam Therapeutics Inc.	(3 431)	(128 559)	(109 999)	
BioLife Solutions Inc.	(680)	(18 665)	(19 940)	
Bio-Techne Corp.	(666)	(66 074)	(65 296)	
Bluebird Bio Inc.	(1 553)	(9 872)	(2 091)	
Bridgebio Pharma Inc.	(510)	(16 952)	(17 677)	
Butterfly Network Inc.	(1 809)	(6 735)	(2 081)	
Certara Inc.	(2 221)	(67 706)	(42 091)	
Citius Pharmaceuticals Inc.	(514)	(499)	(411)	
Codexis Inc.	(320)	(1 342)	(1 357)	
Coherus Biosciences Inc.	(3 124)	(14 911)	(7 395)	
CorMedix Inc.	(284)	(2 244)	(1 683)	
CorVel Corp.	(6)	(1 905)	(2 088)	
Cross Country Healthcare Inc.	(951)	(21 654)	(18 010)	
Cue Biopharma Inc.	(185)	(783)	(314)	
Denali Therapeutics Inc.	(1 768)	(51 186)	(56 175)	
DocGo Inc.	(1 162)	(10 104)	(4 913)	
Doximity Inc.	(935)	(29 994)	(35 785)	
Enzo Biochem Inc.	(2 526)	(8 064)	(3 768)	
Epizyme Inc., droits	(249)	–	(341)	
Fate Therapeutics Inc.	(30)	(97)	(135)	
Fulcrum Therapeutics Inc.	(68)	(719)	(577)	
Fulgent Genetics Inc.	(755)	(34 426)	(20 269)	
GeneDx Holdings Corp.	(78)	(1 052)	(2 790)	
Geron Corp.	(6 489)	(28 069)	(37 648)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(54 070)	(80 967)	(24 734)	
Gossamer Bio Inc.	(1 559)	(1 765)	(1 922)	
Guardant Health Inc.	(17)	(437)	(672)	
Humacyte Inc.	(1 826)	(9 239)	(11 993)	
IGM Biosciences Inc.	(374)	(4 492)	(3 516)	
Inmune Bio Inc.	(274)	(3 522)	(3 307)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(728)	(13 147)	(8 049)	
iRhythm Technologies Inc.	(119)	(17 039)	(17 527)	
Janux Therapeutics Inc.	(134)	(9 000)	(7 681)	
Joint Corp.	(43)	(715)	(827)	
MiNK Therapeutics Inc.	(13)	(38)	(17)	
Neogen Corp.	(1 532)	(37 419)	(32 765)	
NeoGenomics Inc.	(107)	(2 371)	(2 031)	
Ocugen Inc.	(2 796)	(4 103)	(5 930)	
Ocular Therapeutix Inc.	(951)	(6 372)	(8 901)	
Omeros Corp.	(88)	(474)	(489)	
Outlook Therapeutics Inc.	(64)	(691)	(646)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(2 700)	(6 841)	(5 062)	
Phathom Pharmaceuticals Inc.	(491)	(6 798)	(6 920)	
Precision BioSciences Inc.	(82)	(1 408)	(1 092)	
PROCEPT BioRobotics Corp.	(129)	(5 796)	(10 783)	
ProPhase Labs Inc.	(100)	(1 083)	(572)	
Quantum-Si Inc.	(646)	(2 631)	(928)	
QuidelOrtho Corp.	(68)	(4 431)	(3 091)	
Recursion Pharmaceuticals Inc.	(65)	(1 077)	(667)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(1 390)	(42 444)	(40 950)	
Sana Biotechnology Inc.	(851)	(7 896)	(6 358)	
Sangamo Therapeutics Inc.	(1 321)	(2 171)	(648)	
Schrodinger Inc.	(1 315)	(56 536)	(34 800)	
Scilex Holding Co.	(243)	(3 432)	(642)	
Senseonics Holdings Inc.	(2 189)	(1 893)	(1 195)	
Sight Sciences Inc.	(352)	(1 948)	(3 213)	
Simulations Plus Inc.	(239)	(13 995)	(15 900)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Solid Biosciences Inc.	(203)	(2 416)	(1 575)	
SpringWorks Therapeutics Inc.	(584)	(23 989)	(30 103)	
Stereotaxis Inc.	(798)	(2 161)	(1 987)	
Taysha Gene Therapies Inc.	(900)	(2 677)	(2 759)	
Vaxart Inc.	(386)	(380)	(352)	
Verastem Inc.	(22)	(356)	(90)	
Verve Therapeutics Inc.	(1 522)	(21 213)	(10 163)	
Viatris Inc.	(514)	(7 189)	(7 476)	
Vir Biotechnology Inc.	(1 792)	(43 902)	(21 823)	
Voyager Therapeutics Inc.	(47)	(536)	(509)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(1 360)	(3 174)	(1 079)	
XOMA Corp.	(67)	(1 473)	(2 172)	
Zevra Therapeutics Inc.	(438)	(2 799)	(2 937)	
Zimvie Inc.	(24)	(542)	(599)	
Zynex Inc.	(14)	(232)	(179)	
		(1 062 430)	(853 290)	(2,04)
Services financiers (31 décembre 2023 : -5,13 %)				
ACNB Corp.	(50)	(2 204)	(2 481)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(1 990)	(51 049)	(52 772)	
Atlanticus Holdings Corp.	(100)	(3 778)	(3 856)	
Bank First Corp.	(99)	(10 418)	(11 188)	
Bank of Marin Bancorp	(32)	(627)	(709)	
Brighthouse Financial Inc.	(736)	(44 879)	(43 648)	
Cadence Bank	(49)	(1 806)	(1 896)	
Citizens & Northern Corp.	(227)	(6 865)	(5 557)	
City Holding Co.	(185)	(22 893)	(26 897)	
Columbia Financial Inc.	(183)	(4 189)	(3 749)	
Dynex Capital Inc.	(303)	(4 866)	(4 950)	
Ellington Financial Inc.	(1 902)	(30 065)	(31 439)	
Esquire Financial Holdings Inc.	(90)	(4 964)	(5 862)	
Farmers & Merchants Bancorp Inc.	(100)	(3 115)	(3 177)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(2 997)	
First Bancorp Inc.	(150)	(5 698)	(5 101)	
First Financial Northwest Inc.	(167)	(3 336)	(4 828)	
First Foundation Inc.	(1 061)	(12 181)	(9 509)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(200)	(6 122)	(2 463)	
First Northwest Bancorp	(200)	(4 295)	(2 652)	
First Savings Financial Group Inc.	(250)	(6 342)	(6 086)	
First Western Financial Inc.	(300)	(10 379)	(6 979)	
FVCBankcorp Inc.	(73)	(1 155)	(1 091)	
GoHealth Inc.	(20)	(428)	(266)	
Goosehead Insurance Inc.	(189)	(16 002)	(14 855)	
Great Southern Bancorp Inc.	(50)	(4 177)	(3 805)	
Greene County Bancorp Inc.	(100)	(3 180)	(4 613)	
HarborOne Bancorp Inc.	(77)	(1 195)	(1 173)	
Hingham Institution For Savings The	(50)	(16 464)	(12 238)	
Intuitive Machines Inc.	(477)	(2 506)	(2 154)	
Live Oak Bancshares Inc.	(90)	(2 960)	(4 318)	
MBIA Inc.	(116)	(1 177)	(871)	
Metrocity Bankshares Inc.	(50)	(1 126)	(1 806)	
Morningstar Inc.	(8)	(2 743)	(3 239)	
MVB Financial Corp.	(162)	(5 082)	(4 132)	
NBT Bancorp Inc.	(156)	(7 355)	(8 240)	
NCR Atleos Corp.	(348)	(9 731)	(12 866)	
New York Mortgage Trust Inc.	(951)	(8 771)	(7 600)	
Open Lending Corp.	(344)	(3 610)	(2 627)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(1 224)	(37 535)	(38 471)	
PennyMac Financial Services Inc.	(429)	(35 116)	(55 532)	
Provident Financial Holdings Inc.	(18)	(349)	(308)	
ServisFirst Bancshares Inc.	(65)	(4 517)	(5 620)	
Shift4 Payments Inc.	(201)	(18 656)	(20 174)	
Simmons First National Corp.	(5)	(123)	(120)	
Southern First Bancshares Inc.	(100)	(5 607)	(4 001)	
Sterling Bancorp Inc.	(429)	(3 443)	(3 070)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Tompkins Financial Corp.	(119)	(10 491)	(7 963)	
Towne Bank	(9)	(360)	(336)	
Triumph Financial Inc.	(124)	(11 283)	(13 871)	
West BanCorp Inc.	(197)	(5 948)	(4 825)	
Western Alliance Bancorp	(636)	(41 767)	(54 670)	
World Acceptance Corp.	(8)	(1 233)	(1 353)	
		(507 273)	(535 004)	(1,28)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -7,85 %)				
ACM Research Inc.	(120)	(2 241)	(3 786)	
ADTRAN Holdings Inc.	(104)	(835)	(749)	
Amkor Technology Inc.	(1 353)	(53 714)	(74 092)	
Applied Digital Corp.	(2 216)	(15 148)	(18 042)	
Applied Optoelectronics Inc.	(665)	(9 763)	(7 543)	
Aspen Technology Inc.	(65)	(16 233)	(17 667)	
Atomera Inc.	(194)	(1 315)	(1 011)	
Belden Inc.	(312)	(37 423)	(40 045)	
Clearfield Inc.	(81)	(4 518)	(4 274)	
CTS Corp.	(111)	(6 258)	(7 690)	
Digimarc Corp.	(279)	(8 247)	(11 839)	
Digital Turbine Inc.	(719)	(33 859)	(1 633)	
D-Wave Quantum Inc.	(2 659)	(6 532)	(4 293)	
E2open Parent Holdings Inc.	(1 888)	(10 612)	(11 600)	
Edgio Inc.	(306)	(8 318)	(4 572)	
Enphase Energy Inc.	(361)	(64 209)	(49 254)	
Entegris Inc.	(4)	(592)	(741)	
Fair Isaac Corp.	(5)	(5 343)	(10 185)	
First Solar Inc.	(370)	(77 614)	(114 148)	
Forge Global Holdings Inc.	(677)	(2 074)	(1 353)	
IPG Photonics Corp.	(250)	(36 802)	(28 869)	
KLA Corp.	(3)	(2 780)	(3 385)	
Lightwave Logic Inc.	(936)	(4 616)	(3 830)	
Luna Innovations Inc.	(405)	(2 021)	(1 773)	
MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	(221)	(23 486)	(33 709)	
Magic Software Enterprises Ltd.	(26)	(418)	(343)	
MicroStrategy Inc.	(89)	(155 414)	(167 753)	
MicroVision Inc.	(401)	(946)	(582)	
MKS Instruments Inc.	(858)	(115 864)	(153 306)	
Navitas Semiconductor Corp.	(665)	(6 764)	(3 576)	
NextNav Inc.	(495)	(3 552)	(5 493)	
NVIDIA Corp.	(738)	(126 232)	(124 755)	
PAR Technology Corp.	(115)	(5 401)	(7 410)	
Rekor Systems Inc.	(419)	(869)	(889)	
Samsara Inc.	(7)	(255)	(323)	
SiTime Corp.	(221)	(36 308)	(37 613)	
SoundHound AI Inc.	(11 568)	(79 037)	(62 525)	
Synopsys Inc.	(10)	(8 163)	(8 142)	
Tucows Inc., NASD	(10)	(358)	(264)	
Ubiquiti Inc.	(14)	(2 245)	(2 790)	
Universal Display Corp.	(391)	(82 573)	(112 489)	
Upland Software Inc.	(91)	(339)	(310)	
Xerox Holdings Corp.	(800)	(19 057)	(12 720)	
Zebra Technologies Corp.	(104)	(38 879)	(43 963)	
		(1 117 227)	(1 201 329)	(2,87)
Services de communication (31 décembre 2023 : -1,06 %)				
AMC Entertainment Holdings Inc.	(3 451)	(14 335)	(23 516)	
AMC Networks Inc.	(973)	(19 447)	(12 861)	
Anterix Inc.	(105)	(4 846)	(5 688)	
ATN International Inc.	(57)	(3 042)	(1 778)	
Cardlytics Inc.	(124)	(3 599)	(1 393)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(756)	(2 914)	(1 459)	
Emerald Holding Inc.	(172)	(829)	(1 339)	
Entravision Communications Corp.	(218)	(1 361)	(606)	
FuboTV Inc.	(5 651)	(13 417)	(9 588)	
Globalstar Inc.	(769)	(1 299)	(1 179)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Gogo Inc.	(142)	(2 089)	(1 869)	
IAC Inc.	(106)	(7 812)	(6 795)	
iHeartMedia Inc.	(324)	(536)	(483)	
Nexstar Media Group Inc.	(26)	(5 767)	(5 906)	
Paramount Global	(1 164)	(18 796)	(16 549)	
PubMatic Inc.	(184)	(4 051)	(5 114)	
Reading International Inc.	(50)	(262)	(97)	
Rumble Inc.	(737)	(5 747)	(5 597)	
Skillz Inc.	(86)	(718)	(845)	
TechTarget Inc.	(71)	(3 538)	(3 028)	
Ziff Davis Inc.	(420)	(38 217)	(31 637)	
		(152 622)	(137 327)	(0,33)
Services publics (31 décembre 2023 : -0,80 %)				
Cadiz Inc.	(961)	(6 016)	(4 063)	
Energy Vault Holdings Inc.	(380)	(729)	(494)	
Genie Energy Ltd., cat. B	(38)	(823)	(760)	
MGE Energy Inc.	(157)	(16 499)	(16 052)	
Middlesex Water Co.	(55)	(4 771)	(3 933)	
NextEra Energy Inc.	(18)	(1 401)	(1 744)	
NextEra Energy Partners LP	(511)	(18 066)	(19 327)	
SJW Group	(2)	(174)	(148)	
Spruce Power Holding Corp.	(239)	(15 926)	(1 194)	
Unitil Corp.	(105)	(7 212)	(7 441)	
		(71 617)	(55 156)	(0,13)
Immobilier (31 décembre 2023 : -3,17 %)				
Alexandria Real Estate Equities Inc.	(4)	(623)	(640)	
Apartment Investment and Management Co.	(586)	(5 667)	(6 647)	
Douglas Elliman Inc.	(9)	(115)	(14)	
Easterly Government Properties Inc.	(1 174)	(22 012)	(19 872)	
Empire State Realty Trust Inc.	(1 458)	(12 888)	(18 714)	
eXp World Holdings Inc.	(1 130)	(39 939)	(17 449)	
Farmland Partners Inc.	(691)	(11 280)	(10 902)	
FRP Holdings Inc.	(200)	(7 345)	(7 805)	
Gladstone Commercial Corp.	(400)	(6 676)	(7 811)	
Howard Hughes Holdings Inc.	(375)	(37 773)	(33 261)	
Macerich Co.	(2 039)	(42 747)	(43 078)	
Marcus & Millichap Inc.	(268)	(11 837)	(11 559)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(58)	(1 157)	(1 750)	
Newmark Group Inc.	(547)	(5 215)	(7 657)	
Opendoor Technologies Inc.	(3 759)	(13 239)	(9 464)	
Postal Realty Trust Inc.	(267)	(5 603)	(4 870)	
Sabra Health Care REIT Inc.	(1 222)	(24 032)	(25 751)	
Stratus Properties Inc.	(17)	(918)	(587)	
Tejon Ranch Co.	(380)	(9 395)	(8 871)	
Vornado Realty Trust	(858)	(26 467)	(30 866)	
		(284 928)	(267 568)	(0,64)
Total des actions américaines – position vendeur		(5 551 045)	(5 359 576)	(12,81)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 3,37 %)				
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	16 900	3 530	3 940	
Aker Solutions ASA	5 021	16 032	28 521	
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	28 000	1 973	2 429	
Ardmore Shipping Corp.	265	7 874	8 170	
Avance Gas Holding Ltd.	934	18 041	20 477	
Bangchak Corp. PCL	6 500	10 868	9 089	
BP Castrol KK	300	2 832	2 455	
BW Energy Ltd.	682	2 327	2 735	
BW LPG Ltd.	1 280	22 134	32 620	
BW Offshore Ltd.	462	1 945	1 826	
CGG SA	6 115	4 537	4 279	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	138	172	171	
Cosmo Energy Holdings Co., Ltd.	500	34 015	34 451	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
D'Amico International Shipping SA	452	4 247	4 892	
Dayang Enterprise Holdings Bhd	62 700	36 982	47 831	
Dyna-Mac Holdings Ltd.	10 200	3 905	4 274	
Dyna-Mac Holdings Ltd., bons de souscription, éch. le 22 oct. 2024	1 680	–	433	
Elnusa Tbk PT	193 000	6 493	7 161	
FLEX LNG Ltd.	422	15 346	15 912	
Frontline PLC	1 450	51 994	51 110	
Fuji Oil Co., Ltd.	700	2 997	3 061	
Hafnia Ltd.	2 469	25 538	28 462	
Hunting PLC	102	565	730	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	4 700	35 018	41 639	
Inpex Corp.	700	14 070	14 094	
Koninklijke Vopak NV	780	39 244	44 337	
Magnora ASA	202	810	710	
Medco Energi Internasional Tbk PT	114 300	15 333	12 751	
Modec Inc.	2 000	48 923	49 371	
Nabors Industries Ltd	37	4 069	3 603	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	32	–	289	
Nippon Coke & Engineering Co., Ltd.	4 100	4 191	4 290	
Nordic American Tankers Ltd.	3 243	11 637	17 661	
Odfjell Drilling Ltd.	182	1 082	1 359	
Oil Refineries Ltd.	43 019	18 659	13 594	
Petron Malaysia Refining & Marketing Bhd	2 900	3 974	3 802	
Prima Marine PCL	3 700	1 072	1 186	
San-Ai Obbli Co., Ltd.	100	1 379	1 755	
SBM Offshore NV	1 456	30 888	30 534	
Schlumberger NV	2 063	131 164	133 184	
Semirara Mining & Power Corp.	23 300	18 993	18 332	
SFL Corp. Ltd.	2 421	39 225	45 981	
Star Petroleum Refining PCL	21 700	6 645	6 594	
Subsea 7 SA	2 820	58 610	72 771	
Teekay Corp.	316	2 433	3 879	
Terracom Ltd.	9 036	4 078	1 817	
Thai Oil PCL	13 900	30 584	27 469	
TORM PLC	165	8 344	8 826	
Transocean Ltd.	4 259	38 253	31 179	
United Tractors Tbk PT	8 300	19 022	15 241	
Vallourec SACA	1 963	46 646	42 160	
Velesto Energy Bhd	27 000	1 802	2 075	
Viva Energy Group Ltd.	7 442	23 684	21 423	
Wasco Bhd	18 000	5 561	7 153	
		939 740	994 088	2,37
Matières premières (31 décembre 2023 : 4,94 %)				
Aica Kogyo Co., Ltd.	200	5 785	5 951	
Aichi Steel Corp.	600	17 202	18 042	
Air Water Inc.	900	17 256	16 655	
Alkane Resources Ltd.	5 351	3 309	2 445	
Anglo American PLC	2 083	77 529	90 147	
ArcelorMittal SA, NYSE	297	9 693	9 319	
ARE Holdings Inc.	800	13 975	14 284	
Asia Pile Holdings Corp.	300	1 675	2 526	
Aurelia Metals Ltd.	925	729	161	
Barito Pacific Tbk PT	105 115	9 228	8 696	
Bellevue Gold Ltd.	2 791	4 783	4 553	
BHP Group Ltd.	721	56 987	56 324	
Boliden AB	139	6 105	6 090	
Borregaard ASA	582	11 772	14 391	
Breedon Group PLC	980	6 399	6 560	
C Uyemura & Co., Ltd.	100	6 239	9 451	
Carlit Co., Ltd.	100	697	1 231	
Cementir Holding NV	428	5 012	5 850	
Centamin PLC	3 788	7 851	7 922	
China BlueChemical Ltd.	20 000	8 245	7 782	
China Hongqiao Group Ltd.	138 500	211 956	286 917	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	7 998	8 828	9 546	
Chuetsu Pulp & Paper Co., Ltd.	100	1 412	1 302	
CI Takiron Corp.	500	2 734	3 126	
Clariant AG	2 743	49 054	59 061	
CMOC Group Ltd.	21 000	26 699	26 279	
Covestro AG	1 460	105 442	117 334	
Daicel Corp.	300	3 807	3 936	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	500	10 545	14 546	
DRDGOLD Ltd.	6 705	85 012	78 995	
DS Smith PLC	10 122	64 391	73 709	
Elementis PLC	336	812	847	
Elkem ASA	5 622	16 474	14 623	
Emerald Resources NL	4 691	11 602	15 133	
EMS-Chemie Holding AG	5	5 435	5 608	
Eramet SA	85	11 183	11 736	
Evolution Mining Ltd.	14 029	48 951	44 871	
Evonik Industries AG	4 571	124 719	127 702	
Firefinch Ltd.	2 091	2 355	227	
Fresnillo PLC	21 045	205 675	204 578	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	800	4 310	3 756	
Geostr Corp.	100	427	286	
Glencore PLC	27 713	202 715	216 237	
Gold Road Resources Ltd.	7 971	11 994	12 456	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	200	5 351	5 623	
Harima Chemicals Group Inc.	500	4 140	3 964	
Heidelberg Materials AG	140	19 809	19 879	
Hochschild Mining PLC	882	1 846	2 731	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	200	1 746	2 533	
Holcim AG	17	2 057	2 061	
Huhtamaki Oyj	337	17 661	18 514	
IGO Ltd.	8 255	55 259	42 547	
J Resources Asia Pasific Tbk PT	66 100	1 090	856	
Jaya Tiasa Holdings BHD	1 300	487	407	
Jiangxi Copper Co., Ltd.	10 000	27 289	27 306	
Johnson Matthey PLC	256	7 873	6 939	
JSP Corp.	200	3 212	3 933	
Jupiter Mines Ltd.	1 930	423	556	
K+S AG	6 904	143 656	127 321	
Kenmare Resources PLC	423	2 510	2 308	
KGHM Polska Miedz SA	1 654	82 767	84 645	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	500	3 622	4 164	
Konoshima Chemical Co., Ltd.	100	1 703	1 445	
Krakatau Steel Persero Tbk PT	142 700	4 035	1 121	
Kunimine Industries Co., Ltd.	200	2 056	1 912	
Kureha Corp.	300	8 483	7 130	
Kurimoto Ltd.	600	13 011	23 912	
Kuriyama Holdings Corp.	100	878	1 057	
LANXESS AG	1 758	62 228	59 246	
Macmahon Holdings Ltd.	2 589	354	686	
Malayan Cement Bhd	900	1 153	1 300	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	800	3 631	5 628	
Mitsubishi Steel Manufacturing Co., Ltd.	300	3 942	3 846	
MMG Ltd.	167 996	105 086	87 741	
MMG Ltd., droits, éch. le 5 juill. 2024	62 397	–	3 773	
Moriroku Co., Ltd.	100	1 906	2 436	
Nakayama Steel Works Ltd.	1 300	10 555	10 428	
Neturen Co., Ltd.	700	4 937	6 598	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	300	3 103	3 335	
Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	15 000	9 446	8 544	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	500	6 697	8 447	
Nippon Kayaku Co., Ltd.	400	4 580	4 177	
Nippon Steel Corp.	300	8 714	8 679	
NOF Corp.	100	1 841	1 869	
Northern Star Resources Ltd.	8 919	114 353	105 958	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
OCI NV	61	2 289	2 039	
Okamoto Industries Inc.	100	3 912	4 270	
Ora Banda Mining Ltd.	3 289	379	1 007	
Orora Ltd.	7 172	16 266	12 912	
Osaka Steel Co., Ltd.	100	1 310	2 041	
Outokumpu Oyj	7 424	44 654	36 691	
Perenti Ltd.	1 947	1 600	1 779	
Perseus Mining Ltd.	9 915	19 611	21 293	
POSCO Holdings Inc., NYSE	1 340	156 468	120 540	
Ramelius Resources Ltd.	16 320	24 295	28 635	
Red 5 Ltd.	24 132	6 728	7 939	
Regis Resources Ltd.	13 620	24 500	21 844	
Resolute Mining Ltd.	8 365	3 243	3 975	
Resonac Holdings Corp.	300	9 202	8 988	
RHI Magnesita NV	7	416	420	
Riken Technos Corp.	200	1 205	1 808	
Rio Tinto PLC	1 307	120 650	117 911	
Sakata INX Corp.	300	3 658	4 604	
Salzgitter AG	145	7 200	3 838	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	200	8 244	6 780	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	800	3 236	3 192	
Semen Indonesia Persero Tbk PT	5 000	1 475	1 558	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	200	2 948	3 624	
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	100	5 160	5 306	
SIG Group AG	634	17 730	15 881	
Solvay SA	2 626	101 867	126 586	
South32 Ltd.	3 295	9 673	11 021	
Stalprodukt SA	100	9 588	7 454	
Stanmore Resources Ltd.	2 906	9 161	9 401	
STO SE & Co KgaA	24	6 457	5 589	
Stora Enso Oyj	976	17 995	18 257	
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	100	4 267	4 149	
Sumitomo Seika Chemicals Co., Ltd.	100	4 303	4 525	
Synthomer PLC	1 076	4 085	4 793	
Takasago International Corp.	200	5 689	6 695	
Tayca Corp.	100	1 204	1 380	
Ten Sixty Four Ltd.	825	457	215	
Thyssenkrupp AG	18 471	152 542	109 383	
Timah Tbk PT	12 282	970	898	
Toagosei Co., Ltd.	100	1 374	1 288	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	2 700	41 169	37 460	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	300	10 617	12 964	
Topy Industries Ltd.	200	4 022	4 235	
Tosoh Corp.	3 100	57 178	55 324	
Toyo Gosei Co., Ltd.	100	8 071	8 609	
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	300	6 340	6 444	
Tronox Holdings PLC	1 432	34 293	30 744	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	3 000	690	526	
TYK Corp.	300	1 065	1 136	
UBE Corp.	100	2 517	2 409	
Umicore SA	972	24 210	19 999	
Vale Indonesia Tbk PT	2 200	927	776	
Vale Indonesia Tbk PT, droits	133	–	13	
Valqua Ltd.	200	6 316	6 235	
Verallia SA	57	2 858	2 832	
Vertex Corp.	400	5 451	6 788	
Vetropack Holding AG	176	9 986	8 683	
Wacker Chemie AG	411	69 638	61 359	
West African Resources Ltd.	3 903	4 807	5 742	
Westgold Resources Ltd.	17 906	36 251	39 599	
Yamato Kogyo Co., Ltd.	100	6 627	6 657	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	300	4 495	4 675	
Zeon Corp.	1 000	12 635	11 356	
		3 406 667	3 421 820	8,16

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2023 : 9,97 %)				
2020 Bulkers Ltd.	817	16 148	16 316	
Aalberts NV	772	46 568	42 932	
ABB Ltd.	325	24 865	24 705	
AddTech AB	795	9 240	27 057	
Adecco Group AG	1 042	53 736	47 315	
Advan Group Co., Ltd.	200	1 866	1 660	
AFRY AB	230	4 509	5 646	
AG Anadolu Grubu Holding AS	1 223	15 486	18 568	
Aida Engineering Ltd.	500	3 913	3 875	
Ajis Co., Ltd.	100	2 406	2 118	
Alinco Inc.	500	5 323	4 666	
Alstom SA	8 295	185 891	190 989	
Amadeus Fire AG	1	277	156	
AMSC ASA	114	385	485	
Anest Iwata Corp.	300	3 117	4 195	
AP Moller – Maersk A/S	27	60 350	64 273	
AQ Group AB	759	8 734	14 269	
Ashtead Technology Holdings PLC	53	683	697	
Aspo Oyj	259	3 414	2 226	
Aurizon Holdings Ltd.	540	1 892	1 801	
Austal Ltd.	8 866	15 208	20 174	
Babcock International Group PLC	3 895	21 024	35 168	
BAE Systems PLC	5 550	126 398	126 719	
Balfour Beatty PLC	1 603	10 424	10 126	
Bando Chemical Industries Ltd.	500	5 696	8 515	
Beijer Alma AB	198	5 442	5 296	
Beijing Urban Construction Design & Development Group Co., Ltd.	7 000	2 721	1 975	
Belimo Holding AG	5	3 174	3 431	
Benefit Systems SA	18	6 357	17 768	
Bertrandt AG	221	15 689	9 496	
Bet Shemesh Engines Holdings 1997 Ltd.	21	1 387	1 585	
Bilfinger SE	705	45 054	50 765	
Blue Bird Tbk PT	89 000	15 441	11 044	
BOC Aviation Ltd.	200	2 196	1 963	
Bodycote PLC	142	2 193	1 675	
Bravida Holding AB	563	5 253	5 718	
Bunka Shutter Co., Ltd.	200	2 246	2 996	
Burckhardt Compression Holding AG	60	48 670	53 905	
Bureau Veritas SA	993	39 910	37 659	
Burkhalter Holding AG	59	6 900	8 274	
Cargotec Oyj	259	26 027	28 468	
Cebu Air Inc.	800	773	508	
Celebi Hava Servisi AS	15	1 125	1 600	
Central Security Patrols Co., Ltd.	200	4 563	5 368	
Ceres Power Holdings PLC	260	784	797	
Chervon Holdings Ltd.	300	1 257	957	
China Yuchai International Ltd.	510	7 032	6 350	
Chiyoda Corp.	700	2 788	1 798	
Chiyoda Integre Co., Ltd.	200	4 668	5 393	
Cie de Saint-Gobain SA	24	2 595	2 556	
CIMC Vehicles Group Co., Ltd.	1 500	1 728	1 972	
Cimpress PLC	246	24 574	29 491	
CNH Industrial NV	559	8 763	7 748	
Computershare Ltd.	3 592	86 893	86 462	
Cosel Co., Ltd.	300	3 414	3 192	
Costamare Inc.	904	14 406	20 324	
CTS Co., Ltd.	500	3 201	3 445	
D/S Norden A/S	1 461	89 617	87 112	
Daifuku Co., Ltd.	1 300	32 523	33 286	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	400	4 395	5 624	
Dai-Ichi Cutter Kogyo KK	600	7 188	8 166	
Daikin Industries Ltd.	700	136 892	133 202	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	247	6 758	9 654	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Denyo Co., Ltd.	100	1 736	2 484	
Derichebourg SA	1 214	14 865	7 567	
Deutz AG	1 449	11 169	12 814	
DiscoverIE Group PLC	17	351	197	
Dongfang Electric Corp. Ltd., HKG	400	737	872	
Dormakaba Holding AG	7	4 840	4 914	
Duerr AG	65	1 961	1 887	
Eiffage SA	8	1 018	1 006	
Elanders AB	110	2 449	1 416	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	564	915	804	
Emeco Holdings Ltd.	2 305	1 412	1 496	
Eolus Vind AB	360	3 918	3 284	
ERI Holdings Co., Ltd.	300	4 475	6 232	
Eurogroup Laminations SpA	4	32	24	
EVA Precision Industrial Holdings Ltd.	60 000	9 265	7 571	
F&M Co., Ltd.	300	6 175	4 328	
Fagerhult Group AB	50	380	444	
FANUC Corp.	3 400	130 889	127 517	
Ferguson PLC	22	6 022	5 830	
Fila SpA	201	2 353	2 529	
Firstgroup PLC	2 592	7 037	7 097	
Fiverr International Ltd.	1 703	54 610	54 599	
Forbo Holding AG	7	12 389	11 150	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	52	3 802	3 676	
Frencken Group Ltd.	2 800	3 029	4 608	
Fugro NV	2 580	79 476	85 359	
Fujitec Co., Ltd.	600	20 422	21 926	
Fukushima Galilei Co., Ltd.	100	5 194	5 657	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	200	3 686	2 469	
Furukawa Co., Ltd.	100	1 338	1 599	
Gecoss Corp.	500	4 590	4 330	
Genco Shipping & Trading Ltd.	184	5 520	5 365	
Genuit Group PLC	194	1 449	1 448	
Glory Ltd.	400	9 796	9 539	
Golden Ocean Group Ltd., NASD	260	5 309	4 910	
Golden Ocean Group Ltd., OSL	1 334	24 272	25 355	
Greentown Management Holdings Co., Ltd.	5 000	6 208	4 750	
GT Capital Holdings Inc.	80	1 122	1 158	
Hamakyorex Co., Ltd.	200	6 767	7 494	
Harbin Electric Co., Ltd.	2 000	1 275	852	
Heidelberger Druckmaschinen AG	2 695	7 085	5 019	
Hensoldt AG	99	5 451	4 986	
Hino Motors Ltd.	2 700	13 189	9 600	
Hirakawa Hewtech Corp.	300	4 602	3 751	
Hitachi Zosen Corp.	100	975	895	
Hoegh Autoliners ASA	1 570	21 373	25 382	
Hokuetsu Industries Co., Ltd.	200	3 399	4 063	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	400	3 308	3 974	
Horizon Construction Development Ltd.	2 592	862	681	
Huber + Suhner AG	72	7 962	8 387	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	100	1 302	1 472	
IHI Corp.	2 500	76 034	102 184	
Iino Kaiun Kaisha Ltd.	600	6 939	6 533	
IJM Corp. Bhd	14 300	6 863	12 651	
Implenia AG	28	1 531	1 371	
Inaba Seisakusho Co., Ltd.	100	1 460	1 639	
InPost SA	77	1 906	1 859	
International Distributions Services PLC	125	701	693	
Intertek Group PLC	113	9 508	9 370	
Iwaki Co., Ltd.	100	1 282	2 430	
Japan Transcity Corp.	300	2 043	2 761	
JGC Holdings Corp.	4 000	54 262	42 889	
JK Holdings Co., Ltd.	400	4 016	3 488	
Kamei Corp.	400	6 180	8 064	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Kanamoto Co., Ltd.	200	4 580	5 046	
Kardex Holding AG	25	8 568	8 680	
Kato Works Co., Ltd.	700	7 729	7 800	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	600	7 259	14 097	
Keihin Co., Ltd.	100	1 679	1 918	
Kelington Group Bhd	600	442	595	
Keller Group PLC	388	7 890	8 241	
Keppel Ltd.	900	6 222	5 879	
Kier Group PLC	3 035	7 109	6 951	
Kimura Unity Co., Ltd.	100	1 025	1 488	
Kingspan Group PLC	294	36 812	34 277	
Kinki Sharyo Co., Ltd.	100	1 915	1 699	
KION Group AG	505	26 485	28 950	
Kitano Construction Corp.	100	3 135	3 190	
Klaveness Combination Carriers ASA	64	858	903	
Komatsu Ltd.	1 900	73 859	75 494	
Kondotec Inc.	100	1 011	1 196	
Kone Oyj	871	60 687	58 873	
Konecranes Oyj	728	42 153	56 531	
Kongsberg Gruppen ASA	1 838	149 889	205 500	
Koninklijke BAM Groep NV	3 687	14 650	21 207	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	1 700	12 642	11 713	
KRS Corp.	200	1 853	2 868	
Kyodo Printing Co., Ltd.	100	2 839	3 305	
Legrand SA	1 257	174 685	170 776	
Leonardo SpA	1 724	55 907	54 814	
Lindab International AB	518	12 974	15 180	
Lixil Corp.	2 300	34 182	33 133	
Lonking Holdings Ltd.	27 000	9 083	6 909	
Luxfer Holdings PLC	400	4 635	6 344	
Mader Group Ltd.	170	1 126	977	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	300	3 033	3 422	
Maire Tecnimont SpA	3 802	41 013	43 156	
MARUKA FURUSATO Corp.	100	2 784	1 830	
Matsui Construction Co., Ltd.	500	3 565	3 619	
McMillan Shakespeare Ltd.	1 971	33 729	31 557	
Mears Group PLC	304	1 896	1 927	
Meier Tobler Group AG	147	5 916	6 917	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	100	1 080	1 574	
Metso Oyj	2 968	42 155	43 022	
Mirai Industry Co., Ltd.	200	3 831	6 763	
MISUMI Group Inc.	3 000	66 333	70 191	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	1 400	4 440	4 490	
Mitie Group PLC	1 698	1 979	3 413	
Mitsubishi Electric Corp.	600	12 937	13 104	
Mitsubishi Kakoki Kaisha Ltd.	500	13 506	18 246	
Miura Co., Ltd.	300	6 731	8 312	
Miyaji Engineering Group Inc.	200	7 857	8 268	
Mobico Group PLC	361	375	319	
Monadelphous Group Ltd.	2 713	33 323	31 834	
Montana Aerospace AG	206	4 993	5 872	
Morgan Advanced Materials PLC	428	2 070	2 288	
Morgan Sindall Group PLC	85	3 401	3 727	
Mota-Engil SGPS SA	1 254	7 318	6 330	
MPC Container Ships ASA	18 327	39 044	53 017	
Muhibbah Engineering M Bhd	12 000	2 593	3 341	
Multiconsult ASA	51	956	1 032	
Munters Group AB	129	3 670	3 330	
Nabtesco Corp.	1 300	30 719	30 167	
Nachi-Fujikoshi Corp.	100	3 868	2 986	
Nagoya Railroad Co., Ltd.	200	3 055	2 983	
Nakabayashi Co., Ltd.	400	1 944	1 875	
Nakano Corp.	500	1 901	2 246	
Namyong Terminal PCL	15 800	2 770	2 133	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Nexans SA	255	35 671	38 481	
Nice Corp.	300	4 168	5 124	
Nichireki Co., Ltd.	100	1 520	2 116	
Nikkiso Co., Ltd.	1 600	15 271	15 679	
Nilfisk Holding A/S	352	9 488	9 649	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 510	
Nippon Dry-Chemical Co., Ltd.	600	11 378	14 495	
Nippon Sharyo Ltd.	86	1 783	1 865	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	1 600	9 213	5 757	
Nissin Corp.	100	1 840	4 062	
Nitta Corp.	49	1 779	1 709	
Nitto Kogyo Corp.	1 200	37 251	35 727	
Nitto Kohki Co., Ltd.	200	3 380	4 114	
Nitto Seiko Co., Ltd.	900	5 022	4 479	
Nittoc Construction Co., Ltd.	100	1 010	951	
NKT A/S	1 597	173 636	191 416	
Nordex SE	69	1 498	1 158	
Norwegian Air Shuttle ASA	4 532	9 853	7 327	
NRW Holdings Ltd.	1 778	4 277	5 021	
OC Oerlikon Corp. AG	2 386	15 901	17 614	
Ochi Holdings Co., Ltd.	200	2 446	2 515	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	1 100	14 569	14 560	
Okabe Co., Ltd.	100	775	660	
Okada Aiyon Corp.	100	2 817	2 103	
Okamoto Machine Tool Works Ltd.	100	5 754	3 938	
Okamura Corp.	600	11 954	11 509	
Orient Overseas International Ltd.	500	11 781	11 103	
Otokar Otomotiv Ve Savunma Sanayi A.S.	605	11 991	16 641	
Pacific Basin Shipping Ltd.	10 008	4 974	4 315	
Pentair PLC	232	25 049	24 339	
People Dreams & Technologies Group Co., Ltd.	300	4 576	4 634	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	63	2 864	4 726	
Persol Holdings Co., Ltd.	36 500	74 145	69 145	
PKP Cargo SA	3 111	16 268	17 536	
PP Persero Tbk PT	26 800	1 205	649	
Precious Shipping PCL	3 000	1 068	1 096	
Pronexus Inc.	300	3 365	3 366	
Prysmian SpA	865	68 221	73 348	
PS Mitsubishi Construction Co., Ltd.	1 100	8 886	9 366	
Punch Industry Co., Ltd.	300	1 534	1 230	
QinetiQ Group PLC	293	2 223	2 246	
Qinhuangdao Port Co., Ltd., HKG	6 500	1 150	2 221	
Quick Co., Ltd.	300	5 646	5 660	
Randstad NV	203	12 794	12 602	
Reece Ltd.	667	16 217	15 342	
Regional Container Lines PCL	14 700	15 070	15 621	
Rejlers AB	51	1 047	1 015	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	1 887	8 465	7 794	
Renew Holdings PLC	78	1 429	1 433	
Renewi PLC	188	2 247	2 159	
Rexel SA	20	727	709	
Rheinmetall AG	300	227 918	209 289	
Rieter Holding AG	5	968	876	
Rix Corp.	100	2 817	2 577	
ROCKWOOL A/S	202	96 079	112 259	
Rolls-Royce Holdings PLC	12 806	82 260	101 185	
Ryanair Holdings PLC	2 530	443 832	403 105	
Ryobi Ltd.	700	18 817	13 648	
Safe Bulkers Inc.	10 983	70 060	87 466	
Sanko Gosei Ltd.	2 900	17 010	17 811	
Sankyo Tateyama Inc.	500	3 561	3 424	
Sansei Technologies Inc.	200	1 968	3 076	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	1 000	10 467	9 315	
Sanyo Denki Co., Ltd.	100	6 926	6 193	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Sanyo Electric Railway Co., Ltd.	200	4 263	3 634	
Sanyo Trading Co., Ltd.	700	8 085	9 605	
Sato Shoji Corp.	200	2 506	2 916	
Scope Metals Group Ltd.	11	504	429	
Sdiptech AB	256	9 145	10 684	
Securitas AB	968	13 516	13 158	
Seiko Electric Co., Ltd.	400	4 087	4 872	
Senior PLC	264	710	731	
Sensata Technologies Holding PLC	1 616	84 680	82 678	
SG Fleet Group Ltd.	194	357	585	
SGL Carbon SE	1 092	10 755	10 153	
SGS SA	1 100	136 586	134 001	
Shanghai Electric Group Co., Ltd.	2 000	557	536	
Shibusawa Warehouse Co., Ltd.	100	2 289	2 782	
Shibuya Corp.	200	5 036	6 074	
Shimizu Corp.	1 300	9 625	9 991	
Shimojima Co., Ltd.	100	1 068	1 138	
Shinmaywa Industries Ltd.	100	1 171	1 207	
Siemens AG	409	101 882	104 199	
Siemens Energy AG	9 393	238 011	334 874	
SIG PLC	441	358	190	
SIGMAXYZ Holdings Inc.	100	1 450	1 356	
Signify NV	1 060	37 753	36 220	
Sinko Industries Ltd.	200	4 626	7 043	
Sinotruk Hong Kong Ltd.	15 500	46 527	55 146	
Sintokogio Ltd.	400	4 127	3 920	
SITC International Holdings Co., Ltd.	1 000	3 524	3 716	
SKF AB	1 388	37 831	38 164	
SmartGroup Corp. Ltd.	1 050	8 697	8 108	
SMS Co., Ltd.	400	6 737	6 948	
Sodick Co., Ltd.	200	1 503	1 235	
Solar A/S	106	9 429	6 733	
Space Co., Ltd.	300	2 971	2 856	
Speedy Hire PLC	317	380	186	
Stadler Rail AG	414	17 806	16 107	
SThree PLC	45	374	321	
Stolt-Nielsen Ltd.	34	804	2 207	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 737	4 161	
Sulzer AG	76	11 298	14 373	
Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	100	2 444	3 109	
Sunway Construction Group Bhd	3 000	2 517	3 298	
Surya Semesta Internusa Tbk PT	192 600	8 445	17 301	
Svitzer A/S	32	1 261	1 633	
Taisei Corp.	300	14 966	15 187	
Takashima & Co., Ltd.	900	6 787	7 985	
Techtronic Industries Co., Ltd.	5 000	79 150	78 167	
Teikoku Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	7 033	6 433	
Tekken Corp.	200	3 807	4 447	
Teleperformance SE	467	64 880	67 350	
Thoresen Thai Agencies PCL	3 105	928	834	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	54 025	6 054	5 965	
TKH Group NV	120	7 094	7 166	
Tobu Railway Co., Ltd.	4 800	119 417	110 590	
Toenec Corp.	100	3 599	5 095	
Tokyo Energy & Systems Inc.	300	2 745	3 565	
Toli Corp.	1 400	4 496	4 740	
Tonami Holdings Co., Ltd.	100	4 144	5 555	
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	400	6 352	10 803	
Toyo Engineering Corp.	800	5 965	5 968	
Toyota Tsusho Corp.	300	7 956	7 993	
Transurban Group	394	4 527	4 465	
Traton SE	45	2 072	2 016	
Trelleborg AB	385	20 427	20 515	
Tsubaki Nakashima Co., Ltd.	700	5 163	4 680	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Tsugami Corp.	1 000	11 772	13 219	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	400	4 475	5 046	
Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	471	17 445	18 342	
Union Tool Co.	100	3 316	5 385	
Valmet Oyj	1 929	76 279	75 505	
VAT Group AG	91	68 473	70 587	
Veidekke ASA	32	407	470	
Ventia Services Group Pty Ltd.	1 366	3 263	4 781	
Vestas Wind Systems A/S	63	2 017	1 998	
Vesuvius PLC	4 502	37 718	35 938	
Vinci SA	32	4 913	4 617	
Volex PLC	63	416	351	
Volution Group PLC	112	851	874	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 374	10 614	19 229	
Wartsila OYJ Abp	5 364	115 663	141 597	
Webuild SpA	5 769	19 039	17 327	
Webuild SpA, bons de souscription, éch. le 2 août 2030	19	–	57	
Weichai Power Co., Ltd.	43 000	100 985	112 592	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	271	9 736	13 496	
Will Group Inc.	300	3 400	2 526	
World Holdings Co., Ltd.	100	2 065	1 841	
Xinyi Glass Holdings Ltd.	10 000	13 584	15 002	
XP Power Ltd.	65	1 697	1 664	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	300	4 250	5 311	
Yamato Holdings Co., Ltd.	2 900	53 587	43 627	
Yamaura Corp.	600	6 839	6 819	
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	400	719	994	
Yaskawa Electric Corp.	800	40 293	39 313	
Yasuda Logistics Corp.	100	964	1 361	
Yuasa Trading Co., Ltd.	100	3 972	4 823	
Yurtec Corp.	300	2 489	3 815	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	400	2 772	2 566	
Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co., Ltd.	2 600	4 667	4 876	
ZIM Integrated Shipping Services Ltd.	2 736	78 284	83 000	
Zumtobel Group AG	71	649	646	
		6 779 372	7 159 949	17,08
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 6,56 %)				
&Do Holdings Co., Ltd.	500	4 540	4 517	
Accent Group Ltd.	720	1 319	1 273	
Accor SA	1 677	100 723	94 194	
Adairs Ltd.	669	1 362	1 125	
Ahresty Corp.	900	5 709	5 589	
Aisan Industry Co., Ltd.	300	2 855	3 573	
Alpha Corp.	200	2 197	2 423	
Aristocrat Leisure Ltd.	2 248	82 202	102 224	
Asics Corp.	3 200	40 754	66 990	
Astra Otoparts Tbk PT	25 700	6 848	4 070	
Auto1 Group SE	259	2 687	2 311	
Avantia Co., Ltd.	400	3 308	2 902	
B&M European Value Retail SA	3 941	35 324	29 803	
BAIC Motor Corp. Ltd.	15 500	5 857	5 433	
Bayerische Motoren Werke AG	1 195	168 721	154 887	
Bellway PLC	564	26 079	24 740	
Beneteau SACA	177	3 226	2 536	
Bermaz Auto Bhd	34 700	22 234	25 263	
Bijou Brigitte AG	100	4 622	5 353	
Bloomberry Resorts Corp.	58 100	9 515	12 900	
Boozt AB	141	2 031	2 306	
Bridgestone Corp.	200	10 985	10 756	
Cairn Homes PLC, ISE	412	969	961	
Card Factory PLC	5 004	5 377	8 050	
CCC SA	639	27 029	26 753	
CECONOMY AG	1 335	5 551	5 815	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Central Automotive Products Ltd.	300	8 796	13 602	
Cettire Ltd.	4 297	15 145	4 594	
China Dongxiang Group Co., Ltd.	23 039	1 527	1 272	
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	499	527	150	
Clas Ohlson AB	1 523	18 342	34 634	
Continental AG	427	38 580	33 127	
Crystal International Group Ltd.	1 000	279	680	
Currys PLC	5 573	6 819	6 941	
Daido Metal Co., Ltd.	300	1 696	1 592	
Daikyonishikawa Corp.	1 100	6 938	6 578	
Dainichi Co., Ltd.	100	711	599	
DD GROUP Co., Ltd.	600	4 702	6 058	
Delivery Hero SE	1 315	48 378	42 716	
Dongfeng Motor Group Co., Ltd.	24 000	10 104	9 380	
Dor Alon Energy in Israel 1988 Ltd.	31	1 470	795	
Dynam Japan Holdings Co., Ltd.	4 000	5 369	2 454	
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 000	1 554	1 584	
First Juken Co., Ltd.	200	2 112	1 849	
Fleetwood Ltd.	278	461	394	
Forvia SE, PAR	139	2 441	2 254	
Frasers Group PLC	72	1 094	1 099	
F-Tech Inc.	300	2 374	1 654	
Fuji Corp. Ltd.	500	3 228	3 462	
Futaba Industrial Co., Ltd.	600	3 379	4 507	
Gajah Tunggal Tbk PT	135 600	13 232	12 634	
Gakkyusha Co., Ltd.	100	2 051	1 820	
Galaxy Entertainment Group Ltd.	2 000	12 824	12 759	
Geely Automobile Holdings Ltd.	8 000	11 443	12 324	
Giordano International Ltd.	6 000	1 671	1 945	
Global Digital Niaga Tbk PT	156 546	6 197	6 096	
GLOBERIDE Inc.	200	4 961	3 641	
Great Wall Motor Co., Ltd.	31 997	61 890	67 519	
H & M Hennes & Mauritz AB	8 726	167 824	189 021	
Hagihara Industries Inc.	200	2 605	2 668	
Harvia Oyj	8	374	432	
Hermes International SCA	14	45 838	43 937	
Hi-Lex Corp.	400	4 875	5 005	
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd., HKG	5 000	11 483	22 521	
Home Product Center PCL, CAE sans droit de vote	1 700	604	586	
H-One Co., Ltd.	400	2 835	3 471	
Hoteles City Express SAB de CV	9 059	5 433	2 847	
Ichikoh Industries Ltd.	700	3 229	3 239	
IDOM Inc.	300	3 691	3 568	
Iida Group Holdings Co., Ltd.	200	3 749	3 602	
Imasen Electric Industrial	500	3 778	2 646	
Isuzu Motors Ltd.	1 100	19 261	19 940	
JB Hi-Fi Ltd.	797	43 640	44 582	
JD Sports Fashion PLC	17 758	34 867	36 706	
JNBY Design Ltd.	500	1 275	1 334	
JS Global Lifestyle Co., Ltd.	4 500	949	1 215	
JTEKT Corp.	200	2 475	1 905	
Jumbo Interactive Ltd.	638	9 718	10 081	
Kandi Technologies Group Inc.	6 579	27 826	19 715	
Kering SA	436	241 109	216 440	
KeyHolder Inc.	700	6 757	5 073	
Ki-Star Real Estate Co., Ltd.	200	5 764	5 980	
Kogan.com Ltd.	1 271	8 122	4 843	
Koito Manufacturing Co., Ltd.	400	7 984	7 550	
Komatsu Matere Co., Ltd.	400	2 809	2 634	
Konaka Co., Ltd.	500	1 776	1 170	
Lastminute.com NV	249	9 693	7 583	
LPP SA	8	37 820	46 537	
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	5	5 252	5 233	
Man Wah Holdings Ltd.	2 000	2 314	1 879	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Mars Group Holdings Corp.	400	9 942	12 964	
Matsuoka Corp.	200	2 699	3 037	
Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret AS	2 948	10 331	15 627	
Mazda Motor Corp.	3 700	58 257	48 973	
MC Group PCL	7 000	3 622	2 767	
Mikuni Corp.	800	2 834	2 811	
MINISO Group Holding Ltd.	1 407	43 069	36 715	
Mitra Adiperkasa Tbk PT	22 100	3 265	2 724	
Mitsuba Corp.	500	3 750	4 878	
Moonpig Group PLC	137	456	452	
Morito Co., Ltd.	500	5 682	6 354	
MrMax Holdings Ltd.	400	2 627	2 327	
Musashi Seimitsu Industry Co., Ltd.	100	1 538	1 602	
Myer Holdings Ltd.	2 127	1 427	1 604	
Next PLC	307	44 879	47 983	
Nexteer Automotive Group Ltd.	16 000	13 707	9 871	
NHK Spring Co., Ltd.	100	1 508	1 364	
Nichirin Co., Ltd.	100	2 420	3 050	
Nick Scali Ltd.	1 236	15 906	15 599	
Nifco Inc.	100	3 280	3 264	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	200	1 916	2 111	
Nippon Seiki Co., Ltd.	100	832	1 254	
Nissan Motor Co., Ltd.	23 500	120 453	109 126	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	400	1 437	1 722	
OneSpaWorld Holdings Ltd.	347	5 958	7 298	
Onward Holdings Co., Ltd.	1 200	6 469	6 349	
Oriental Land Co., Ltd.	3 500	139 643	133 440	
OVS SpA	1 188	4 207	4 328	
Pacific Industrial Co., Ltd.	200	3 137	2 566	
Panasonic Holdings Corp.	700	8 026	7 842	
Pandora A/S	647	119 586	133 723	
Paris Miki Holdings Inc.	100	323	341	
Pepco Group NV	2 976	22 335	21 232	
Persimmon PLC	1 432	33 583	33 488	
Playtech PLC	1 549	16 744	12 459	
Puma SE	36	2 555	2 263	
PWR Holdings Ltd.	171	1 924	1 716	
QB Net Holdings Co., Ltd.	1 000	9 949	9 561	
Reject Shop Ltd.	14	55	43	
Renault SA	42	2 896	2 947	
SAF-Holland SE	204	4 263	5 535	
San Holdings Inc.	200	2 306	2 011	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	300	1 581	1 894	
Scandic Hotels Group AB	754	4 749	6 255	
Sharp Corp.	2 000	16 843	15 824	
Shikibo Ltd.	200	1 969	1 929	
SISB PCL	10 400	8 983	14 154	
Skyworth Group Ltd.	14 000	6 138	7 557	
SNT Corp.	1 000	2 401	1 999	
Sogefi SpA	1 157	2 226	5 379	
SPK Corp.	200	3 493	4 020	
Sri Trang Agro-Industry PCL	4 400	3 585	3 544	
SSI Group Inc.	28 000	1 951	2 223	
Stella International Holdings Ltd.	6 000	12 962	16 657	
Stellantis NV	3 193	113 259	86 517	
Step Co., Ltd.	200	3 864	3 273	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	1 300	27 374	27 674	
Super Retail Group Ltd.	2 357	28 106	30 048	
Synsam AB	500	2 795	3 405	
Syuppin Co., Ltd.	500	6 022	6 057	
Tachikawa Corp.	200	2 301	2 305	
Taylor Wimpey PLC	14 352	34 763	35 289	
Teknosa Ic Ve Dis Ticaret AS	10 729	17 775	13 855	
Temple & Webster Group Ltd.	3 273	35 341	28 086	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Texwinca Holdings Ltd.	8 011	1 855	1 432	
Tianneng Power International Ltd.	14 000	14 885	13 765	
Toa Corp. /Hyogo	100	855	945	
Tokyo Individualized Educational Institute Inc.	500	2 276	1 786	
Topre Corp.	500	7 574	8 987	
Toyota Motor Corp.	22	5 974	6 170	
TPR Co., Ltd.	300	4 122	6 520	
Trainline PLC	317	1 712	1 724	
Tsukada Global Holdings Inc.	700	2 906	2 894	
USS Co., Ltd.	500	5 523	5 757	
Valeo SE	3 656	71 663	53 284	
Van de Velde NV	21	1 029	949	
Vistry Group PLC	1 239	24 295	25 353	
Volkswagen AG, actions priv.	532	87 430	82 233	
Watches of Switzerland Group PLC	1 949	20 203	13 957	
Whitbread PLC	708	39 920	36 433	
Yamaha Corp.	1 600	53 609	51 256	
Yamaha Motor Co., Ltd.	500	6 572	6 333	
Yokohama Rubber Co., Ltd.	400	13 022	12 103	
Yossix Holdings Co., Ltd.	100	2 281	2 531	
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd.	3 500	7 384	9 263	
		3 061 415	3 018 343	7,20
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : 1,56 %)				
Agthia Group PJSC	3 238	6 388	7 238	
Ajinomoto Co Inc.	300	15 323	14 395	
Albis Co., Ltd.	200	4 856	4 650	
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	9 891	67 996	102 012	
Artnature Inc.	800	6 316	5 689	
Aryzta AG	7 525	11 631	18 334	
Associated British Foods PLC	288	12 615	12 324	
Axial Retailing Inc.	400	3 487	3 488	
Bahvest Resources Bhd	36 600	5 850	6 157	
BIM Birlesik Magazalar AS	90	2 062	2 047	
Carlsberg AS	52	8 747	8 545	
Carrefour SA	6 132	142 228	118 705	
Charoen Pokphand Foods PCL	4 400	3 714	3 757	
Coca-Cola Femsa SAB de CV, NYSE	12	1 480	1 410	
Colruyt Group N.V	13	827	850	
Cranswick PLC	353	25 496	27 141	
DingDong Cayman Ltd.	269	779	732	
Eco's Co., Ltd.	200	3 844	3 984	
EIS Eczacibasi Ilac ve Sinai ve Finansal Yatirimlar Sanayi	237	531	508	
Eurocash SA	3 346	14 838	14 874	
Grupo Herdez SAB de CV	500	1 849	1 979	
Haad Thip PCL	600	380	360	
Halows Co., Ltd.	200	6 405	7 605	
Herbalife Ltd.	3 329	50 414	47 329	
Inghams Group Ltd.	1 756	5 471	5 809	
Kenko Mayonnaise Co., Ltd.	100	1 343	1 715	
Kerevitas Gida Sanayi ve Ticaret AS	838	524	624	
Lacto Japan Co., Ltd.	100	1 843	2 365	
Marks & Spencer Group PLC	1 833	9 641	9 084	
McBride PLC	1 056	1 804	2 530	
Medical System Network Co., Ltd.	200	816	1 007	
Mitsui DM Sugar Holdings Co., Ltd.	300	6 264	8 651	
Mowi ASA	2 180	53 443	49 784	
Nisshin Seifun Group Inc.	200	3 302	3 147	
NSL Foods PCL	400	454	451	
Ontex Group NV	2 484	26 188	29 544	
Rémy Cointreau SA	76	10 384	8 682	
Salmar ASA	262	22 739	18 923	
Sappe PCL	1 500	2 252	5 677	
Shinnihonseiyaku Co., Ltd.	200	2 995	2 930	
Transaction Co., Ltd.	300	4 381	4 933	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	88	164	85	
		552 064	570 054	1,36
Soins de santé (31 décembre 2023 : 6,22 %)				
3Sbio Inc.	1 500	1 450	1 693	
AddLife AB	337	4 762	5 469	
Alcon Inc., NYSE	947	109 920	115 432	
ALK-Abello A/S	906	25 352	27 277	
Alkermes PLC	2 112	74 264	69 648	
Alphamab Oncology	4 000	1 961	1 683	
Ambea AB	1 211	6 973	12 267	
Ambu A/S	714	14 855	18 815	
Ansell Ltd.	820	18 973	19 895	
Arjo AB	637	3 613	3 376	
Asahi Intecc Co., Ltd.	2 400	47 423	46 047	
Ascom Holding AG	152	2 452	1 771	
Attendo AB	310	1 139	1 754	
Basilea Pharmaceutica AG	23	1 384	1 368	
Bavarian Nordic A/S	79	2 422	2 681	
Bayer AG	6 514	284 218	252 008	
BeiGene Ltd.	255	56 740	49 782	
BioGaia AB	72	1 066	1 151	
Biotage AB	218	4 192	4 594	
BoneSupport Holding AB	399	9 163	13 559	
Camurus AB	190	11 590	14 730	
Carl Zeiss Meditec AG	378	49 614	36 393	
China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	8 000	10 261	10 782	
Compugen Ltd.	483	1 617	1 110	
Consun Pharmaceutical Group Ltd.	6 000	4 243	5 847	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	310	6 099	5 881	
Eisai Co., Ltd.	1 100	74 651	61 682	
Elekta AB	3 953	38 775	33 812	
Eurofins Scientific SE	530	41 408	36 182	
FALCO Holdings Co., Ltd.	200	4 075	3 925	
FINDEX Inc.	300	2 407	2 595	
Frontage Holdings Corp.	6 000	1 829	841	
H Lundbeck A/S, cat. B	5 416	32 791	41 389	
Hartalega Holdings Bhd	3 100	2 934	2 949	
Hoya Corp.	600	93 781	95 468	
Humana AB	303	1 155	1 288	
HUTCHMED China Ltd., NASD	95	1 990	2 225	
Innovent Biologics Inc.	9 000	66 481	58 047	
Ion Beam Applications	105	2 756	1 845	
Japan Medical Dynamic Marketing Inc.	100	1 037	582	
Jeol Ltd.	100	5 933	6 182	
JMS Co., Ltd.	400	1 979	1 837	
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	700	22 655	22 925	
Kiniksa Pharmaceuticals International PLC	748	16 227	19 109	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	400	2 661	2 385	
Koninklijke Philips NV	5 669	141 883	196 122	
Koninklijke Philips NV, NYSE	5 648	199 992	194 756	
Kossan Rubber Industries Bhd	14 300	9 289	9 747	
Kyowa Kirin Co., Ltd.	3 800	87 091	88 811	
Linical Co., Ltd.	400	2 737	1 450	
LivaNova PLC	390	23 240	29 255	
M3 Inc.	2 100	29 819	27 394	
Mayne Pharma Group Ltd.	438	2 582	1 885	
Menicon Co., Ltd.	600	13 945	6 742	
Metall Zug AG	7	18 014	13 164	
Mettler-Toledo International Inc.	58	105 851	110 918	
MLP Saglik Hizmetleri AS	519	4 807	7 582	
Modern Dental Group Ltd.	4 000	1 008	3 015	
MoonLake Immunotherapeutics	65	4 542	3 911	
Nipro Corp.	700	7 262	7 512	
Novo Nordisk A/S	1 037	120 661	205 070	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Novo Nordisk A/S, CAAÉ	425	83 307	83 010	
Novocure Ltd.	2 074	70 843	48 614	
Orpea SA	190	3 157	3 200	
Oxford Biomedica PLC	680	3 649	3 487	
PeptiDream Inc.	100	2 109	2 119	
Pharming Group NV	44 993	60 994	49 653	
Prothena Corp. PLC	207	11 302	5 846	
PureTech Health PLC	408	1 484	1 291	
RaySearch Laboratories AB	77	764	1 407	
Rion Co., Ltd.	100	1 998	2 492	
Riverstone Holdings Ltd.	1 100	971	1 077	
Seed Co., Ltd.	500	2 714	2 373	
Siegfried Holding AG	17	20 794	24 152	
Sino Biopharmaceutical Ltd.	8 991	4 273	4 207	
Software Service Inc.	100	9 041	12 079	
Sonic Healthcare Ltd.	1 086	23 987	26 101	
Sonova Holding AG	229	87 791	96 801	
Sri Trang Gloves Thailand PCL	900	376	339	
St-Care Holding Corp.	200	1 549	1 487	
StemRIM Inc.	200	2 032	696	
Supermax Corp. Bhd	1 900	556	482	
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	2 100	77 125	74 527	
Telix Pharmaceuticals Ltd.	1 999	20 441	34 070	
Tokai Corp.	100	1 933	1 967	
Top Glove Corp. Bhd	3 300	879	1 053	
Vital KSK Holdings Inc.	200	1 821	2 315	
WaVe Life Sciences Ltd.	1 635	14 010	11 164	
Zai Lab Ltd.	1 562	40 885	37 040	
		2 494 779	2 560 664	6,11
Services financiers (31 décembre 2023 : 7,65 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	2 464	2 207	1 947	
ABN AMRO Bank NV	9 170	209 621	206 429	
Abrdn PLC	11 864	30 465	30 413	
AEON Credit Service M Bhd	2 000	3 258	4 333	
AIA Group Ltd.	16 200	162 482	150 480	
Aizawa Securities Group Co., Ltd.	300	2 270	6 798	
AJ Bell PLC	135	926	886	
Akita Bank Ltd.	400	7 084	9 075	
Aksigorta AS	17 865	5 208	5 988	
Aktia Bank Oyj	39	548	530	
Albaraka Turk Katilim Bankasi AS	78 252	15 501	18 029	
Alior Bank SA	4 384	128 543	152 729	
Allfunds Group PLC	501	4 187	3 850	
Alliance International Education Leasing Holdings Ltd.	18 000	3 402	1 341	
Anadolu Anonim Turk Sigorta Sirketi	8 090	23 331	36 130	
Anadolu Hayat Emeklilik AS	5 745	14 442	30 309	
Ashmore Group PLC	691	2 172	2 033	
Avanza Bank Holding AB	922	25 882	30 676	
B2 Impact ASA	5 091	5 313	5 398	
Banca Generali SpA	524	24 968	28 787	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	26 846	126 427	172 640	
Banco BPM SpA	5 541	36 268	48 870	
Bancolombia SA	68	3 068	3 038	
Bangkok Bank PCL	300	1 579	1 460	
Bank Hapoalim BM	3 337	41 426	40 375	
Bank Leumi Le-Israel BM	10 780	114 499	120 208	
Bank Millennium SA	5 932	16 926	18 940	
Bank of Cyprus Holdings PLC	248	1 377	1 437	
Bank of Georgia Group PLC	79	4 578	5 514	
Bank of Iwate Ltd.	400	9 245	9 752	
Bank of Nagoya Ltd.	100	3 202	6 592	
Bank of Saga Ltd.	500	8 435	11 599	
Bank of the Ryukyus Ltd.	200	1 902	2 190	
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	14 300	1 685	1 512	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Banque Cantonale Vaudoise	130	17 265	18 875	
Beazley PLC	788	8 930	9 650	
Berner Kantonalbank AG	45	13 690	15 966	
BNP Paribas SA	622	55 403	54 302	
BPER Banca	5 024	32 631	34 784	
CaixaBank SA	721	5 162	5 227	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	1 100	5 604	9 507	
China Life Insurance Co., Ltd. -HKG	30 000	56 747	58 047	
Close Brothers Group PLC	2 796	18 048	20 486	
CMC Markets PLC	514	2 854	2 907	
Commercial International Bank – Egypt (CIB)	17 941	37 954	36 481	
Credito Emiliano SpA	2 779	25 611	37 902	
Dah Sing Banking Group Ltd.	4 800	4 354	5 477	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 400	7 862	9 149	
Daishi Hokuetsu Financial Group Inc.	100	3 456	4 364	
Deutsche Pfandbriefbank AG	831	4 828	6 160	
DoValue SpA	2 603	7 800	7 558	
EFG International AG	48	845	966	
Ehime Bank Ltd.	100	890	1 118	
Electreon Wireless Ltd.	13	1 081	713	
Entrust Inc.	200	1 677	1 429	
EQT Holdings Ltd.	174	4 249	5 088	
Erste Group Bank AG	166	10 512	10 770	
Far East Horizon Ltd.	14 000	13 519	12 465	
FIBI Holdings Ltd.	34	2 037	1 834	
FIDEA Holdings Co., Ltd.	900	12 173	12 686	
FinecoBank Banca Fineco SpA	164	3 389	3 348	
First Bank of Toyama Ltd.	600	4 885	6 492	
First International Bank Of Israel Ltd.	63	3 585	3 268	
FlatexDEGIRO AG	489	8 869	9 502	
Fukui Bank Ltd.	100	1 430	1 966	
Funding Circle Holdings PLC	708	795	1 178	
Gentera SAB de CV	23 300	34 151	39 545	
Georgia Capital PLC	1 350	28 790	22 884	
GMO Financial Holdings Inc.	500	3 393	3 335	
Haitong UniTrust International Leasing Co., Ltd.	10 000	1 419	1 244	
Hargreaves Lansdown PLC	512	9 388	10 025	
Helia Group Ltd.	1 682	4 581	5 949	
Hi Sun Technology China Ltd.	6 000	1 374	457	
Hiscox Ltd.	1 266	26 871	25 183	
Hoist Finance AB	676	2 494	4 699	
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	200	9 481	8 770	
HS Holdings Co., Ltd.	300	2 766	2 529	
HUB24 Ltd.	479	14 908	20 377	
Hyakugo Bank Ltd.	400	1 529	2 355	
Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	700	4 519	5 145	
IDI Insurance Co., Ltd.	98	3 751	3 465	
iFAST Corp. Ltd.	1 800	13 898	13 085	
IG Group Holdings PLC	2 055	25 952	29 112	
Impax Asset Management Group PLC	6	123	39	
ING Bank Slaski SA	21	2 476	2 173	
International Personal Finance PLC	606	1 415	1 331	
Intesa Sanpaolo SpA	71 191	319 774	362 386	
Invesco Ltd.	7 075	135 875	144 828	
Investec PLC	41	309	407	
Israel Discount Bank Ltd.	6 094	40 392	41 592	
ISX Financial EU Ltd.	45	–	–	
IwaiCosmo Holdings Inc.	200	4 109	3 845	
Jaccs Co., Ltd.	100	5 051	3 960	
James River Group Holdings Ltd.	1 071	14 629	11 328	
J-Lease Co., Ltd.	200	2 130	2 297	
Jupiter Fund Management PLC	275	398	366	
Just Group PLC	394	681	718	
KBC Group NV	1 749	175 673	169 031	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Keiyo Bank Ltd.	1 400	7 592	10 456	
Kita-Nippon Bank Ltd.	200	3 836	4 789	
KRUK SA	119	18 386	18 738	
Kyokuto Securities Co., Ltd.	700	9 253	8 753	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	400	2 574	3 688	
Matsui Securities Co., Ltd.	1 100	7 705	7 860	
mBank SA	159	33 682	34 475	
Menora Mivtachim Holdings Ltd.	126	4 312	4 142	
Mito Securities Co., Ltd.	800	3 741	3 940	
Miyazaki Bank Ltd.	300	7 204	9 059	
Musashino Bank Ltd.	100	2 461	2 786	
MyState Ltd.	1 739	5 160	5 944	
Navigator Global Investments Ltd.	1 524	1 707	2 827	
Netwealth Group Ltd.	748	8 487	15 155	
Nib holdings Ltd.	1 549	10 698	10 404	
Ninety One PLC	622	2 181	1 801	
NN Group NV	819	52 545	52 187	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	300	5 491	5 839	
Okinawa Financial Group Inc.	300	6 368	6 740	
Oma Saastopankki Oyj	99	2 513	2 079	
Pacific Current Group Ltd.	100	723	1 013	
PayPoint PLC	42	470	462	
Ping An Insurance Group Co of China Ltd.	2 500	16 653	15 511	
Platinum Asset Management Ltd.	569	544	541	
Plus500 Ltd.	16	620	627	
Polar Capital Holdings PLC	473	3 709	4 598	
Protector Forsikring ASA	900	19 607	29 667	
Raiffeisen Bank International AG	1 679	32 114	39 939	
Regional SAB de CV	900	9 094	9 194	
San ju San Financial Group Inc.	100	1 579	1 825	
Santander Bank Polska SA	172	24 948	31 685	
SBI Global Asset Management Co., Ltd.	500	2 579	2 837	
SBI Insurance Group Co., Ltd.	100	971	891	
Schroders PLC	1 280	8 512	8 055	
Sekerbank Turk AS	108 138	17 534	20 762	
Seven Bank Ltd.	17 400	46 577	39 815	
Shizuoka Financial Group Inc.	300	3 783	3 940	
Société Générale SA	1 327	48 142	42 658	
Spar Nord Bank A/S	610	12 630	16 074	
SpareBank 1 Nord Norge	53	689	675	
SpareBank 1 SMN	953	16 310	18 508	
Sparebanken Vest	894	10 565	14 419	
Sparx Group Co., Ltd.	300	4 147	4 359	
St Galler Kantonalbank AG	1	738	659	
Standard Chartered PLC	1 352	17 751	16 744	
Swiss Re AG	10	1 719	1 698	
Syarikat Takaful Malaysia Keluarga Bhd	3 500	3 755	3 787	
Sydbank AS	689	43 358	49 997	
Tamburi Investment Partners SpA	770	9 709	10 570	
TBC Bank Group PLC	324	9 231	14 403	
Thurgauer Kantonalbank	57	9 107	10 546	
Tochigi Bank Ltd.	600	1 801	1 888	
TOMONY Holdings Inc.	3 100	11 252	11 128	
Towa Bank Ltd.	700	3 962	4 228	
Traders Holdings Co., Ltd.	200	1 035	1 324	
Turkiye Garanti Bankasi AS	8 968	28 632	42 073	
Turkiye Sigorta AS	15 783	35 777	51 548	
UBS Group AG	378	14 231	15 225	
Unipol Gruppo SpA	4 940	53 664	67 231	
Van Lanschot Kempen NV	504	28 371	27 717	
Vanquis Banking Group PLC	700	649	607	
Vaudoise Assurances Holding SA	4	2 320	2 777	
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	49	1 789	2 192	
Vontobel Holding AG	50	4 072	4 096	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
VZ Holding AG	23	2 469	4 035	
Warsaw Stock Exchange	315	4 635	5 200	
Worldline SA	348	5 190	5 165	
Wuestenrot & Wuerttembergische AG	148	3 387	2 856	
XPS Pensions Group PLC	75	379	388	
XTB SA	1 601	31 258	39 040	
Yamagata Bank Ltd.	200	2 246	2 065	
Yamanashi Chuo Bank Ltd.	200	2 902	3 576	
		3 126 647	3 444 893	8,23
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 8,04 %)				
A&D HOLON Holdings Co., Ltd.	400	5 071	10 048	
AAC Technologies Holdings Inc.	7 500	30 654	40 354	
Advantest Corp.	800	38 257	43 723	
Ai Holdings Corp.	300	6 366	6 063	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	100	1 518	1 947	
Alpha & Omega Semiconductor Ltd.	471	17 989	24 085	
Alphawave IP Group PLC	730	1 753	1 818	
Ambarella Inc.	793	69 010	58 541	
Ams-OSRAM AG	11 788	24 624	22 339	
AOI Electronics Co., Ltd.	200	3 904	4 313	
Arisawa Manufacturing Co., Ltd.	100	1 336	1 384	
ASML Holding NV	36	51 915	50 905	
ASML Holding NV, NASD	71	101 186	99 361	
ASMPT Ltd.	2 400	41 630	45 807	
Atled Corp.	200	2 999	2 790	
Atoss Software SE	22	2 557	3 614	
Audinate Group Ltd.	248	3 764	3 588	
AudioCodes Ltd.	42	778	594	
Axell Corp.	100	1 739	1 258	
Azbil Corp.	1 300	49 292	49 553	
Barco NV	386	8 715	5 865	
Bechtle AG	397	25 453	25 582	
Bouvet ASA	1 143	8 890	9 254	
Bravura Solutions Ltd.	3 460	3 874	3 415	
Broadleaf Co., Ltd.	500	2 161	2 475	
Brother Industries Ltd.	200	4 876	4 816	
Business Engineering Corp.	100	2 936	3 215	
CAC Holdings Corp.	200	3 196	3 185	
Cal-Comp Electronics Thailand PCL, CAE sans droit de vote	16 900	2 514	2 470	
Camtek Ltd.	372	25 143	63 236	
Capgemini SE	38	10 457	10 349	
Cellebrite DI Ltd.	4 710	64 097	77 017	
China Electronics Huada Technology Co., Ltd.	14 000	3 633	3 092	
CMK Corp.	300	1 389	1 524	
Codan Ltd.	1 102	9 568	12 115	
Cognyte Software Ltd.	2 162	19 503	22 602	
Computer Engineering & Consulting Ltd.	300	3 981	5 464	
Computer Institute of Japan Ltd.	450	1 652	1 761	
Cresco Ltd.	400	3 581	4 536	
CyberArk Software Ltd.	428	123 604	160 129	
Daitron Co., Ltd.	100	2 743	2 468	
Dustin Group AB	1 627	2 281	2 476	
Ebase Co., Ltd.	100	672	615	
Econocom Group SA	98	350	305	
ESPEC Corp.	1 200	28 027	32 512	
FIT Hon Teng Ltd.	103 000	29 990	62 641	
Forval Corp.	200	2 421	2 634	
Fukui Computer Holdings Inc.	100	2 712	2 148	
GL Sciences Inc.	100	1 898	2 470	
Hagiwara Electric Holdings Co., Ltd.	200	7 576	6 686	
Hansen Technologies Ltd.	337	1 300	1 398	
Hioki EE Corp.	100	5 891	5 776	
Hochiki Corp.	200	3 178	3 813	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	200	2 857	2 406	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Hua Hong Semiconductor Ltd.	2 000	8 266	7 729	
Ibiden Co., Ltd.	1 400	71 750	77 980	
Ichor Holdings Ltd.	119	6 217	6 277	
Icom Inc.	100	2 960	2 603	
Indeks Bilgisayar Sistemleri Muhendislik Sanayi ve Ticaret	22 095	8 446	7 645	
I-Net Corp.	100	1 306	1 827	
Inficon Holding AG	10	19 545	20 801	
Infomedia Ltd.	2 932	3 878	4 501	
Innotech Corp.	300	4 326	4 517	
Inspur Digital Enterprise Technology Ltd.	1 998	1 247	1 103	
Intelligent Wave Inc.	200	1 440	1 837	
IQE PLC	4 480	2 260	2 418	
Ituran Location and Control Ltd.	13	467	438	
Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	400	8 741	8 813	
Japan Electronic Materials Corp.	2 000	44 976	61 246	
Japan Material Co., Ltd.	200	4 261	3 767	
Jfrog Ltd.	195	9 970	10 019	
Kaga Electronics Co., Ltd.	100	3 495	4 908	
Kingboard Holdings Ltd.	15 500	53 212	49 931	
Konica Minolta Inc.	3 500	14 051	13 255	
Kyocera Corp.	900	15 715	14 175	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	1 383	1 842	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	500	2 295	1 956	
LAC Co., Ltd.	900	6 138	6 362	
Lagercrantz Group AB	599	5 973	13 328	
Landis+Gyr Group AG	250	26 589	27 638	
LEM Holding SA	4	9 859	8 710	
Lenovo Group Ltd.	48 000	93 790	92 707	
LG Display Co., Ltd., CAAÉ	2 218	16 206	12 504	
LINK Mobility Group Holding ASA	5 247	7 192	13 857	
Logitech International SA	696	85 219	92 120	
Macnica Holdings Inc.	400	27 783	22 967	
Macquarie Technology Group Ltd.	73	3 990	6 309	
Malaysian Pacific Industries Bhd	1 000	11 478	11 434	
Mi Technovation Bhd	5 600	4 344	4 207	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	800	5 722	13 114	
Mitsui High-Tec Inc.	600	39 040	32 078	
Mycronic AB	120	5 045	6 335	
Nagano Keiki Co., Ltd.	200	4 164	5 019	
NCC Group PLC	98	493	259	
Nemetschek SE	19	2 530	2 559	
NEOJAPAN Inc.	600	5 553	8 595	
NET One Systems Co., Ltd.	500	11 706	12 538	
NEXTDC Ltd.	351	5 627	5 655	
Nihon Denkei Co., Ltd.	100	1 962	1 723	
Nippon Ceramic Co., Ltd.	100	2 759	2 169	
Nippon Chemi-Con Corp.	300	3 672	4 172	
Nokia Oyj	13 740	69 867	71 704	
Nova Ltd.	517	65 622	166 004	
NSW Inc.	100	2 220	2 824	
Nuix Ltd.	1 099	2 291	3 093	
NXP Semiconductors NV	452	162 163	166 430	
Omron Corp.	700	32 625	32 922	
Optorun Co., Ltd.	400	8 027	6 873	
Osaki Electric Co., Ltd.	100	548	599	
PAX Global Technology Ltd.	4 000	2 226	4 108	
Proact IT Group AB	444	4 948	8 892	
Pro-Ship Inc.	100	1 328	1 183	
Q Technology Group Co., Ltd.	1 000	715	722	
QT Group Oyj	7	883	796	
Radware Ltd.	1 018	29 455	25 408	
Restar Corp.	300	7 289	8 153	
Riskified Ltd.	640	4 772	5 596	
RPMGlobal Holdings Ltd.	1 698	2 162	4 453	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
RYODEN Corp.	100	2 004	2 352	
Sanken Electric Co., Ltd.	100	6 035	5 858	
Seagate Technology Holdings PLC	990	104 154	139 896	
Shibaura Mechatronics Corp.	100	6 804	7 213	
Shindengen Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	7 742	7 556	
Siix Corp.	300	4 112	3 277	
Siltronic AG	206	24 164	21 872	
SimilarWeb Ltd.	403	4 585	4 285	
Smart Eye AB	34	394	454	
Soliton Systems KK	300	3 296	3 113	
Sopra Steria Group SACA	14	4 289	3 718	
Southern Cross Payments Ltd.	1 850	1 362	–	
Spectris PLC	81	3 925	3 895	
STMicroelectronics NV	2 069	118 232	111 858	
Stratasys Ltd.	131	1 984	1 504	
SUESS MicroTec SE	78	5 071	7 035	
Sumida Corp.	200	2 247	1 956	
Sun Corp.	100	2 145	3 973	
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	4 200	40 910	35 517	
Sun-Wa Technos Corp.	100	2 071	1 944	
Suzuden Corp.	300	6 853	5 053	
Suzuki Co., Ltd.	700	7 184	8 426	
System Research Co., Ltd.	400	4 643	5 672	
System Support Inc.	300	5 140	4 838	
Tachibana Eletech Co., Ltd.	100	2 428	2 603	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	33	7 774	7 848	
Taiyo Yuden Co., Ltd.	2 300	70 795	79 942	
TAKEBISHI Corp.	100	1 756	1 937	
Technology One Ltd.	2 099	29 164	35 678	
Technoprobe SpA	51	700	688	
Tecnos Japan Inc.	400	2 394	2 389	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	100	1 546	1 791	
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	8 165	64 944	69 418	
Temenos AG	178	16 852	16 805	
Text SA	88	2 327	2 294	
TIS Inc.	100	2 609	2 652	
Tokyo Electron Ltd.	1 300	356 612	385 937	
Tomen Devices Corp.	100	5 476	6 422	
TomTom NV	1 040	11 023	8 045	
Tongda Group Holdings Ltd.	50 000	4 257	762	
Topcon Corp.	700	10 647	10 697	
Trend Micro Inc.	200	11 015	11 111	
Truly International Holdings Ltd.	28 000	4 112	4 417	
Trustpilot Group PLC	1 000	3 352	3 719	
Uchi Technologies Bhd	22 800	22 413	26 321	
Unisem M Bhd	3 800	3 316	4 585	
V Technology Co., Ltd.	100	2 245	2 599	
Vista Group International Ltd.	565	708	1 065	
VS Industry Bhd	4 100	1 509	1 510	
Vtech Holdings Ltd.	300	2 798	3 071	
VusionGroup	72	14 855	13 758	
Wacom Co., Ltd.	400	2 455	2 569	
Wasion Holdings Ltd.	18 000	10 439	21 578	
WILLs Inc.	100	610	533	
Wix.com Ltd.	1 247	218 401	271 425	
X-Fab Silicon Foundries SE	589	5 702	5 165	
Xinyi Solar Holdings Ltd.	7 999	7 614	5 510	
Yashima Denki Co., Ltd.	200	2 548	3 047	
Yokowo Co., Ltd.	300	6 254	5 351	
		3 232 639	3 662 749	8,74
Services de communication (31 décembre 2023 : 1,65 %)				
4imprint Group PLC	8	716	811	
Alma Media Oyj	100	926	1 511	
Amuse Inc.	400	6 958	5 550	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
APG SGA SA	29	7 232	8 677	
Asahi Net Inc.	500	2 976	2 841	
Aussie Broadband Ltd.	5 689	20 230	17 988	
Auto Trader Group PLC	1 004	12 959	13 914	
Avex Inc.	200	2 817	2 321	
BT Group PLC	49 056	99 441	119 091	
Cairo Communication SpA	2 024	4 384	6 174	
Daiichikosho Co., Ltd.	100	1 644	1 409	
Frontier Developments PLC	228	1 166	952	
G5 Entertainment AB	11	315	163	
Hemnet Group AB	116	4 505	4 799	
Homeland Interactive Technology Ltd.	2 000	515	568	
IVE Group Ltd.	2 202	4 407	3 974	
Koninklijke KPN NV	3 803	17 961	19 966	
Macromill Inc.	200	1 844	1 446	
Maoyan Entertainment	6 000	11 028	8 465	
Millicom International Cellular SA	304	9 374	10 134	
Modern Times Group MTG AB	548	6 190	6 047	
MONY Group PLC	602	2 307	2 314	
Oricon Inc.	400	3 742	2 933	
Pico Far East Holdings Ltd.	18 000	4 556	5 742	
ProSiebenSat.1 Media SE	2 045	17 549	19 839	
Proto Corp.	300	3 490	3 774	
Reach PLC	106	717	180	
Rightmove PLC	2 550	24 026	23 686	
Sanoma Oyj	223	4 101	2 122	
Sea Ltd.	3 842	323 865	375 468	
SES SA	149	966	1 039	
Square Enix Holdings Co., Ltd.	1 700	69 205	69 875	
Storytel AB	629	4 545	4 474	
Superloop Ltd.	961	1 117	1 410	
Taboola.com Ltd.	3 268	16 725	15 383	
Telia Co AB	4 239	15 200	15 572	
Tuas Ltd.	1 008	3 525	4 072	
TX Group AG	53	9 180	13 123	
Ubisoft Entertainment SA	1 786	58 223	53 537	
Universal Music Group NV	85	3 496	3 463	
Vector Inc.	100	1 229	1 042	
Zengame Technology Holding Ltd.	2 000	551	1 013	
Zenrin Co., Ltd.	400	3 188	3 195	
		789 091	860 057	2,05
Services publics (31 décembre 2023 : 0,67 %)				
AGL Energy Ltd.	7 067	57 855	69 942	
Aygaz AS	1 602	11 528	12 036	
B Grimm Power PCL	1 500	1 141	1 208	
Celsia SA ESP	1 187	1 715	1 607	
CK Infrastructure Holdings Ltd.	500	3 973	3 865	
Doral Group Renewable Energy Resources Ltd.	219	818	799	
Drax Group PLC	1 536	13 181	13 077	
Electricity Generating PCL	300	1 219	1 158	
Enagas SA	142	2 868	2 893	
Enea SA	622	1 493	2 255	
Energa SA	816	2 198	3 139	
Engie SA	12 485	284 080	244 159	
EVN AG	185	7 281	8 085	
Hermana Holding ASA	202	93	63	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	900	3 427	3 047	
Hokkaido Gas Co., Ltd.	100	1 995	2 930	
Hokuriku Electric Power Co.	100	897	866	
Huadian Power International Corp. Ltd.	14 000	10 210	11 606	
Kenon Holdings Ltd.	388	14 014	13 242	
Korea Electric Power Corp.	478	5 418	4 637	
Okinawa Electric Power Co Inc.	700	6 792	6 639	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Orsted AS	23	1 734	1 676	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 812	142	180	
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	12 300	1 431	1 583	
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	6 388	18 446	15 607	
Rubis SCA	546	23 793	21 027	
Scatec ASA	325	3 101	3 619	
Severn Trent PLC	159	7 199	6 546	
SSE PLC	804	24 974	24 886	
Tauron Polska Energia SA	6 303	7 962	8 496	
United Utilities Group PLC	3 276	60 345	55 679	
YTL Corp. Bhd	47 700	25 655	47 733	
YTL Power International Bhd	28 700	18 552	40 125	
		625 530	634 410	1,51
Immobilier (31 décembre 2023 : 2,06 %)				
Aedifica SA	41	3 239	3 406	
Allreal Holding AG	59	13 593	13 818	
AP Thailand PCL	2 300	963	682	
Aroundtown SA	25 564	51 628	73 688	
Big Yellow Group PLC	47	1 011	954	
Blue Square Real Estate Ltd.	5	503	465	
Bumi Serpong Damai Tbk PT	5 500	454	439	
CA Immobilien Anlagen AG	730	34 121	33 145	
China Jinmao Holdings Group Ltd.	18 000	2 311	1 956	
China Overseas Grand Oceans Group Ltd.	9 000	3 371	3 092	
China Overseas Land & Investment Ltd.	17 000	45 154	40 342	
China Resources Land Ltd.	6 000	31 711	27 919	
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	31 000	30 068	26 188	
Covivio SA	290	19 755	18 875	
Cushman & Wakefield PLC	4 629	62 484	65 874	
Daiwa House Industry Co., Ltd.	1 700	63 649	58 957	
Derwent London PLC	136	4 911	5 316	
Eco World Development Group Bhd	24 100	6 481	10 486	
Emaar Development PJSC	175	464	522	
Fastighetsbolaget Emilshus AB	21	86	99	
FastPartner AB	239	1 182	2 177	
GLP J-Reit	13	14 888	14 520	
Grandy House Corp.	1 800	9 778	9 248	
Greentown China Holdings Ltd.	13 000	18 371	13 989	
Guangzhou R&F Properties Co., Ltd.	5 200	1 064	802	
Halk Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	27 094	3 292	3 393	
Hammerson PLC	5 133	3 396	2 459	
Hang Lung Properties Ltd.	7 000	8 421	8 171	
HMC Capital Ltd.	120	723	791	
Hopson Development Holdings Ltd.	3 800	2 707	2 384	
IMMOFINANZ AG	353	11 871	13 408	
Impact Healthcare Reit PLC	256	393	381	
Investis Holding SA	76	7 010	11 689	
IOI Properties Group Bhd	9 400	3 804	6 026	
Japan Metropolitan Fund Invest	14	11 045	10 778	
Katitas Co., Ltd.	100	1 414	1 483	
KDX Realty Investment Corp.	29	38 775	38 606	
Keihanshin Building Co., Ltd.	100	1 216	1 425	
Klepierre SA	27	1 004	989	
Land Securities Group PLC	2 459	27 003	26 350	
LBS Bina Group Bhd	40 100	7 516	8 375	
LEG Immobilien SE	31	3 432	3 467	
Lendlease Corp. Ltd.	11 100	63 323	54 878	
Link REIT	3 000	17 850	15 958	
Logan Group Co., Ltd.	3 000	414	421	
Longfor Group Holdings Ltd.	31 000	63 968	58 243	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	3 200	1 656	1 372	
Mah Sing Group Bhd	50 700	10 671	25 441	
Mirarth Holdings Inc.	400	1 795	1 763	
Mivne Real Estate KD Ltd.	–	–	–	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Nexity SA	446	6 598	5 452	
NP3 Fastigheter AB	168	3 895	5 579	
NSI NV	62	1 858	1 748	
OSK Holdings Bhd	11 500	3 704	5 304	
Peet Ltd.	88	90	97	
Poly Property Group Co., Ltd.	5 000	1 368	1 297	
Poly Property Services Co., Ltd.	200	1 296	1 013	
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	3 000	466	305	
Radiance Holdings Group Co., Ltd.	1 000	474	468	
Rural Funds Group	6 549	11 145	11 940	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	200	7 831	7 145	
Savills PLC	50	965	963	
Seazen Group Ltd.	20 000	5 216	4 767	
Selvaag Bolig ASA	597	3 260	2 839	
Sino-Ocean Group Holding Ltd.	14 000	1 294	822	
Sirius Real Estate Ltd.	180	368	292	
SP Setia Bhd Group	33 900	13 455	13 569	
Summarecon Agung Tbk PT	51 800	3 270	2 164	
Sun Hung Kai Properties Ltd.	1 000	12 788	11 839	
Sunac Services Holdings Ltd.	2 000	848	634	
Supalai PCL	1 200	883	805	
Swire Pacific Ltd.	4 500	36 272	54 419	
Swire Properties Ltd.	8 000	20 035	17 442	
TAG Immobilien AG	269	4 207	5 393	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 878	
Torunlar Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	2 097	3 518	4 696	
Vonovia SE	1 277	51 410	49 722	
Wadakohsan Corp.	300	3 757	3 682	
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	1 000	3 945	3 628	
Yuexiu Property Co., Ltd.	32 000	32 790	28 603	
		952 865	973 715	2,32
Total des actions étrangères – position acheteur		25 960 809	27 300 742	65,13
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -2,19 %)				
Aker BP ASA	(3 967)	(134 382)	(138 771)	
Ampol Ltd.	(1 085)	(33 261)	(32 066)	
Beach Energy Ltd.	(13 214)	(19 368)	(17 993)	
BLUENORD ASA	(8)	(562)	(565)	
Borr Drilling Ltd.	(1 073)	(8 879)	(9 473)	
Boss Energy Ltd.	(346)	(1 216)	(1 306)	
BP PLC, CAAE	(6)	(289)	(296)	
Cooper Energy Ltd.	(26 011)	(4 164)	(5 348)	
Delek Group Ltd.	(26)	(3 769)	(3 758)	
Diversified Energy Co PLC	(253)	(4 257)	(4 595)	
Ecopetrol SA	(1 602)	(26 474)	(24 529)	
Energean PLC	(138)	(2 314)	(2 354)	
Eni SpA, MIL	(2 889)	(51 692)	(60 815)	
Eni SpA, NYSE	(2 521)	(102 208)	(106 213)	
Equital Ltd.	(514)	(17 971)	(20 163)	
Geo Energy Resources Ltd.	(10 300)	(3 428)	(3 016)	
Neste Oyj	(6 750)	(230 453)	(164 573)	
New Hope Corp. Ltd.	(2 500)	(10 560)	(11 149)	
Paladin Energy Ltd.	(7 944)	(104 749)	(90 600)	
Reliance Industries Ltd., CIAÉ	(370)	(27 790)	(37 769)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(9)	(535)	(499)	
Serica Energy PLC	(375)	(1 087)	(882)	
Shell PLC, CAAÉ	(52)	(4 608)	(5 136)	
Technip Energies NV	(219)	(6 268)	(6 725)	
TGS ASA	(2 445)	(36 023)	(40 282)	
Verbio Vereinigte Bioenergie AG	(497)	(27 381)	(12 711)	
Woodside Energy Group Ltd.	(2 692)	(67 855)	(69 288)	
		(931 543)	(870 875)	(2,08)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Matières premières (31 décembre 2023 : -2,39 %)				
Amcor PLC	(1 099)	(13 897)	(14 954)	
AMG Critical Materials NV	(158)	(5 216)	(3 573)	
Anglogold Ashanti PLC	(715)	(23 319)	(24 586)	
Antofagasta PLC	(1 226)	(43 275)	(44 745)	
APERAM SA	(255)	(9 875)	(9 028)	
Aurubis AG	(152)	(16 875)	(16 328)	
Billerud Aktiebolag	(1 119)	(13 494)	(14 184)	
Buzzi SpA	(455)	(24 840)	(25 076)	
Capricorn Metals Ltd.	(1 693)	(6 633)	(7 395)	
Chalice Mining Ltd.	(15 745)	(23 388)	(20 432)	
Champion Iron Ltd., ASX	(1 327)	(7 754)	(7 761)	
Constellium SE	(243)	(6 835)	(6 268)	
Core Lithium Ltd.	(6 928)	(4 716)	(589)	
Croda International PLC	(276)	(22 870)	(18 848)	
De Grey Mining Ltd.	(4 383)	(4 168)	(4 566)	
Essentra PLC	(225)	(684)	(618)	
Forterra PLC	(127)	(370)	(349)	
H+H International A/S	(83)	(1 110)	(1 639)	
Holmen AB	(123)	(6 674)	(6 630)	
ICL Group Ltd.	(219)	(1 322)	(1 297)	
Iluka Resources Ltd.	(291)	(1 733)	(1 742)	
Imdex Ltd.	(4 170)	(8 379)	(8 460)	
Israel Corp. Ltd.	(3)	(974)	(918)	
Liontown Resources Ltd.	(31 815)	(38 774)	(26 312)	
Lynas Rare Earths Ltd.	(10 796)	(61 455)	(58 505)	
Marshalls PLC	(108)	(581)	(546)	
Mineral Resources Ltd.	(4 929)	(268 088)	(242 876)	
Mitsubishi Gas Chemical Co Inc.	(100)	(2 665)	(2 610)	
Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	(100)	(4 254)	(4 371)	
Nanofilm Technologies International Ltd.	(3 300)	(2 953)	(2 482)	
Navigator Co SA	(154)	(833)	(878)	
Nickel Industries Ltd.	(1 830)	(1 404)	(1 338)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(3 200)	(32 584)	(28 527)	
Novonesis (Novozymes) B	(4 198)	(321 453)	(351 765)	
Nufarm Ltd.	(2 702)	(11 279)	(11 358)	
Osaka Soda Co., Ltd.	(100)	(10 487)	(9 246)	
OSAKA Titanium Technologies Co., Ltd.	(400)	(8 714)	(9 418)	
Pilbara Minerals Ltd.	(99 723)	(319 976)	(279 775)	
Sandfire Resources Ltd.	(2 475)	(15 649)	(19 745)	
Sayona Mining Ltd.	(68 796)	(2 461)	(2 263)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(46)	(419)	(274)	
Sims Ltd.	(1 316)	(13 756)	(12 387)	
SOL SpA	(162)	(4 284)	(7 864)	
Suzano SA	(6 414)	(80 628)	(90 135)	
Svenska Cellulosa AB SCA	(1 376)	(27 978)	(27 833)	
Syrah Resources Ltd.	(11 047)	(8 942)	(3 584)	
Talga Group Ltd.	(2 468)	(2 953)	(1 308)	
Tessenderlo Group SA	(11)	(381)	(382)	
Voestalpine AG	(53)	(1 982)	(1 960)	
Yara International ASA	(894)	(35 416)	(35 340)	
Zignago Vetro SpA	(34)	(630)	(588)	
		(1 529 380)	(1 473 656)	(3,52)
Industries (31 décembre 2023 : -5,82 %)				
AF Gruppen ASA	(346)	(6 995)	(5 887)	
Air France-KLM	(136)	(2 156)	(1 641)	
Air New Zealand Ltd.	(1 093)	(789)	(483)	
Airbus SE	(1 028)	(232 154)	(193 364)	
Aker Carbon Capture ASA	(295)	(464)	(252)	
Alfen N.V.	(420)	(25 449)	(10 631)	
ALS Ltd.	(181)	(2 371)	(2 317)	
Ashtead Group PLC	(54)	(5 367)	(4 934)	
Ashtrom Group Ltd.	(295)	(5 693)	(4 611)	
Assa Abloy AB	(2 055)	(81 678)	(79 551)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Atlas Arteria Ltd.	(11 990)	(56 608)	(55 991)	
Auckland International Airport Ltd.	(2 236)	(14 815)	(14 225)	
AutoStore Holdings Ltd.	(4 286)	(10 141)	(6 918)	
Ayvens SA	(97)	(866)	(770)	
BayWa AG	(27)	(881)	(802)	
Beijer Ref AB	(4 683)	(81 966)	(98 931)	
Bpost SA	(150)	(1 388)	(665)	
Bunzl PLC	(597)	(32 140)	(31 082)	
Bystronic AG	(2)	(1 363)	(1 153)	
Carel Industries SpA	(60)	(1 733)	(1 522)	
Cavendish Hydrogen ASA	(108)	(404)	(382)	
Central Japan Railway Co.	(1 200)	(35 974)	(35 451)	
Chrysos Corp. Ltd.	(269)	(1 340)	(1 399)	
Clarivate PLC	(8 450)	(92 886)	(65 791)	
Daetwyler Holding AG	(12)	(3 260)	(3 084)	
Daimler Truck Holding AG	(3 876)	(224 924)	(211 285)	
Dassault Aviation SA	(66)	(16 922)	(16 416)	
Dfds A/S	(22)	(889)	(852)	
Dip Corp.	(100)	(2 433)	(2 327)	
DKSH Holding AG	(204)	(18 766)	(18 856)	
DSV A/S	(1 159)	(250 931)	(243 191)	
East Japan Railway Co.	(6 900)	(173 588)	(156 391)	
Elbit Systems Ltd.	(6)	(1 458)	(1 435)	
Elco Ltd.	(235)	(13 129)	(8 401)	
Electrolux Professional AB	(97)	(949)	(882)	
Emeren Group Ltd.	(1 217)	(3 561)	(2 498)	
Epiroc AB, cat. A	(3 147)	(83 069)	(86 000)	
EXEO Group Inc.	(300)	(4 401)	(4 082)	
Ferrovial SE	(1)	(35)	(53)	
Finnair Oyj	(2 125)	(8 782)	(8 179)	
Fletcher Building Ltd.	(164)	(431)	(387)	
Fujikura Ltd.	(900)	(23 230)	(24 315)	
GEA Group AG	(147)	(8 456)	(8 386)	
Geberit AG	(19)	(15 894)	(15 357)	
Genpact Ltd.	(4)	(187)	(176)	
Getlink SE	(63)	(1 408)	(1 427)	
GlobalData PLC	(234)	(745)	(882)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(353)	
GVS SpA	(151)	(1 235)	(1 455)	
Hankyu Hanshin Holdings Inc.	(100)	(3 592)	(3 636)	
Hays PLC	(4 511)	(8 345)	(7 374)	
Hexagon Purus ASA	(1 194)	(1 509)	(1 217)	
Hexatronic Group AB	(3 318)	(16 611)	(21 822)	
Husqvarna AB	(1 138)	(12 831)	(12 490)	
Hutchison Port Holdings Trust	(3 200)	(770)	(560)	
ID Logistics Group SACA	(3)	(1 650)	(1 546)	
IMCD NV	(135)	(29 201)	(25 599)	
IMI PLC	(101)	(3 291)	(3 082)	
Instalco AB	(202)	(1 119)	(1 059)	
Investment AB Latour	(1 482)	(53 194)	(54 804)	
IPH Ltd.	(1 176)	(6 501)	(6 738)	
Japan Airport Terminal Co., Ltd.	(100)	(6 695)	(4 667)	
Japan Steel Works Ltd.	(400)	(15 055)	(14 573)	
Jardine Cycle & Carriage Ltd.	(100)	(2 681)	(2 686)	
Jardine Matheson Holdings Ltd.	(300)	(15 005)	(14 524)	
Johns Lyng Group Ltd.	(4 444)	(23 301)	(23 149)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(4 800)	(90 163)	(95 544)	
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	(700)	(37 443)	(30 821)	
Kelsian Group Ltd.	(998)	(5 002)	(4 697)	
Komax Holding AG	(27)	(6 480)	(5 361)	
Kornit Digital Ltd.	(861)	(26 889)	(17 248)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(1 000)	(1 814)	(5 265)	
Kuehne + Nagel International AG	(911)	(343 862)	(358 451)	
Kyudenko Corp.	(200)	(11 722)	(10 060)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Kyushu Railway Co.	(300)	(8 791)	(8 893)	
Larsen & Toubro Ltd., CIAÉ	(11)	(558)	(641)	
Learning Technologies Group PLC	(715)	(1 005)	(1 045)	
Marlowe PLC	(59)	(403)	(439)	
Midac Holdings Co., Ltd.	(100)	(3 793)	(1 290)	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	(23 700)	(264 902)	(347 361)	
Mitsui E&S Co., Ltd.	(700)	(9 519)	(8 670)	
MonotaRO Co., Ltd.	(300)	(4 861)	(4 826)	
MTU Aero Engines AG	(655)	(208 510)	(229 386)	
Namura Shipbuilding Co., Ltd.	(200)	(2 708)	(4 098)	
NEL ASA	(7 048)	(6 093)	(5 074)	
Nibe Industrier AB	(13 204)	(89 502)	(76 671)	
Nippon Yusen KK	(1 500)	(64 894)	(59 741)	
Nolato AB	(30)	(383)	(223)	
NTG Nordic Transport Group A/S	(23)	(1 453)	(1 375)	
OX2 AB	(347)	(1 999)	(2 665)	
Pagegroup PLC	(174)	(1 334)	(1 280)	
Park24 Co., Ltd.	(100)	(1 315)	(1 363)	
Pasona Group Inc.	(100)	(2 569)	(1 793)	
Pluxee France SA	(5)	(207)	(192)	
PNE AG	(455)	(6 299)	(9 062)	
PostNL NV	(447)	(909)	(831)	
Qantas Airways Ltd.	(10 944)	(59 329)	(58 507)	
Rational AG	(12)	(14 275)	(13 683)	
RELX PLC, CAAÉ	(1 296)	(80 413)	(81 362)	
Rentokil Initial PLC	(812)	(5 602)	(6 478)	
Saab AB	(992)	(29 802)	(32 685)	
SATS Ltd.	(1 100)	(2 816)	(3 165)	
Seatrium Ltd.	(95 510)	(178 885)	(133 077)	
Seibu Holdings Inc.	(300)	(5 690)	(5 658)	
SG Holdings Co., Ltd.	(700)	(9 027)	(8 828)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(720)	(5 327)	(4 998)	
Singapore Airlines Ltd.	(9 500)	(64 733)	(66 183)	
Sixt SE	(141)	(17 490)	(13 699)	
Smiths Group PLC	(71)	(1 993)	(2 094)	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	(897)	(56 538)	(50 017)	
SPIE SA	(98)	(5 614)	(4 855)	
Spirax Group PLC	(26)	(4 427)	(3 814)	
S-Pool Inc.	(100)	(290)	(275)	
Stabilus SE	(19)	(1 310)	(1 191)	
Talenom Oyj	(76)	(1 161)	(537)	
Thales SA	(10)	(1 971)	(2 192)	
Tinexta SpA	(126)	(3 821)	(2 982)	
TOMRA Systems ASA	(3 552)	(52 972)	(58 155)	
Volvo AB	(662)	(23 308)	(23 189)	
Vow ASA	(911)	(1 542)	(807)	
West Japan Railway Co.	(3 700)	(100 759)	(94 264)	
Wizz Air Holdings PLC	(22)	(851)	(851)	
Worley Ltd.	(1 301)	(17 927)	(17 810)	
		(3 709 354)	(3 620 671)	(8,64)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -2,98 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(390)	
Aston Martin Lagonda Global Holdings PLC	(171)	(471)	(425)	
Auction Technology Group PLC	(74)	(683)	(641)	
Autobacs Seven Co., Ltd.	(100)	(1 343)	(1 323)	
Avolta AG	(2 912)	(161 030)	(154 754)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(2 748)	(13 100)	(15 132)	
Baby Bunting Group Ltd.	(213)	(463)	(302)	
Bapcor Ltd.	(2 235)	(10 168)	(10 498)	
Basic-Fit NV	(462)	(14 196)	(13 632)	
Brembo N.V.	(90)	(1 449)	(1 353)	
Breville Group Ltd.	(199)	(4 681)	(4 936)	
Brunello Cucinelli SpA	(210)	(29 822)	(28 795)	
Cie Financière Richemont SA	(735)	(149 159)	(156 970)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Cie Générale des Établissements Michelin SCA	(704)	(38 645)	(37 281)	
Create Restaurants Holdings Inc.	(300)	(2 800)	(2 807)	
Crest Nicholson Holdings PLC	(2 834)	(10 424)	(11 775)	
De' Longhi SpA	(468)	(13 820)	(20 041)	
Dometic Group AB	(2 244)	(22 589)	(19 513)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(1 279)	(54 324)	(41 949)	
Dr Martens PLC	(320)	(362)	(413)	
Eagers Automotive Ltd.	(1 809)	(19 124)	(17 391)	
Electra Consumer Products 1970 Ltd.	(200)	(7 719)	(5 470)	
Entain PLC	(480)	(6 425)	(5 231)	
ES-Con Japan Ltd.	(300)	(2 648)	(2 700)	
Europris ASA	(114)	(1 097)	(1 061)	
Exedy Corp.	(100)	(2 510)	(2 508)	
Fiskars OYJ Abp	(100)	(2 352)	(2 382)	
Flight Centre Travel Group Ltd.	(3 632)	(67 048)	(66 980)	
Food & Life Cos Ltd.	(600)	(16 295)	(13 288)	
Fox Wizel Ltd.	(10)	(1 063)	(927)	
Games Workshop Group PLC	(5)	(857)	(923)	
Genting Singapore Ltd.	(6 300)	(5 810)	(5 502)	
GN Store Nord AS	(4 567)	(158 116)	(174 323)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(64)	(320)	(213)	
Hella GmbH & Co KgaA	(224)	(18 020)	(28 087)	
IDP Education Ltd.	(5 107)	(83 088)	(70 706)	
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	(1 100)	(25 279)	(28 258)	
JM AB	(1 713)	(40 834)	(43 846)	
JVCKenwood Corp.	(500)	(4 001)	(3 964)	
Kambi Group PLC	(86)	(1 130)	(1 176)	
Kendrion NV	(178)	(3 898)	(3 425)	
K's Holdings Corp.	(200)	(2 500)	(2 573)	
La Française des Jeux SAEM	(711)	(33 825)	(33 158)	
Maytronics Ltd.	(1 691)	(12 456)	(8 611)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(2 675)	(30 332)	(27 306)	
Mercari Inc.	(1 700)	(26 434)	(28 886)	
MIPS AB	(64)	(2 840)	(3 432)	
Moncler SpA	(2 088)	(188 557)	(174 725)	
New Wave Group AB	(464)	(6 795)	(6 565)	
Nextage Co., Ltd.	(1 000)	(25 225)	(20 441)	
Nokian Renkaat Oyj	(918)	(11 204)	(10 353)	
On the Beach Group PLC	(153)	(355)	(363)	
Pan Pacific International Holdings Corp.	(1 600)	(54 020)	(51 229)	
Pets at Home Group PLC	(221)	(1 116)	(1 129)	
Pirelli & C SpA	(5 394)	(46 734)	(43 982)	
Polestar Automotive Holding UK PLC	(115)	(249)	(124)	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	(4 315)	(296 233)	(267 109)	
Prosus NV	(3 387)	(138 862)	(165 207)	
Rakuten Group Inc.	(9 800)	(72 561)	(69 183)	
Ryohin Keikaku Co., Ltd.	(3 100)	(67 850)	(70 513)	
Salvatore Ferragamo SpA	(502)	(8 392)	(5 820)	
Sankyo Co., Ltd.	(600)	(8 815)	(8 911)	
Sanrio Co., Ltd.	(1 600)	(42 344)	(40 259)	
Sega Sammy Holdings Inc.	(1 200)	(20 121)	(24 381)	
Sekisui Chemical Co., Ltd.	(100)	(1 924)	(1 894)	
Signet Jewelers Ltd.	(119)	(13 228)	(14 587)	
Skylark Holdings Co., Ltd.	(900)	(18 331)	(16 380)	
Sodexo SA	(70)	(8 520)	(8 623)	
SSP Group PLC	(262)	(841)	(671)	
Star Entertainment Grp Ltd.	(3 181)	(1 438)	(1 424)	
Tabcorp Holdings Ltd.	(2 372)	(1 847)	(1 517)	
Tadiran Group Ltd.	(55)	(6 604)	(3 940)	
Takashimaya Co., Ltd.	(200)	(3 978)	(4 606)	
Tomy Co., Ltd.	(200)	(4 730)	(5 390)	
Trigano SA	(9)	(1 858)	(1 444)	
Volvo Car AB, série B	(9 170)	(41 243)	(38 845)	
Zeal Network SE	(29)	(1 503)	(1 467)	
		(2 201 375)	(2 166 339)	(5,17)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -2,73 %)				
A2 Milk Co., Ltd.	(97)	(373)	(574)	
Aeon Co., Ltd.	(4 400)	(132 764)	(128 716)	
AG Barr PLC	(100)	(844)	(1 038)	
Agrana Beteiligungs AG	(102)	(2 613)	(2 079)	
Anheuser-Busch InBev SA	(183)	(14 542)	(14 561)	
Anora Group Oyj	(215)	(2 221)	(1 433)	
Axfood AB	(920)	(33 590)	(33 094)	
Bakkafrost P/F	(118)	(8 725)	(8 219)	
Barry Callebaut AG	(44)	(92 939)	(98 089)	
Becle SAB de CV	(200)	(660)	(495)	
Bega Cheese Ltd.	(113)	(406)	(439)	
BrasilAgro – Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(2 391)	(17 955)	(15 050)	
Calbee Inc.	(200)	(5 969)	(5 255)	
Cia Cervecerias Unidas SA	(30)	(532)	(467)	
Cloetta AB	(3 172)	(7 043)	(8 451)	
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc.	(200)	(3 820)	(3 431)	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	(166)	(10 123)	(16 552)	
Coles Group Ltd.	(2 246)	(32 547)	(34 954)	
Danone SA	(423)	(36 734)	(35 409)	
Davide Campari-Milano NV	(13 776)	(193 834)	(178 271)	
DFI Retail Group Holdings Ltd.	(7 800)	(26 676)	(20 279)	
Diageo PLC	(1)	(199)	(173)	
Elders Ltd.	(892)	(6 629)	(6 652)	
Emmi AG	(2)	(2 706)	(2 704)	
Endeavour Group Ltd.	(14 909)	(69 215)	(68 804)	
Euglena Co., Ltd.	(700)	(5 915)	(3 221)	
Fevertree Drinks PLC	(33)	(653)	(619)	
Glanbia PLC	(37)	(954)	(988)	
Grieg Seafood ASA	(2 407)	(21 195)	(19 411)	
Haleon PLC, CAAÉ	(267)	(3 159)	(3 018)	
Heineken Holding NV	(57)	(6 111)	(6 157)	
Heineken NV	(1 248)	(161 426)	(165 270)	
HelloFresh SE	(10 121)	(100 541)	(67 089)	
Imperial Brands PLC	(147)	(4 830)	(5 146)	
Interparfums SA	(14)	(849)	(784)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 477)	(3 212)	
Ito En Ltd.	(500)	(16 456)	(14 810)	
JDE Peet's NV	(114)	(3 442)	(3 110)	
Kao Corp.	(1 900)	(108 945)	(105 442)	
Kerry Group PLC	(245)	(28 841)	(27 181)	
Key Coffee Inc.	(500)	(10 184)	(8 851)	
Kirin Holdings Co., Ltd.	(300)	(5 884)	(5 290)	
Kobayashi Pharmaceutical Co., Ltd.	(500)	(24 843)	(22 215)	
Kobe Bussan Co., Ltd.	(500)	(16 422)	(15 244)	
Kusuri no Aoki Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 569)	(2 586)	
KWS Saat SE & Co KgaA	(136)	(14 767)	(11 887)	
Lion Corp.	(600)	(7 048)	(6 400)	
MARR SpA	(134)	(2 015)	(2 390)	
MEIJI Holdings Co., Ltd.	(400)	(12 293)	(11 804)	
Nestlé SA	(1 193)	(170 317)	(166 621)	
Newlat Food SpA	(100)	(778)	(1 798)	
Ocado Group PLC	(3 513)	(24 401)	(17 555)	
Orkla ASA	(1 338)	(15 158)	(14 917)	
Pernod Ricard SA	(46)	(10 319)	(8 547)	
PZ Cussons PLC	(197)	(389)	(337)	
Raisio Oyj	(653)	(2 364)	(1 825)	
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	(9)	(644)	(649)	
Reckitt Benckiser Group PLC	(92)	(7 244)	(6 814)	
Redcare Pharmacy NV	(156)	(25 617)	(26 081)	
Royal Unibrew A/S	(324)	(28 725)	(35 171)	
Scandinavian Tobacco Group A/S	(70)	(1 413)	(1 353)	
Schouw & Co A/S	(97)	(9 811)	(10 434)	
Select Harvests Ltd.	(503)	(1 599)	(1 811)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Sheng Siong Group Ltd.	(1 900)	(2 933)	(2 858)	
Strauss Group Ltd.	(533)	(12 795)	(10 803)	
Tate & Lyle PLC	(148)	(1 572)	(1 531)	
Tesco PLC	(9 088)	(47 997)	(48 102)	
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	(100)	(8 607)	(8 111)	
Treasury Wine Estates Ltd.	(363)	(3 942)	(4 127)	
Unicharm Corp.	(600)	(27 297)	(26 372)	
Watahan & Co., Ltd.	(200)	(2 837)	(3 035)	
Wilmar International Ltd.	(10 100)	(32 572)	(31 613)	
		(1 705 809)	(1 627 779)	(3,88)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -5,51 %)				
Affimed NV	(166)	(1 302)	(1 238)	
Amvis Holdings Inc.	(100)	(2 215)	(1 956)	
ArcticZymes Technologies ASA	(344)	(3 203)	(1 105)	
Argenx SE	(50)	(26 647)	(29 961)	
Argenx SE, CAAÉ	(1)	(510)	(588)	
AstraZeneca PLC, CAAÉ	(3)	(266)	(320)	
Atrys Health SA	(51)	(751)	(265)	
Bachem Holding AG	(31)	(3 768)	(3 892)	
BioArctic AB	(823)	(23 387)	(24 330)	
BioMérieux	(350)	(48 065)	(45 554)	
Chemometec A/S	(232)	(18 467)	(13 897)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(6 600)	(288 833)	(320 910)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(223)	(3 058)	(3 132)	
Coloplast A/S	(1 716)	(274 025)	(282 315)	
ConvaTec Group PLC	(1 404)	(5 676)	(5 702)	
COSMO Pharmaceuticals NV	(26)	(2 795)	(2 775)	
CRISPR Therapeutics AG	(612)	(46 624)	(45 229)	
CureVac NV	(61)	(400)	(278)	
CVS Group PLC	(38)	(634)	(663)	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	(2 800)	(136 002)	(131 571)	
DiaSorin SpA	(1 155)	(162 856)	(157 629)	
EBOS Group Ltd.	(440)	(12 405)	(11 821)	
Eckert & Ziegler SE	(18)	(1 119)	(1 211)	
Eurobio Scientific SA	(50)	(1 391)	(1 013)	
Evotec SE	(6 877)	(101 540)	(90 516)	
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	(135)	(3 370)	(3 386)	
Galapagos NV	(173)	(9 385)	(5 922)	
Galapagos NV, CAAÉ	(1 328)	(57 750)	(45 029)	
Galenica AG	(113)	(12 070)	(12 656)	
Genmab A/S	(563)	(219 733)	(193 198)	
Getinge AB	(1 177)	(32 083)	(27 382)	
GNI Group Ltd.	(432)	(12 393)	(8 706)	
H.U. Group Holdings Inc.	(100)	(2 187)	(1 998)	
I-Mab	(2 675)	(9 203)	(6 113)	
Indivior PLC	(100)	(2 188)	(2 145)	
Integral Diagnostics Ltd.	(168)	(365)	(410)	
Ipsen SA	(14)	(2 513)	(2 351)	
JMDC Inc.	(100)	(4 287)	(2 825)	
Legend Biotech Corp.	(28)	(2 458)	(1 697)	
Lonza Group AG	(80)	(58 753)	(59 740)	
Medacta Group SA	(48)	(8 466)	(8 932)	
Medicover AB	(27)	(503)	(664)	
Medios AG	(290)	(11 945)	(6 864)	
MedPeer Inc.	(100)	(685)	(533)	
Merck KGaA	(133)	(33 448)	(30 184)	
Merus NV	(296)	(11 590)	(23 966)	
Mesoblast Ltd.	(11 894)	(9 410)	(10 761)	
Mesoblast Ltd., CAAÉ	(276)	(1 397)	(2 572)	
Molecular Partners AG	(49)	(964)	(486)	
Nykode Therapeutics ASA	(1 339)	(2 552)	(2 631)	
Oriola Oyj	(722)	(967)	(957)	
Orion Oyj	(495)	(25 608)	(28 936)	
Oxford Nanopore Technologies PLC	(295)	(496)	(482)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
PolyNovo Ltd.	(3 953)	(6 594)	(8 851)	
Pro Medicus Ltd.	(51)	(6 575)	(6 677)	
ProQR Therapeutics NV	(452)	(1 305)	(1 027)	
QIAGEN NV	(1 682)	(99 076)	(95 092)	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	(117)	(8 462)	(8 356)	
Roche Holding AG	(62)	(24 899)	(25 849)	
Ryman Healthcare Ltd.	(13 610)	(64 694)	(40 399)	
Sartorius AG	(15)	(4 790)	(4 818)	
Sartorius Stedim Biotech	(13)	(3 473)	(2 923)	
Shionogi & Co., Ltd.	(2 000)	(128 493)	(106 790)	
Spire Healthcare Group PLC	(125)	(515)	(508)	
Straumann Holding AG	(483)	(88 380)	(81 859)	
Summerset Group Holdings Ltd.	(157)	(1 292)	(1 244)	
Surgical Science Sweden AB	(133)	(2 432)	(2 150)	
Swedish Orphan Biovitrum AB	(2 617)	(91 864)	(95 896)	
Sysmex Corp.	(3 400)	(85 905)	(74 937)	
Tecan Group AG	(61)	(31 127)	(27 940)	
UCB SA	(566)	(104 971)	(115 129)	
Valneva SE	(175)	(925)	(817)	
Vetoquinol SA	(73)	(7 640)	(10 031)	
Vimian Group AB	(507)	(1 994)	(2 250)	
Virbac SACA	(2)	(1 078)	(958)	
Vitrolife AB	(150)	(3 408)	(3 378)	
Zealand Pharma A/S	(547)	(67 486)	(96 005)	
		(2 540 086)	(2 483 281)	(5,92)
Services financiers (31 décembre 2023 : -3,42 %)				
ABC arbitrage	(112)	(1 218)	(632)	
Adyen NV	(79)	(142 350)	(128 971)	
Aegon Ltd., AMS	(23 749)	(182 424)	(200 892)	
Aegon Ltd., NYSE	(869)	(5 221)	(7 289)	
Aiful Corp.	(500)	(2 268)	(1 620)	
ASR Nederland NV	(1 178)	(78 610)	(76 894)	
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	(1 896)	(49 190)	(48 930)	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	(3)	(27)	(32)	
BFF Bank SpA	(357)	(6 088)	(4 644)	
Challenger Ltd.	(397)	(2 348)	(2 543)	
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	(191)	(4 407)	(3 704)	
Credit Corp. Group Ltd.	(285)	(3 948)	(3 899)	
Daiwa Securities Group Inc.	(3 100)	(35 184)	(32 356)	
HSBC Holdings PLC, CAAE	(183)	(10 278)	(10 893)	
Hypoport SE	(9)	(3 631)	(3 949)	
Illimity Bank SpA	(738)	(9 674)	(5 160)	
Japan Post Holdings Co., Ltd.	(700)	(9 314)	(9 497)	
Judo Capital Holdings Ltd.	(558)	(629)	(643)	
Jyske Bank A/S	(674)	(73 967)	(73 429)	
Leonteq AG	(42)	(1 790)	(1 426)	
M&A Capital Partners Co., Ltd.	(200)	(8 110)	(3 734)	
M&G PLC	(14 675)	(51 672)	(51 782)	
MA Financial Group Ltd.	(105)	(427)	(430)	
Mebuki Financial Group Inc.	(300)	(1 520)	(1 599)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	(4 200)	(48 992)	(61 772)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAÉ	(2 330)	(30 333)	(34 433)	
Nexi SpA	(10 827)	(128 916)	(90 410)	
Nomura Holdings Inc.	(4 300)	(36 182)	(33 725)	
Nordea Bank Abp	(1 061)	(17 659)	(17 287)	
Nordnet AB publ	(34)	(977)	(973)	
Omni Bridgeway Ltd.	(436)	(354)	(442)	
Phoenix Group Holdings PLC	(1 907)	(16 481)	(17 202)	
Poste Italiane SpA	(4 167)	(73 326)	(72 691)	
Resona Holdings Inc.	(1 200)	(11 058)	(10 866)	
Ringkjoebing Landbobank A/S	(378)	(89 479)	(86 674)	
St James's Place PLC	(9 700)	(81 223)	(91 693)	
Storebrand ASA	(3 233)	(39 678)	(45 288)	
Topdanmark AS	(173)	(11 565)	(12 513)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Tryg A/S	(347)	(9 686)	(10 386)	
WealthNavi Inc.	(100)	(1 298)	(1 283)	
Westpac Banking Corp.	(11 083)	(257 930)	(275 791)	
		(1 539 432)	(1 538 377)	(3,67)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -4,97 %)				
Addnode Group AB	(46)	(701)	(725)	
Adesso SE	(7)	(1 134)	(860)	
AEM Holdings Ltd.	(1 106)	(2 272)	(2 010)	
ALSO Holding AG	(13)	(4 910)	(5 483)	
Appier Group Inc.	(400)	(6 231)	(4 110)	
Atea ASA	(23)	(402)	(452)	
Aurora Innovation Inc.	(686)	(3 980)	(2 600)	
BrainChip Holdings Ltd.	(2 142)	(1 080)	(431)	
Bytes Technology Group PLC	(84)	(732)	(806)	
Canaan Inc.	(14 567)	(29 052)	(19 929)	
Change Holdings Inc.	(100)	(2 031)	(1 022)	
Cybozu Inc.	(100)	(1 984)	(1 700)	
Darktrace PLC	(169)	(1 006)	(1 686)	
Dassault Systèmes SE	(1 918)	(121 429)	(99 292)	
Disco Corp.	(100)	(53 701)	(51 923)	
Esker SA	(4)	(1 187)	(1 031)	
ExaWizards Inc.	(300)	(1 507)	(888)	
FD Technologies PLC	(24)	(455)	(591)	
Fixstars Corp.	(100)	(2 046)	(1 662)	
Formula Systems 1985 Ltd.	(6)	(597)	(577)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(6 800)	(198 595)	(217 608)	
GB Group PLC	(157)	(944)	(923)	
GFT Technologies SE	(14)	(554)	(512)	
Halma PLC	(101)	(3 839)	(4 727)	
HMS Networks AB	(42)	(2 402)	(2 281)	
Infineon Technologies AG	(4 290)	(207 947)	(215 827)	
Infosys Ltd.	(235)	(5 800)	(5 987)	
Innoviz Technologies Ltd.	(2 251)	(6 568)	(2 857)	
IVU Traffic Technologies AG	(104)	(2 522)	(2 135)	
Japan Display Inc.	(1 000)	(372)	(162)	
Japan System Techniques Co., Ltd.	(200)	(1 689)	(2 843)	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	(455)	(17 715)	(12 900)	
Kainos Group PLC	(100)	(2 162)	(1 830)	
Keyence Corp.	(500)	(281 094)	(300 064)	
Keywords Studios PLC	(600)	(21 536)	(23 995)	
Kitron ASA	(230)	(836)	(935)	
Lasertec Corp.	(700)	(225 183)	(214 898)	
Lime Technologies AB	(168)	(5 696)	(7 597)	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	(3 155)	(19 580)	(3 683)	
Megaport Ltd.	(273)	(3 459)	(2 799)	
Melexis NV	(73)	(8 279)	(8 607)	
Meyer Burger Technology AG	(136 845)	(2 535)	(2 292)	
Money Forward Inc.	(400)	(23 087)	(18 357)	
Nano Dimension Ltd.	(1 481)	(5 004)	(4 458)	
Nayax Ltd.	(23)	(776)	(668)	
NCAB Group AB	(117)	(937)	(1 255)	
Netcompany Group A/S	(685)	(50 021)	(40 250)	
Nordic Semiconductor ASA	(5 467)	(73 441)	(100 188)	
Otsuka Corp.	(200)	(5 612)	(5 259)	
Oxford Instruments PLC	(18)	(795)	(769)	
PKSHA Technology Inc.	(100)	(4 781)	(3 016)	
REC Silicon ASA	(3 598)	(6 141)	(3 227)	
Reply SpA	(192)	(37 023)	(38 801)	
Ricoh Co., Ltd.	(1 500)	(17 401)	(17 551)	
Rorze Corp.	(100)	(26 344)	(27 008)	
Sage Group PLC	(148)	(3 165)	(2 787)	
Samsung Electronics Co., Ltd., CIAÉ	(112)	(218 557)	(226 817)	
Seco SpA	(901)	(4 245)	(3 977)	
Secunet Security Networks AG	(6)	(3 816)	(1 103)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Sesa SpA	(6)	(872)	(1 015)	
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	(200)	(9 672)	(9 595)	
Silex Systems Ltd.	(257)	(1 089)	(1 252)	
Sinch AB	(35 798)	(114 490)	(118 873)	
SiteMinder Ltd.	(472)	(2 254)	(2 196)	
SMART Global Holdings Inc.	(215)	(5 934)	(6 728)	
Softcat PLC	(54)	(1 470)	(1 697)	
Softwareone Holding AG	(52)	(948)	(1 338)	
SOITEC	(13)	(2 057)	(1 987)	
Tokyo Electron Device Ltd.	(100)	(5 749)	(3 641)	
Towa Corp.	(200)	(12 352)	(19 191)	
Truecaller AB	(951)	(4 588)	(4 360)	
UMS Holdings Ltd.	(700)	(747)	(834)	
Vitec Software Group AB	(92)	(6 491)	(6 538)	
WiseTech Global Ltd.	(1 772)	(124 178)	(162 420)	
Xero Ltd.	(212)	(25 314)	(26 426)	
		(2 055 095)	(2 096 822)	(5,00)
Services de communication (31 décembre 2023 : -2,30 %)				
Adways Inc.	(200)	(1 102)	(698)	
Airtel Africa PLC	(359)	(690)	(746)	
America Movil SAB de CV	(39)	(994)	(907)	
Ascential PLC	(148)	(848)	(876)	
Better Collective A/S	(193)	(6 051)	(5 661)	
Borussia Dortmund GmbH & Co KgaA	(730)	(3 896)	(3 779)	
Capcom Co., Ltd.	(2 900)	(68 923)	(74 820)	
Cellnex Telecom SA	(5 594)	(267 418)	(249 149)	
COOKPAD Inc.	(100)	(285)	(159)	
DeNA Co., Ltd.	(200)	(2 820)	(2 714)	
Digital Bros SpA	(52)	(771)	(688)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 071)	(11 004)	(11 347)	
Embracer Group AB	(18 804)	(53 179)	(56 586)	
Freenet AG	(274)	(10 499)	(9 965)	
Future PLC	(111)	(1 251)	(2 014)	
Gurunavi Inc.	(1 300)	(5 142)	(3 506)	
Hakuhodo DY Holdings Inc.	(800)	(10 140)	(7 996)	
Heroz Inc.	(300)	(4 735)	(3 215)	
Informa PLC	(2 533)	(34 846)	(37 496)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(12 771)	(186 965)	(182 609)	
Internet Initiative Japan Inc.	(100)	(2 150)	(2 016)	
Japan Communications Inc.	(800)	(1 747)	(1 279)	
Kakaku.com Inc.	(700)	(10 874)	(12 555)	
Kinepolis Group NV	(33)	(1 994)	(1 648)	
Métropole Télévision SA	(384)	(6 939)	(6 611)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., A	(663)	(1 753)	(3 129)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	(61)	(367)	(362)	
Mobile TeleSystems PJSC	(1 375)	(12 856)	–	
Netlink Nbn Trust	(1 900)	(1 655)	(1 592)	
Nexon Co., Ltd.	(7 400)	(182 758)	(187 269)	
Nine Entertainment Co Holdings Ltd.	(6 201)	(9 233)	(7 934)	
NOS SGPS SA	(2 143)	(11 160)	(10 387)	
Partner Communications Co., Ltd.	(214)	(1 305)	(1 181)	
Perion Network Ltd.	(238)	(3 623)	(2 741)	
Publicis Groupe SA	(390)	(56 480)	(56 840)	
RTL Group SA	(218)	(11 281)	(9 080)	
SEEK Ltd.	(4 843)	(102 975)	(94 535)	
Septeni Holdings Co., Ltd.	(1 600)	(5 528)	(5 036)	
Singapore Telecommunications Ltd.	(4 600)	(11 450)	(12 772)	
Spark New Zealand Ltd.	(3 724)	(12 956)	(12 917)	
TBS Holdings Inc.	(200)	(3 125)	(6 897)	
Telekom Austria AG	(38)	(438)	(519)	
Telenor ASA	(2 137)	(33 470)	(33 423)	
Viaplay Group AB	(51 775)	(6 077)	(4 799)	
Vivendi SE	(802)	(11 983)	(11 475)	
YouGov PLC	(198)	(1 486)	(1 390)	
		(1 177 222)	(1 143 318)	(2,73)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Services publics (31 décembre 2023 : -0,70 %)				
E.ON SE	(6 675)	(120 803)	(119 966)	
Earth Infinity Co., Ltd.	(100)	(136)	(107)	
EDP Renovaveis SA	(972)	(19 094)	(18 602)	
Elia Group SA	(43)	(6 087)	(5 515)	
ERG SpA	(828)	(28 503)	(28 463)	
Genesis Energy Ltd.	(1 718)	(3 914)	(3 137)	
Hera SpA	(747)	(3 526)	(3 499)	
Hokkaido Electric Power Co Inc.	(1 000)	(10 602)	(10 157)	
Italgas SpA	(2 743)	(20 161)	(18 512)	
Kansai Electric Power Co Inc.	(4 300)	(95 302)	(98 833)	
Kyushu Electric Power Co Inc.	(400)	(6 296)	(5 638)	
Mercury NZ Ltd.	(302)	(1 689)	(1 653)	
Neoen SA	(51)	(1 998)	(2 817)	
Orron Energy ab	(395)	(368)	(365)	
REN – Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	(1 571)	(5 071)	(5 276)	
RENOVA Inc.	(300)	(3 241)	(2 537)	
RWE AG	(873)	(43 190)	(40 905)	
Snam SpA	(4 817)	(30 105)	(29 183)	
Tokyo Electric Power Co Holdings Inc.	(7 900)	(61 764)	(58 209)	
Tokyo Gas Co., Ltd.	(200)	(6 326)	(5 878)	
Voltalia SA	(405)	(4 889)	(5 138)	
		(473 065)	(464 390)	(1,11)
Immobilier (31 décembre 2023 : -0,88 %)				
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(579)	(5 802)	(5 300)	
CapitaLand Ascendas REIT	(2 900)	(7 642)	(7 496)	
CapitaLand Ascott Trust	(3 500)	(3 175)	(3 092)	
CapitaLand China Trust	(700)	(500)	(474)	
CapitaLand Integrated Commercial Trust	(18 900)	(37 067)	(37 784)	
Castellum AB	(6 354)	(106 423)	(106 236)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(682)	(2 969)	(2 948)	
Charter Hall Group	(6 499)	(68 839)	(66 399)	
Charter Hall Long Wale REIT	(2 696)	(10 505)	(8 007)	
Charter Hall Social Infrastructure REIT	(220)	(499)	(476)	
Citycon Oyj	(613)	(3 399)	(3 551)	
Corem Property Group AB	(490)	(487)	(554)	
Deutsche Wohnen SE	(264)	(12 082)	(6 953)	
Electra Real Estate Ltd.	(317)	(4 095)	(3 710)	
Entra ASA	(31)	(390)	(436)	
Fastighets AB Balder	(7 012)	(64 400)	(65 795)	
Frasers Centrepoint Trust	(5 300)	(11 543)	(11 398)	
Goodman Property Trust	(1 197)	(2 155)	(2 006)	
Great Portland Estates PLC	(982)	(5 344)	(5 699)	
Hamborner REIT AG	(590)	(6 667)	(5 641)	
Hongkong Land Holdings Ltd.	(1 200)	(5 612)	(5 304)	
Hufvudstaden AB	(54)	(870)	(876)	
Hulic Co., Ltd.	(500)	(6 534)	(6 059)	
ICADE	(87)	(3 838)	(2 927)	
Ichigo Office REIT Investment Corp.	(1)	(701)	(703)	
Immobel SA	(233)	(24 574)	(8 474)	
Instone Real Estate Group SE	(100)	(1 102)	(1 203)	
Japan Logistics Fund Inc.	(2)	(5 781)	(4 525)	
Lifestyle Communities Ltd.	(818)	(10 656)	(9 292)	
Mega Or Holdings Ltd.	(39)	(1 097)	(1 277)	
Mercialys SA	(124)	(2 086)	(1 879)	
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	(4 400)	(106 268)	(94 319)	
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	(11 600)	(153 311)	(144 904)	
Mivne Real Estate KD Ltd.	(599)	(1 948)	(1 919)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(200)	(1 754)	(3 452)	
Mobimo Holding AG	(15)	(5 833)	(5 813)	
Nyfosa AB	(223)	(2 959)	(2 959)	
Palace Capital PLC	(100)	(423)	(408)	
Parkway Life REIT	(800)	(2 864)	(2 827)	
PEXA Group Ltd.	(1 214)	(15 783)	(15 299)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Robot Home Inc.	(1 500)	(2 601)	(2 399)	
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, cat. B	(27 098)	(15 945)	(18 882)	
Tokyo Tatemono Co., Ltd.	(100)	(2 190)	(2 160)	
Vital Healthcare Property Trust	(2 929)	(5 695)	(4 396)	
Wallenstam AB	(22)	(103)	(143)	
Waypoint REIT Ltd.	(318)	(692)	(631)	
Wihlborgs Fastigheter AB	(109)	(1 336)	(1 379)	
		(736 539)	(688 364)	(1,64)
Total des actions étrangères – position vendeur		(18 598 900)	(18 173 872)	(43,36)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		(37 403)		
Total des placements		27 072 458	29 686 022	70,82
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			283 612	0,68
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(10 011)	(0,02)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			1 648 920	3,93
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(1 155 262)	(2,76)
Autres actifs, moins les passifs			11 462 450	27,35
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			41 915 731	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente $
Banque Royale du Canada	USD	(600)	HKD	4 687	3 juillet 2024	–
Banque Royale du Canada	USD	(445 839)	AUD	674 000	13 sept. 2024	7 021
Banque Royale du Canada	EUR	(1 017 000)	USD	1 096 434	13 sept. 2024	3 147
Banque Royale du Canada	EUR	(361 000)	USD	389 238	13 sept. 2024	1 174
Banque Royale du Canada	JPY	(94 136 000)	USD	608 420	13 sept. 2024	21 819
Banque Royale du Canada	USD	(179 920)	MXN	3 366 000	13 sept. 2024	2 597
Banque Royale du Canada	CHF	(110 000)	USD	123 911	13 sept. 2024	445
Banque Royale du Canada	USD	(28 674 946)	CAD	39 412 000	13 sept. 2024	244 625
Banque Royale du Canada	USD	(697 153)	CAD	955 000	13 sept. 2024	2 784
						283 612
Banque Royale du Canada	USD	(236 681)	GBP	186 000	13 sept. 2024	(1 921)
Banque Royale du Canada	HKD	(8 951 000)	USD	1 148 372	13 sept. 2024	(827)
Banque Royale du Canada	NOK	(2 183 000)	USD	204 658	13 sept. 2024	(1 036)
Banque Royale du Canada	USD	(353 493)	SEK	3 701 000	13 sept. 2024	(3 518)
Banque Royale du Canada	USD	(125 586)	CHF	110 000	13 sept. 2024	(2 709)
						(10 011)
						273 601

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

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				
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
257	31 juill. 2024	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	26 050	(2 902)
1 357	31 juill. 2024	Abrdn Plc, swap sur rendement total	3 479	(136)
492	31 juill. 2024	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	3 230	(59)
615	31 juill. 2024	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	1 974	(5)
1 084	31 juill. 2024	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	3 189	(438)
1 856	31 juill. 2024	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	16 758	(1 462)
857	31 juill. 2024	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	2 120	33
326	31 juill. 2024	Bank Of Cyprus Holdings Plc, swap sur rendement total	1 889	(188)
226	31 juill. 2024	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	15 774	1 217
35	31 juill. 2024	Bellway Plc, swap sur rendement total	1 545	(81)
488	31 juill. 2024	Bodycote Plc, swap sur rendement total	5 757	(631)
191	31 juill. 2024	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	1 279	–
846	31 juill. 2024	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	294	85
724	31 juill. 2024	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	12 774	(1 301)
53	31 juill. 2024	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	388	(49)
50	31 juill. 2024	Craneware Plc, swap sur rendement total	1 998	(137)
1 691	31 juill. 2024	Currys Plc, swap sur rendement total	2 106	(170)
61	31 juill. 2024	Discoverie Group Plc, swap sur rendement total	717	(51)
1 364	31 juill. 2024	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	7 238	(607)
3 297	31 juill. 2024	Enquest Plc, swap sur rendement total	774	(147)
174	31 juill. 2024	Fdm Group Holdings Plc, swap sur rendement total	1 237	(123)
4 220	31 juill. 2024	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	11 555	(944)
1 168	31 juill. 2024	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	17 829	(37)
448	31 juill. 2024	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	1 852	(214)
12 784	31 juill. 2024	Glencore Plc, swap sur rendement total	99 751	(5 809)
2 787	31 juill. 2024	Halfords Group Plc, swap sur rendement total	6 768	(638)
15 220	31 juill. 2024	Hammerson Plc, swap sur rendement total	7 292	(88)
305	31 juill. 2024	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	5 972	375
24	31 juill. 2024	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	477	2
496	31 juill. 2024	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	1 398	85
514	31 juill. 2024	Hunting Plc, swap sur rendement total	3 676	(43)
12 807	31 juill. 2024	Investec Plc, swap sur rendement total	127 046	11 763
2 078	31 juill. 2024	Iwg Plc, swap sur rendement total	6 215	(358)
17 150	31 juill. 2024	Jd Sports Fashion Plc, swap sur rendement total	35 628	(2 365)
303	31 juill. 2024	Johnson Matthey Plc, swap sur rendement total	8 501	(689)
12 132	31 juill. 2024	Just Group Plc, swap sur rendement total	22 118	300
987	31 juill. 2024	Keller Group Plc, swap sur rendement total	20 965	(1 090)
2 783	31 juill. 2024	Kier Group Plc, swap sur rendement total	6 374	(706)
320	31 juill. 2024	Land Securities Group Plc, swap sur rendement total	3 496	(117)
7 363	31 juill. 2024	Marks & Spencer Group Plc, swap sur rendement total	36 743	(1 860)
1 028	31 juill. 2024	Marston'S Plc, swap sur rendement total	554	(85)
417	31 juill. 2024	Mears Group Plc, swap sur rendement total	2 711	(136)
415	31 juill. 2024	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	2 049	(169)
3 576	31 juill. 2024	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	7 373	(144)
1 824	31 juill. 2024	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	7 010	(114)
1 666	31 juill. 2024	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	8 905	(32)
560	31 juill. 2024	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	24 555	47
2 331	31 juill. 2024	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	6 153	401
289	31 juill. 2024	Netcall Plc, swap sur rendement total	460	31
109	31 juill. 2024	Next Plc, swap sur rendement total	17 037	(637)
899	31 juill. 2024	Ninety One Plc, swap sur rendement total	2 603	(54)
3 362	31 juill. 2024	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	24 925	(2 154)
4 473	31 juill. 2024	Pan African Resources Plc, swap sur rendement total	2 016	31
1 132	31 juill. 2024	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	14 392	(621)
1 436	31 juill. 2024	Persimmon Plc, swap sur rendement total	34 576	(1 427)
6 291	31 juill. 2024	Premier Foods Plc, swap sur rendement total	17 468	(1 216)
325	31 juill. 2024	Puretech Health Plc, swap sur rendement total	1 029	(285)
1 459	31 juill. 2024	Rank Group Plc, swap sur rendement total	1 716	(329)
581	31 juill. 2024	Reach Plc, swap sur rendement total	988	170
986	31 juill. 2024	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	18 221	(59)
893	31 juill. 2024	Renewi Plc, swap sur rendement total	10 334	90
5 935	31 juill. 2024	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	46 895	123
1 898	31 juill. 2024	Schroders Plc, swap sur rendement total	11 944	(851)
1 249	31 juill. 2024	Senior Plc, swap sur rendement total	3 457	(8)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
293	31 juill. 2024	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	488	(7)
986	31 juill. 2024	Smiths News Plc, swap sur rendement total	1 029	(12)
763	31 juill. 2024	Somero Enterprises Inc, action ord., swap sur rendement total	4 421	(446)
5 163	31 juill. 2024	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	12 695	(516)
298	31 juill. 2024	Tbc Bank Group Plc, swap sur rendement total	13 897	716
85	31 juill. 2024	Trainline Plc, swap sur rendement total	462	(9)
2 911	31 juill. 2024	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	10 826	361
6 574	31 juill. 2024	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	3 643	(787)
2 019	31 juill. 2024	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	2 563	(230)
989	31 juill. 2024	Victorian Plumbing Plc, swap sur rendement total	1 588	(18)
174	31 juill. 2024	Vistry Group Plc, swap sur rendement total	3 561	(312)
356	31 juill. 2024	Volex Plc, swap sur rendement total	1 983	(188)
423	31 juill. 2024	Watches Of Switzerland Group, swap sur rendement total	3 029	22
182	31 juill. 2024	Xp Power Ltd, swap sur rendement total	4 659	(130)
				(18 569)
Euro – taux à court terme (€STR)				
18	31 juill. 2024	Akwel, swap sur rendement total	290	(54)
3 263	31 juill. 2024	Alstom, swap sur rendement total	75 129	(8 773)
278	31 juill. 2024	Assystem, swap sur rendement total	21 608	(1 996)
144	31 juill. 2024	Aubay, swap sur rendement total	7 866	(1 624)
95	31 juill. 2024	Axway Software Sa, swap sur rendement total	3 650	210
331	31 juill. 2024	Beneteau, swap sur rendement total	4 743	(1 729)
1	31 juill. 2024	Cargotec Oyj, actions, B, swap sur rendement total	110	(3)
4 059	31 juill. 2024	Carrefour Sa, swap sur rendement total	78 575	(10 599)
274	31 juill. 2024	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	5 449	(1 014)
274	31 juill. 2024	Covivio, swap sur rendement total	17 833	(1 425)
247	31 juill. 2024	Derichebourg, swap sur rendement total	1 539	(345)
479	31 juill. 2024	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	32 700	(5 365)
1	31 juill. 2024	Flatex Ag, swap sur rendement total	19	(1)
606	31 juill. 2024	F-Secure Corp, swap sur rendement total	1 724	(276)
43	31 juill. 2024	Groupe Crit, swap sur rendement total	3 973	(415)
88	31 juill. 2024	Jacquet Métal Service Sa, swap sur rendement total	1 889	(376)
409	31 juill. 2024	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	47 685	(4 514)
390	31 juill. 2024	Klepierre, swap sur rendement total	14 287	(1 020)
139	31 juill. 2024	Legrand Sa, swap sur rendement total	18 884	(1 372)
204	31 juill. 2024	Lisi, swap sur rendement total	6 941	(1 030)
63	31 juill. 2024	Mersen, swap sur rendement total	2 943	(595)
31	31 juill. 2024	Metso Oyj, swap sur rendement total	449	(36)
50	31 juill. 2024	Mlp Se, swap sur rendement total	442	(28)
102	31 juill. 2024	Nexans Sa, swap sur rendement total	15 392	(1 260)
15	31 juill. 2024	Nordex Se, swap sur rendement total	252	(67)
968	31 juill. 2024	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	4 600	213
487	31 juill. 2024	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	936	(160)
12	31 juill. 2024	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	285	(12)
7	31 juill. 2024	Rubis, swap sur rendement total	270	(55)
95	31 juill. 2024	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	25 231	(5 010)
12	31 juill. 2024	Synergie Sa, swap sur rendement total	568	(76)
626	31 juill. 2024	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	18 765	(1 869)
3 077	31 juill. 2024	Valeo Sa, swap sur rendement total	44 845	(5 615)
48	31 juill. 2024	Vallourec Sa, swap sur rendement total	1 031	(120)
36	31 juill. 2024	Verallia, swap sur rendement total	1 789	(200)
1 837	31 juill. 2024	Viridien, swap sur rendement total	1 285	(378)
29	31 juill. 2024	Vusiongroup, swap sur rendement total	5 542	(623)
293	31 juill. 2024	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	2 570	(271)
				(57 883)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaifre offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
1 000	31 juill. 2024	Aia Group Ltd, swap sur rendement total	9 289	(1 036)
10 000	31 juill. 2024	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	2 208	(148)
8 000	31 juill. 2024	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	16 573	(1 569)
3 000	31 juill. 2024	China Molybdenum Co Ltd, H, swap sur rendement total	3 841	38
2 002	31 juill. 2024	China Nonferrous Mining Corp, swap sur rendement total	2 389	(246)
17 000	31 juill. 2024	China Overseas Grand Oceans, swap sur rendement total	6 168	(205)
1 000	31 juill. 2024	Citic Ltd, swap sur rendement total	1 309	(35)
12 000	31 juill. 2024	Dongfeng Motor Grp Co Ltd, H, swap sur rendement total	4 690	(434)
8 000	31 juill. 2024	Future Land Development Hold, swap sur rendement total	1 907	(136)
3	31 juill. 2024	Great Wall Motor Company, H, swap sur rendement total	6	(1)
2 000	31 juill. 2024	Greentown China Holdings, swap sur rendement total	2 314	(340)
2 000	31 juill. 2024	Hang Lung Properties Ltd, swap sur rendement total	2 335	(90)
2	31 juill. 2024	Inspur International Ltd, swap sur rendement total	1	–

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
1 000	31 juill. 2024	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 284	(88)
2 000	31 juill. 2024	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	3 863	(86)
800	31 juill. 2024	Midea Real Estate Holding Lt, swap sur rendement total	983	285
32 004	31 juill. 2024	Mmg Ltd, swap sur rendement total	16 715	(3 337)
6 402	31 juill. 2024	Mmg Ltd, droits, swap sur rendement total	387	387
14 000	31 juill. 2024	Newborn Town Inc, swap sur rendement total	10 992	1 489
9	31 juill. 2024	Sino Biopharmaceutical, swap sur rendement total	4	–
600	31 juill. 2024	Sunny Optical Tech, swap sur rendement total	5 074	390
500	31 juill. 2024	Techtronic Industries Co Ltd, swap sur rendement total	7 903	(509)
2 000	31 juill. 2024	Weichai Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	5 237	322
1	31 juill. 2024	Xinyi Solar Holdings Ltd, swap sur rendement total	1	–
				(5 349)
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
1 055	31 juill. 2024	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	583	75
1 554	31 juill. 2024	Burstone Group Limited, swap sur rendement total	836	(12)
703	31 juill. 2024	Impala Platinum Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 782	(328)
926	31 juill. 2024	Jse Ltd, swap sur rendement total	7 546	1 106
150	31 juill. 2024	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	635	103
7 914	31 juill. 2024	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	878	34
2 156	31 juill. 2024	Ppc Ltd, swap sur rendement total	520	(24)
446	31 juill. 2024	Psg Konsult Ltd, swap sur rendement total	580	35
1 454	31 juill. 2024	The Foschini Group Ltd, swap sur rendement total	13 893	2 784
145	31 juill. 2024	Thungela Resources Ltd, swap sur rendement total	1 211	(259)
418	31 juill. 2024	Tsogo Sun Gaming Ltd, swap sur rendement total	347	12
				3 526
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
385	31 juill. 2024	Addtech Ab, actions, B, swap sur rendement total	13 103	733
188	31 juill. 2024	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	2 793	26
84	31 juill. 2024	Beijer Alma Ab, swap sur rendement total	2 247	(111)
7	31 juill. 2024	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	238	7
4	31 juill. 2024	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	87	(10)
639	31 juill. 2024	Lagercrantz Group Ab, actions, B, swap sur rendement total	14 218	(581)
154	31 juill. 2024	Lindab International Ab, swap sur rendement total	4 513	(272)
22	31 juill. 2024	Np3 Fastigheter Ab, swap sur rendement total	731	22
133	31 juill. 2024	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	2 664	187
600	31 juill. 2024	Systemair Ab, swap sur rendement total	6 093	(9)
				(8)
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
73	31 juill. 2024	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	850	(50)
13	31 juill. 2024	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	4 612	(104)
4	31 juill. 2024	Lem Holding Sa, actions ord., swap sur rendement total	8 710	(572)
47	31 juill. 2024	Thurgauer Kantonalbank- certificat, swap sur rendement total	8 696	(474)
				(1 200)
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
5 000	31 juill. 2024	Ability Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	11 431	(953)
958	31 juill. 2024	Able C&C, swap sur rendement total	9 093	(947)
837	31 juill. 2024	Ace Technologies Corp, swap sur rendement total	1 037	(489)
1 912	31 juill. 2024	Actions Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	7 963	(70)
1 000	31 juill. 2024	Advancetek Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	2 615	78
266	31 juill. 2024	Agabang&Company, swap sur rendement total	1 228	(274)
2 600	31 juill. 2024	Aishida Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 241	(336)
1 328	31 juill. 2024	Aj Networks Co Ltd, swap sur rendement total	5 801	(456)
587	31 juill. 2024	Al Rajhi Co For Co-Operative, swap sur rendement total	40 207	7 719
2 000	31 juill. 2024	Alcor Micro Corp, swap sur rendement total	13 330	(814)
1 100	31 juill. 2024	Allied Machinery Co Ltd, A, swap sur rendement total	2 976	(99)
1 000	31 juill. 2024	Alltop Technology Co Ltd, swap sur rendement total	10 461	(4)
443	31 juill. 2024	Amicogen Inc, swap sur rendement total	2 206	(832)
19	31 juill. 2024	Amorepacific Group, swap sur rendement total	611	(96)
13 000	31 juill. 2024	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	11 296	(54)
206	31 juill. 2024	Anapass Inc, swap sur rendement total	5 487	1 105
4 700	31 juill. 2024	Anhui Tongfeng Electronics, A, swap sur rendement total	4 619	29
340	31 juill. 2024	Aps Holdings Corp, swap sur rendement total	2 609	408
188	31 juill. 2024	Arriyadh Development Company, swap sur rendement total	1 466	(26)
2 000	31 juill. 2024	Asustek Computer Inc, swap sur rendement total	42 014	(1 382)
4 000	31 juill. 2024	Au Optronics Corp, swap sur rendement total	3 003	(12)
25	31 juill. 2024	Avaco Co Ltd, swap sur rendement total	454	7
3 000	31 juill. 2024	Avy Precision Technology Inc, swap sur rendement total	4 619	(336)
1 000	31 juill. 2024	Axiomtek Co Ltd, swap sur rendement total	4 239	122
15 722	31 juill. 2024	Bank Al Habib Ltd, swap sur rendement total	8 669	869

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
24 819	31 juill. 2024	Bank Alfalah Ltd, swap sur rendement total	8 298	663
2 500	31 juill. 2024	Beijing Beilu Pharmaceutic, A, swap sur rendement total	2 076	(368)
6 200	31 juill. 2024	Beijing Centergate Tech Hd, A, swap sur rendement total	4 121	(602)
11 100	31 juill. 2024	Beijing Century Real Techn, A, swap sur rendement total	5 392	(513)
640	31 juill. 2024	Beijing Seeyon Internet So, A, swap sur rendement total	1 896	(253)
800	31 juill. 2024	Beijing Zuojiang Technolog, A, swap sur rendement total	1 045	(8)
1 300	31 juill. 2024	Bgrimm Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 189	(273)
107	31 juill. 2024	Binggrae Co Ltd, swap sur rendement total	10 369	1 331
17 000	31 juill. 2024	Bingshan Refrigeration & H, A, swap sur rendement total	11 587	(1 472)
933	31 juill. 2024	Bnk Financial Group Inc, swap sur rendement total	7 855	40
800	31 juill. 2024	Bomesc Offshore Engineeri, A, swap sur rendement total	1 982	(247)
1 400	31 juill. 2024	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	6 119	(770)
9 500	31 juill. 2024	Brf Sa, swap sur rendement total	52 708	6 498
268	31 juill. 2024	Bubang Co Ltd, swap sur rendement total	573	(23)
6 222	31 juill. 2024	Byucksan Corporation, swap sur rendement total	12 523	(42)
3 700	31 juill. 2024	C&A Modas Ltda, swap sur rendement total	8 458	(842)
200	31 juill. 2024	C&D Holsin Engineering Con, A, swap sur rendement total	313	(49)
521	31 juill. 2024	Cafe24 Corp, swap sur rendement total	20 921	8 354
187	31 juill. 2024	Cap Sa, swap sur rendement total	1 607	(122)
841	31 juill. 2024	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	1 139	(145)
1 109	31 juill. 2024	Cementos Argos Sa	3 050	(183)
1 000	31 juill. 2024	Chang Wah Electromaterials, swap sur rendement total	1 996	(242)
1 000	31 juill. 2024	Cheng Mei Material Technology, swap sur rendement total	588	(55)
1 000	31 juill. 2024	Cheng Uei Precision Industry, swap sur rendement total	3 332	282
3 000	31 juill. 2024	Chia Chang Co Ltd, swap sur rendement total	5 979	110
5 000	31 juill. 2024	Chien Kuo Construction Co, swap sur rendement total	4 893	(129)
1 000	31 juill. 2024	China Ecotek Corporation, swap sur rendement total	2 982	(31)
7 000	31 juill. 2024	Chipmos Technologies Inc, swap sur rendement total	13 199	13
1 000	31 juill. 2024	Chong Hong Construction Co, swap sur rendement total	4 619	(517)
72	31 juill. 2024	Chong Kun Dang Pharma, swap sur rendement total	7 006	(448)
3 600	31 juill. 2024	Cia Brasileira De Distribuic, swap sur rendement total	2 379	(327)
223	31 juill. 2024	Cia Energetica Minas Ger, actions priv., swap sur rendement total	581	(1)
7 400	31 juill. 2024	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	39 390	360
5 500	31 juill. 2024	Cia Siderurgica Nactional Sa, swap sur rendement total	18 429	(198)
213 259	31 juill. 2024	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	18 531	(446)
2 200	31 juill. 2024	Citychamp Dartong Co Ltd, A, swap sur rendement total	725	(110)
13	31 juill. 2024	Cj Corp, swap sur rendement total	1 570	29
16	31 juill. 2024	Cj Logistics Corp, swap sur rendement total	1 512	(4)
155	31 juill. 2024	Clio Cosmetics Co Ltd, swap sur rendement total	5 908	(439)
4 000	31 juill. 2024	Cmc Magnetics Corp, swap sur rendement total	2 134	(57)
7 400	31 juill. 2024	Cogna Educacional Sa, swap sur rendement total	3 206	(401)
1 000	31 juill. 2024	Compal Electronics, swap sur rendement total	1 464	(103)
4 300	31 juill. 2024	Companhia Brasileira De Alum, swap sur rendement total	7 324	(557)
1 100	31 juill. 2024	Construtora Tenda Sa, swap sur rendement total	2 894	(348)
182	31 juill. 2024	Coreana Cosmetics Co Ltd, swap sur rendement total	583	(82)
2 100	31 juill. 2024	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	1 927	(279)
1 500	31 juill. 2024	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	6 832	(390)
4 000	31 juill. 2024	Ctci Corp, swap sur rendement total	8 943	782
200	31 juill. 2024	Cury Construtora E Incorpora, swap sur rendement total	1 057	92
85	31 juill. 2024	Daehwa Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	819	11
93	31 juill. 2024	Dae-Il Corp, swap sur rendement total	536	54
583	31 juill. 2024	Daesang Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	6 542	1 124
3 060	31 juill. 2024	Db Inc, swap sur rendement total	4 097	(53)
700	31 juill. 2024	Dexco Sa, swap sur rendement total	1 180	(121)
1 271	31 juill. 2024	Dgb Financial Group Inc, swap sur rendement total	10 132	(247)
19	31 juill. 2024	Dong-A St Co Ltd, swap sur rendement total	1 188	51
677	31 juill. 2024	Dongkuk Industries Co Ltd, swap sur rendement total	5 020	547
108	31 juill. 2024	Dongkuk Steel Mill Co Ltd, swap sur rendement total	906	34
155	31 juill. 2024	Dongwon F&B Co Ltd, swap sur rendement total	6 771	673
224	31 juill. 2024	Dongwoon Anatech Co Ltd, swap sur rendement total	4 003	(270)
61	31 juill. 2024	Doosan Bobcat Inc, swap sur rendement total	3 110	(368)
63	31 juill. 2024	Doosan Corp, swap sur rendement total	13 588	757
30	31 juill. 2024	Dtr Automotive Corp, swap sur rendement total	2 374	24
55	31 juill. 2024	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	2 206	(12)
4 000	31 juill. 2024	Dynapack International Tech, swap sur rendement total	16 772	792
247	31 juill. 2024	Ebest Investment & Securitie, swap sur rendement total	1 267	(75)
5 100	31 juill. 2024	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	8 481	(705)
2 000	31 juill. 2024	Elan Microelectronics Corp, swap sur rendement total	12 992	(798)
53 721	31 juill. 2024	Electrical Industries Co, swap sur rendement total	124 419	17 337
5 300	31 juill. 2024	Elion Energy Co Ltd, A, swap sur rendement total	379	(284)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
172	31 juill. 2024	Empresas Cmpc Sa, swap sur rendement total	443	(52)
1 564	31 juill. 2024	Enzychem Lifesciences Corp, swap sur rendement total	3 058	79
28	31 juill. 2024	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	5 201	78
4 900	31 juill. 2024	Eternit Sa, swap sur rendement total	7 308	(622)
72	31 juill. 2024	Eubiologics Co Ltd, swap sur rendement total	859	(107)
500	31 juill. 2024	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	1 964	174
225	31 juill. 2024	Eugene Investment & Securiti, swap sur rendement total	1 293	373
54	31 juill. 2024	Eugene Technology Co Ltd, swap sur rendement total	2 665	(59)
22 702	31 juill. 2024	Fauji Fertilizer Company Ltd, swap sur rendement total	18 232	2 356
310	31 juill. 2024	Fine Semitech Corp, swap sur rendement total	11 847	1 133
4 000	31 juill. 2024	Focaltech Systems Co Ltd, swap sur rendement total	14 544	(568)
3 000	31 juill. 2024	Foxsemicon Integrated Tech, swap sur rendement total	40 470	3 111
4 500	31 juill. 2024	Fras-Le Sa, swap sur rendement total	21 355	700
8 900	31 juill. 2024	Fujian Furi Electronics, A, swap sur rendement total	10 641	165
3 700	31 juill. 2024	Fujian Raynen Technology C, A, swap sur rendement total	8 959	(651)
1 500	31 juill. 2024	Gaec Educacao Sa, swap sur rendement total	1 156	(211)
3 000	31 juill. 2024	Generalplus Technology Inc, swap sur rendement total	8 251	(417)
34	31 juill. 2024	Genexine Co Ltd, swap sur rendement total	210	(30)
27 400	31 juill. 2024	Gentera Sab De Cv, swap sur rendement total	46 453	(11 988)
3 000	31 juill. 2024	Geovision Inc, swap sur rendement total	8 605	44
200	31 juill. 2024	Gerdau Sa, actions priv., swap sur rendement total	900	(20)
700	31 juill. 2024	Giti Tire Corp, A, swap sur rendement total	1 840	(77)
6 000	31 juill. 2024	Globe Union Industrial Corp, swap sur rendement total	4 885	74
2 000	31 juill. 2024	Good Will Instrument Co Ltd, swap sur rendement total	3 695	129
8 500	31 juill. 2024	Gpro Titanium Industry Co, A, swap sur rendement total	2 657	(682)
600	31 juill. 2024	Grupo Mateus Sa, swap sur rendement total	1 034	(190)
1 000	31 juill. 2024	Grupo Sbf Sa, swap sur rendement total	2 937	(109)
1 160	31 juill. 2024	G-Treebnt Co Ltd, swap sur rendement total	8 094	(1 620)
143	31 juill. 2024	Guangdong Cellwise Microel, A, swap sur rendement total	845	–
1 000	31 juill. 2024	Guangdong Delian Group Co, A, swap sur rendement total	682	(42)
2 514	31 juill. 2024	Guangdong Fangyuan New Mat, A, swap sur rendement total	1 993	(321)
5 100	31 juill. 2024	Guangdong Topstrong Living, A, swap sur rendement total	5 089	(699)
12 200	31 juill. 2024	Guangdong Xianglu Tungsten, A, swap sur rendement total	11 876	(2 882)
1 200	31 juill. 2024	Guangzhou Baiyun Electric, A, swap sur rendement total	1 891	(152)
3 300	31 juill. 2024	Guangzhou Echom Science, A, swap sur rendement total	2 833	(165)
4 700	31 juill. 2024	Guangzhou Seagull Kitchen, A, swap sur rendement total	2 168	(387)
12 300	31 juill. 2024	Guangzhou Tech-Long Packag, A, swap sur rendement total	17 671	(2 123)
9 100	31 juill. 2024	Guararapes Confeccoes Sa, swap sur rendement total	15 646	(1 985)
1 100	31 juill. 2024	Guizhou Chitianhua Co Ltd, A, swap sur rendement total	240	(95)
41 580	31 juill. 2024	Habib Bank Ltd, swap sur rendement total	25 350	1 958
13	31 juill. 2024	Haesung Ds Co Ltd, swap sur rendement total	590	(3)
310	31 juill. 2024	Handsome Co Ltd, swap sur rendement total	5 451	(64)
4 800	31 juill. 2024	Hangzhou Cable Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 959	(340)
356	31 juill. 2024	Hankook Cosmetics Manufactur, swap sur rendement total	20 452	1 078
554	31 juill. 2024	Hanmi Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	94 875	6 090
6	31 juill. 2024	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	365	20
3 293	31 juill. 2024	Hanwha General Insurance Co, swap sur rendement total	16 349	522
285	31 juill. 2024	Hanwha Investment & Securiti, swap sur rendement total	915	(2)
6 166	31 juill. 2024	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	18 386	1 235
35	31 juill. 2024	Hanyang Eng Co Ltd, swap sur rendement total	694	21
883	31 juill. 2024	Harim Co Ltd, swap sur rendement total	2 975	131
24	31 juill. 2024	Hdc Hyundai Development Co, E, swap sur rendement total	434	18
2 100	31 juill. 2024	Hefei Taihe Intelligent Te, A, swap sur rendement total	4 294	(439)
1 552	31 juill. 2024	Hillstone Networks Co Ltd, A, swap sur rendement total	3 054	(487)
2 500	31 juill. 2024	Hongda Xingye Co Ltd, A, swap sur rendement total	274	274
1 200	31 juill. 2024	Huasi Holding Co Ltd, A, swap sur rendement total	705	(106)
45 762	31 juill. 2024	Hub Power Company, swap sur rendement total	36 684	4 234
4 000	31 juill. 2024	Huida Sanitary Ware Co Ltd, A, swap sur rendement total	4 135	(698)
1 500	31 juill. 2024	Hunan Mendale Hometextile, A, swap sur rendement total	542	(118)
4	31 juill. 2024	Hyosung Tnc Co, swap sur rendement total	1 372	(220)
5	31 juill. 2024	Hyundai Electric & Energy Sy, swap sur rendement total	1 541	45
2 934	31 juill. 2024	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	13 152	(109)
145	31 juill. 2024	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	13 403	2 795
9 100	31 juill. 2024	Ife Elevators Co Ltd, A, swap sur rendement total	10 880	(578)
178	31 juill. 2024	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	2 300	(109)
8 200	31 juill. 2024	Infund Holding Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 590	(190)
5 000	31 juill. 2024	Inpaq Technology Co Ltd, swap sur rendement total	19 783	1 777
300	31 juill. 2024	Intelbras Sa Industria De Te, swap sur rendement total	1 704	(106)
255	31 juill. 2024	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	4 012	62
702	31 juill. 2024	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	2 857	(219)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
12 000	31 juill. 2024	Inventec Corp, swap sur rendement total	28 245	941
420	31 juill. 2024	Inversiones Aguas Metropol, swap sur rendement total	427	(36)
42	31 juill. 2024	Inzi Controls Co Ltd, swap sur rendement total	290	(10)
3 400	31 juill. 2024	Inzone Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	2 516	(218)
5 300	31 juill. 2024	Iochpe-Maxion S.A., swap sur rendement total	15 254	368
13	31 juill. 2024	Isc Co Ltd, swap sur rendement total	846	(68)
6 700	31 juill. 2024	Jiangsu Alcha Aluminum Gro, A, swap sur rendement total	3 419	(558)
23 300	31 juill. 2024	Jiangsu Hagong Intelligent, A, swap sur rendement total	5 045	(485)
10 700	31 juill. 2024	Jiangsu Holly Corp, A, swap sur rendement total	12 834	(1 445)
3 000	31 juill. 2024	Jiangsu Lianhuan Pharmaceu, A, swap sur rendement total	4 581	(355)
1 400	31 juill. 2024	Jiangsu Skyray Instrument, A, swap sur rendement total	559	(111)
42 800	31 juill. 2024	Jiangsu Zhongchao Holding, A, swap sur rendement total	15 715	(4 484)
11 400	31 juill. 2024	Jilin Sino-Microelectronic, A, swap sur rendement total	5 753	143
159	31 juill. 2024	Js Corp/Kr, swap sur rendement total	2 816	(306)
6 100	31 juill. 2024	Junhe Pumps Holding Co Ltd, A, swap sur rendement total	6 777	161
18	31 juill. 2024	Kc Co Ltd, swap sur rendement total	369	(11)
17	31 juill. 2024	Kc Tech Co Ltd/New, swap sur rendement total	766	134
2 162	31 juill. 2024	Kec Corp, swap sur rendement total	2 864	(278)
400	31 juill. 2024	Keeson Technology Corp Ltd, A, swap sur rendement total	744	(196)
13 000	31 juill. 2024	K-Electric Ltd, swap sur rendement total	296	(21)
13	31 juill. 2024	Kiwoom Securities Co Ltd, swap sur rendement total	1 627	(95)
530	31 juill. 2024	Koh Young Technology Inc, swap sur rendement total	6 659	(262)
126	31 juill. 2024	Komico Ltd, swap sur rendement total	10 056	(616)
36	31 juill. 2024	Korea District Heating Corp, swap sur rendement total	1 757	145
11 733	31 juill. 2024	Korea Line Corp, swap sur rendement total	33 761	6 411
322	31 juill. 2024	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	2 554	(25)
47 938	31 juill. 2024	Kot Addu Power Company Ltd, swap sur rendement total	7 802	67
7 200	31 juill. 2024	Kraussmaffei Co Ltd, A, swap sur rendement total	7 917	(60)
600	31 juill. 2024	Ktk Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	746	(117)
462	31 juill. 2024	Kumkang Kind Co Ltd, swap sur rendement total	2 282	(30)
226	31 juill. 2024	Kyeryong Const Indust Co Ltd, swap sur rendement total	3 024	(110)
7 600	31 juill. 2024	Lanpec Technologies Ltd, A, swap sur rendement total	7 083	(418)
4 154 235	31 juill. 2024	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	77 559	529
837	31 juill. 2024	Lb Semicon Inc, swap sur rendement total	5 141	(430)
165	31 juill. 2024	Lf Corp, swap sur rendement total	2 253	(202)
111	31 juill. 2024	Lg International Corp, swap sur rendement total	3 365	38
8 000	31 juill. 2024	Lida Holdings Ltd, swap sur rendement total	9 634	(157)
2 000	31 juill. 2024	Lingsen Precision Industries, swap sur rendement total	1 995	(78)
3 200	31 juill. 2024	Lionhead Technology Develo, A, swap sur rendement total	2 193	(385)
100	31 juill. 2024	Lojas Renner S.A., swap sur rendement total	309	(31)
2 000	31 juill. 2024	Long Bon International Co Lt, swap sur rendement total	2 029	25
532	31 juill. 2024	Lot Vacuum Co Ltd, swap sur rendement total	8 249	(926)
3 206	31 juill. 2024	Lotte Non-Life Insurance Co, swap sur rendement total	9 289	(647)
1 343	31 juill. 2024	Ls Cable & System Asia Ltd, swap sur rendement total	42 715	(9 183)
413	31 juill. 2024	Ls Corp, swap sur rendement total	59 070	(7 858)
126	31 juill. 2024	Ls Industrial Systems, swap sur rendement total	27 614	1 563
400	31 juill. 2024	M Dias Branco Sa, swap sur rendement total	2 871	(414)
600	31 juill. 2024	Magazine, swap sur rendement total	1 769	135
48 800	31 juill. 2024	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	75 839	(7 332)
12 100	31 juill. 2024	Marfrig Global Foods Sa, swap sur rendement total	36 602	1 109
20 802	31 juill. 2024	Masisa Sa, swap sur rendement total	561	(70)
22 642	31 juill. 2024	Mcb Bank Ltd, swap sur rendement total	25 267	2 009
1 101	31 juill. 2024	Meezan Bank Ltd, swap sur rendement total	1 296	(40)
1 000	31 juill. 2024	Mercuries & Associates Holdi, swap sur rendement total	700	(78)
966	31 juill. 2024	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	75 947	2 331
5 000	31 juill. 2024	Merry Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	29 106	2 882
8 300	31 juill. 2024	Metalurgica Gerdau Sa, swap sur rendement total	21 634	(1 575)
785	31 juill. 2024	Mico Ltd, swap sur rendement total	12 913	74
6 000	31 juill. 2024	Min Aik Technology Co Ltd, swap sur rendement total	8 466	(6)
863	31 juill. 2024	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	4 692	221
8 000	31 juill. 2024	Mitac Holdings Corp, swap sur rendement total	14 949	(1 121)
1 000	31 juill. 2024	Mrv Engenharia, swap sur rendement total	1 635	(170)
400	31 juill. 2024	Multilaser Industrial Sa, swap sur rendement total	193	(29)
1 000	31 juill. 2024	Nak Sealing Technologies Cor, swap sur rendement total	5 399	(11)
600	31 juill. 2024	Nantong Acetic Acid Chemic, A, swap sur rendement total	1 121	(159)
25	31 juill. 2024	National Co For Learning & E, swap sur rendement total	1 457	3
205	31 juill. 2024	Nepes Corp, swap sur rendement total	3 158	(331)
500	31 juill. 2024	Ningbo Water Meter Co Ltd, A, swap sur rendement total	883	(108)
936	31 juill. 2024	Noroo Paint & Coatings Co Lt, swap sur rendement total	9 080	366
283	31 juill. 2024	Optron-Tec Inc, swap sur rendement total	899	(133)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
2 500	31 juill. 2024	Pak Elektron Ltd, swap sur rendement total	304	(7)
1 000	31 juill. 2024	Pan-International Industrial, swap sur rendement total	1 689	44
1 166	31 juill. 2024	Parque Arauco S.A., swap sur rendement total	2 409	(196)
1 000	31 juill. 2024	Phison Electronics Corp, swap sur rendement total	26 026	826
8 000	31 juill. 2024	Pixart Imaging Inc, swap sur rendement total	57 368	2 027
616	31 juill. 2024	Poongsan Corp, swap sur rendement total	38 756	964
74	31 juill. 2024	Poongsan Holdings Corp, swap sur rendement total	2 012	(83)
80	31 juill. 2024	Posco Coated & Color Steel C, swap sur rendement total	3 670	100
7 900	31 juill. 2024	Positivo Tecnologia Sa, swap sur rendement total	15 177	(3 356)
4 000	31 juill. 2024	Pou Chen, swap sur rendement total	6 091	(239)
2 000	31 juill. 2024	President Securities Corp, swap sur rendement total	2 485	217
4 000	31 juill. 2024	Prince Housing & Development, swap sur rendement total	2 025	(31)
3 900	31 juill. 2024	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	4 982	(395)
46	31 juill. 2024	Psk Inc/New, swap sur rendement total	1 667	219
6 100	31 juill. 2024	Qingdao Doublestar Co Ltd, A, swap sur rendement total	4 054	(425)
5 300	31 juill. 2024	Qingdao Kingking Applied, A, swap sur rendement total	1 786	(459)
7 400	31 juill. 2024	Qingdao Topscomm Communica, A, swap sur rendement total	6 214	(532)
8 200	31 juill. 2024	Qingdao Vland Biotech Inc, swap sur rendement total	19 948	(1 960)
3 300	31 juill. 2024	Qualicorp Sa, swap sur rendement total	1 131	(287)
9 000	31 juill. 2024	Radium Life Tech Co Ltd, swap sur rendement total	4 005	(104)
700	31 juill. 2024	Raisecom Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	936	72
7 700	31 juill. 2024	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	20 578	1 388
3 000	31 juill. 2024	Realtek Semiconductor Corp, swap sur rendement total	69 095	91
14 000	31 juill. 2024	Rechi Precision Co Ltd, swap sur rendement total	18 012	896
524	31 juill. 2024	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	11 692	1 732
5 436	31 juill. 2024	Salfacorp Sa, swap sur rendement total	4 347	(88)
68	31 juill. 2024	Samhwa Paints Industrial Co, swap sur rendement total	536	(14)
478	31 juill. 2024	Samji Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	4 186	12
435	31 juill. 2024	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	7 921	(455)
461	31 juill. 2024	Samsung Heavy Industries, swap sur rendement total	4 284	91
486	31 juill. 2024	Samsung Securities Co Ltd, swap sur rendement total	19 225	1 328
2 500	31 juill. 2024	Santos Brasil Participacoes, swap sur rendement total	8 352	812
83	31 juill. 2024	Saudi Paper Manufacturing Co, swap sur rendement total	2 283	(155)
945	31 juill. 2024	Saudi Steel Pipe Co, swap sur rendement total	22 555	(2 592)
1 000	31 juill. 2024	Scientech Corp, swap sur rendement total	15 080	743
45	31 juill. 2024	Seah Steel Corp/New, swap sur rendement total	5 658	(54)
295	31 juill. 2024	Sebang Co Ltd, swap sur rendement total	4 120	581
1 319	31 juill. 2024	Segyung Hitech Co Ltd, swap sur rendement total	15 024	(144)
62	31 juill. 2024	Sejin Heavy Industries Co Lt, swap sur rendement total	619	151
54	31 juill. 2024	Seoyon E-Hwa Co Ltd, swap sur rendement total	1 154	190
6 600	31 juill. 2024	Shandong Molong Petroleum, A, swap sur rendement total	1 752	(803)
1 400	31 juill. 2024	Shanghai Huide Science & T, A, swap sur rendement total	3 540	(503)
2 800	31 juill. 2024	Shanghai Kaichuang Marine, A, swap sur rendement total	4 339	(456)
1 600	31 juill. 2024	Shanghai Smith Adhesive Ne, A, swap sur rendement total	2 392	(166)
9 300	31 juill. 2024	Shanghai Yaohua Pilkington, A, swap sur rendement total	7 390	(1 041)
40	31 juill. 2024	Shanghai Zhenhua Heavy Ind, A, swap sur rendement total	26	(2)
200	31 juill. 2024	Shanxi Antai Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	59	(14)
10 100	31 juill. 2024	Shenyang Huitian Thermal, A, swap sur rendement total	5 857	(70)
3 200	31 juill. 2024	Shenyang Jinshan Energy Co, A, swap sur rendement total	1 633	(128)
1 015	31 juill. 2024	Shenzhen Kiwi Instruments, A, swap sur rendement total	5 747	132
1 100	31 juill. 2024	Shenzhen Sunxing Light All, A, swap sur rendement total	1 854	(354)
1 000	31 juill. 2024	Shih Wei Navigation Co Ltd, swap sur rendement total	892	(88)
358	31 juill. 2024	Shindaeyang Paper Co Ltd, swap sur rendement total	2 110	(78)
398	31 juill. 2024	Shinsegae Information & Comm, swap sur rendement total	4 102	(251)
3 921	31 juill. 2024	Shinsung Tongsang Co Ltd, swap sur rendement total	8 886	1 651
2 700	31 juill. 2024	Shouhang High-Tech Energy, A, swap sur rendement total	188	(278)
200	31 juill. 2024	Sichuan Langsha Holding Co, A, swap sur rendement total	447	(56)
2 598	31 juill. 2024	Signetics Corp, swap sur rendement total	3 494	(236)
7 000	31 juill. 2024	Sigurd Microelectronics Corp, swap sur rendement total	23 444	(145)
7	31 juill. 2024	Silicon Works Co Ltd, swap sur rendement total	566	72
254	31 juill. 2024	Silla Co Ltd, swap sur rendement total	2 999	309
20	31 juill. 2024	Simmtech Co Ltd, swap sur rendement total	716	12
9	31 juill. 2024	Sindoh Co Ltd, swap sur rendement total	339	2
777	31 juill. 2024	Sk Hynix Inc, swap sur rendement total	182 646	36 919
25 880	31 juill. 2024	Smu Sa, swap sur rendement total	6 209	(771)
3 015	31 juill. 2024	Sonda Sa, swap sur rendement total	1 821	(98)
2 000	31 juill. 2024	Sonix Technology Co Ltd, swap sur rendement total	4 336	(183)
3	31 juill. 2024	Soulbrain Co Ltd/New, swap sur rendement total	866	(94)
157	31 juill. 2024	Sun Kwang Co Ltd, swap sur rendement total	2 714	25
17 000	31 juill. 2024	Sunplus Technology Co Ltd, swap sur rendement total	25 959	(217)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
600	31 juill. 2024	Sunsea Aiot Technology Co, A, swap sur rendement total	773	7
2 000	31 juill. 2024	Sunspring Metal Corp, swap sur rendement total	2 354	(140)
2 600	31 juill. 2024	Suzhou Keda Technology Co, A, swap sur rendement total	2 673	(182)
2 600	31 juill. 2024	Suzhou Kelida Building & D, A, swap sur rendement total	710	(48)
3 500	31 juill. 2024	Suzhou Longjie Special Fib, A, swap sur rendement total	4 857	(529)
234	31 juill. 2024	Suzhou Mingzhi Technology, A, swap sur rendement total	591	(78)
1 000	31 juill. 2024	Swancor Holding Co Ltd, swap sur rendement total	5 821	405
2 000	31 juill. 2024	Syncmold Enterprise Corp, swap sur rendement total	9 111	(151)
1 000	31 juill. 2024	T3Ex Global Holdings Corp, swap sur rendement total	4 260	(445)
1	31 juill. 2024	Taekwang Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	621	(20)
836	31 juill. 2024	Tailim Packaging Co Ltd, swap sur rendement total	2 102	(52)
6 000	31 juill. 2024	Taiwan Navigation Co Ltd, swap sur rendement total	9 630	120
1 148	31 juill. 2024	The National Agriculture Dev, swap sur rendement total	13 336	856
197	31 juill. 2024	Thinkon Semiconductor Jinz, A, swap sur rendement total	715	(60)
18	31 juill. 2024	Timah Tbk Pt, swap sur rendement total	1	–
712	31 juill. 2024	Tongyang Life Insurance, swap sur rendement total	5 534	1 999
141	31 juill. 2024	Tonymoly Co Ltd, swap sur rendement total	1 658	113
4 400	31 juill. 2024	Topscore Fashion Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 947	(163)
1 000	31 juill. 2024	Tripod Technology Corp, swap sur rendement total	9 217	248
82	31 juill. 2024	Tse Co Ltd, swap sur rendement total	4 898	297
1 000	31 juill. 2024	Turvo International Co Ltd, swap sur rendement total	6 053	483
1 000	31 juill. 2024	Txc Corp, swap sur rendement total	5 041	234
4 000	31 juill. 2024	U-Ming Marine Transport Corp, swap sur rendement total	9 820	(127)
13	31 juill. 2024	Unid Co Ltd, swap sur rendement total	1 311	(107)
11 710	31 juill. 2024	United Bank Ltd, swap sur rendement total	14 749	1 858
4 600	31 juill. 2024	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	17 135	(1 933)
1 000	31 juill. 2024	Via Labs Inc, swap sur rendement total	8 352	(128)
100	31 juill. 2024	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	362	(25)
1 000	31 juill. 2024	Wah Lee Industrial Corp, swap sur rendement total	5 990	722
8 000	31 juill. 2024	Walton Advanced Engineering, swap sur rendement total	6 985	389
2 000	31 juill. 2024	Wan Hai Lines Ltd, swap sur rendement total	7 601	862
1 100	31 juill. 2024	Warom Technology Inc Co, A, swap sur rendement total	4 579	(65)
700	31 juill. 2024	Weichai Heavy Machinery Co, A, swap sur rendement total	1 053	(83)
8 000	31 juill. 2024	Wisdom Marine Lines Co Ltd, swap sur rendement total	23 875	(2 408)
400	31 juill. 2024	Wisol Co Ltd, swap sur rendement total	3 193	(34)
11 300	31 juill. 2024	Wiz Co, swap sur rendement total	16 526	(1 085)
253	31 juill. 2024	Wonik Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	857	(35)
1 440	31 juill. 2024	Wooree Bio Co Ltd, swap sur rendement total	4 215	33
1 000	31 juill. 2024	Wpg Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 788	143
9 000	31 juill. 2024	Wt Microelectronics Co Ltd, swap sur rendement total	47 075	3 111
600	31 juill. 2024	Wuhu Conch Profiles & Sci, A, swap sur rendement total	456	(83)
1 026	31 juill. 2024	Wuxi Chipown Micro-Electro, A, swap sur rendement total	7 026	149
1 300	31 juill. 2024	Wuxi Xuelang Environmental, A, swap sur rendement total	825	(171)
700	31 juill. 2024	Xinjiang Torch Gas Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 774	(129)
8 000	31 juill. 2024	Yang Ming Marine Transport, swap sur rendement total	25 174	991
2 000	31 juill. 2024	Yangmei Chemical Co Ltd, A, swap sur rendement total	644	(81)
44	31 juill. 2024	Yas Co Ltd/Korea, swap sur rendement total	473	(19)
668	31 juill. 2024	Yest Co Ltd, swap sur rendement total	12 768	1 041
3 200	31 juill. 2024	Ylz Information Technology, A, swap sur rendement total	1 217	(126)
1 000	31 juill. 2024	Youngtek Electronics Corp, swap sur rendement total	3 345	251
1 300	31 juill. 2024	Yuancheng Cable Co Ltd, A, swap sur rendement total	820	(79)
1 948	31 juill. 2024	Yuanta Securities Korea, swap sur rendement total	5 605	325
1 000	31 juill. 2024	Yungshim Construction, swap sur rendement total	9 048	420
125	31 juill. 2024	Zamil Industrial Investment, swap sur rendement total	1 101	99
10 500	31 juill. 2024	Zamp Sa, swap sur rendement total	9 611	945
1 418	31 juill. 2024	Zeus Co Ltd, swap sur rendement total	24 749	333
2 300	31 juill. 2024	Zhejiang Aokang Shoes Co L, A, swap sur rendement total	1 975	(221)
1 600	31 juill. 2024	Zhejiang Canaan Technology, A, swap sur rendement total	868	(158)
1 200	31 juill. 2024	Zhejiang Dibay Electric Co, A, swap sur rendement total	3 195	25
600	31 juill. 2024	Zhejiang Jasan Holding Gro, A, swap sur rendement total	1 124	(115)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		46 983
				(32 500)
Swaps d'actions – position acheteur				
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	(614)	2
(220)	31 juill. 2024	Ab Dynamics Plc, swap sur rendement total	(7 801)	642
(1 529)	31 juill. 2024	Aviva Plc, swap sur rendement total	(12 605)	113
(1 402)	31 juill. 2024	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(412)	23

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(72)	31 juill. 2024	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(262)	(9)
(753)	31 juill. 2024	Bunzl Plc, swap sur rendement total	(39 857)	(1 411)
(2 125)	31 juill. 2024	C&C Group Plc, swap sur rendement total	(5 837)	315
(357)	31 juill. 2024	Cairn Energy Plc, swap sur rendement total	(1 093)	87
(400)	31 juill. 2024	Crest Nicholson Holdings, swap sur rendement total	(1 662)	(18)
(1 605)	31 juill. 2024	Croda International Plc, swap sur rendement total	(109 605)	16 878
(73)	31 juill. 2024	Dcc Plc, swap sur rendement total	(7 164)	32
(2 301)	31 juill. 2024	De La Rue Plc, swap sur rendement total	(3 813)	37
(321)	31 juill. 2024	Diageo Plc, swap sur rendement total	(13 823)	836
(622)	31 juill. 2024	Ekf Diagnostics Holdings Plc, swap sur rendement total	(309)	41
(1 261)	31 juill. 2024	Energean Plc, swap sur rendement total	(21 507)	4 567
(904)	31 juill. 2024	Essentra Plc, swap sur rendement total	(2 521)	69
(27)	31 juill. 2024	First Derivatives Plc, swap sur rendement total	(665)	(23)
(336)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(84 069)	2 829
(789)	31 juill. 2024	Future Plc, swap sur rendement total	(14 316)	203
(11)	31 juill. 2024	Games Workshop Group Plc, swap sur rendement total	(2 030)	(115)
(20)	31 juill. 2024	Gamma Communications Plc, swap sur rendement total	(488)	16
(700)	31 juill. 2024	Globaldata Plc, swap sur rendement total	(2 640)	36
(2 768)	31 juill. 2024	Grainger Plc, swap sur rendement total	(11 780)	234
(9 800)	31 juill. 2024	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(1 187)	187
(6 747)	31 juill. 2024	Gym Group Plc/The, swap sur rendement total	(12 884)	1 942
(30 774)	31 juill. 2024	Haleon Plc, swap sur rendement total	(171 722)	2 030
(100)	31 juill. 2024	Hargreaves Services Plc, swap sur rendement total	(924)	48
(27)	31 juill. 2024	Headlam Group Plc, swap sur rendement total	(64)	10
(2 150)	31 juill. 2024	Helical Plc, swap sur rendement total	(9 271)	(842)
(88)	31 juill. 2024	Hikma Pharmaceuticals Plc, swap sur rendement total	(2 878)	71
(146)	31 juill. 2024	Hilton Food Group Plc, swap sur rendement total	(2 270)	(4)
(122)	31 juill. 2024	Indivior Plc, swap sur rendement total	(2 617)	410
(6 722)	31 juill. 2024	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(5 395)	1 884
(51)	31 juill. 2024	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(281)	(8)
(3 534)	31 juill. 2024	John Wood Group Plc, swap sur rendement total	(12 605)	(1 752)
(21)	31 juill. 2024	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	(840)	(28)
(315)	31 juill. 2024	Learning Technologies Group, swap sur rendement total	(460)	4
(1 788)	31 juill. 2024	M&G Plc, swap sur rendement total	(6 309)	(122)
(50)	31 juill. 2024	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(707)	65
(2 089)	31 juill. 2024	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(10 439)	2 927
(58)	31 juill. 2024	Pagegroup Plc, swap sur rendement total	(427)	33
(14 924)	31 juill. 2024	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(134 623)	(5 995)
(629)	31 juill. 2024	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(1 714)	33
(362)	31 juill. 2024	Primary Health Properties, swap sur rendement total	(575)	11
(4 311)	31 juill. 2024	Quilter Plc, swap sur rendement total	(8 956)	(141)
(1 188)	31 juill. 2024	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(336)	129
(1 017)	31 juill. 2024	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(8 113)	(700)
(412)	31 juill. 2024	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(1 356)	(111)
(1 939)	31 juill. 2024	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(1 415)	361
(120)	31 juill. 2024	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	(17 602)	881
(101)	31 juill. 2024	Spire Healthcare Group Plc, swap sur rendement total	(411)	31
(2 397)	31 juill. 2024	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(22 659)	(1 858)
(503)	31 juill. 2024	Strix Group Plc, swap sur rendement total	(730)	(42)
(2 427)	31 juill. 2024	Supermarket Income Reit Plc, swap sur rendement total	(3 044)	108
(1 227)	31 juill. 2024	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(12 966)	1 738
(6 427)	31 juill. 2024	Thg Plc, swap sur rendement total	(6 915)	794
(200)	31 juill. 2024	Treatt Plc, swap sur rendement total	(1 486)	251
(841)	31 juill. 2024	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(8 641)	(824)
				26 905
Euro – taux à court terme (€STR)				
(15 828)	31 juill. 2024	Aegon Nv, swap sur rendement total	(137 602)	723
(485)	31 juill. 2024	Agfa-Gevaert Nv, swap sur rendement total	(792)	68
(412)	31 juill. 2024	Airbus Se, swap sur rendement total	(77 496)	16 249
(370)	31 juill. 2024	Alfen Nv, swap sur rendement total	(9 366)	10 309
(41)	31 juill. 2024	Altarea, swap sur rendement total	(5 093)	1 358
(45)	31 juill. 2024	Amg Advanced Metallurgical, swap sur rendement total	(1 018)	321
(1 161)	31 juill. 2024	Amper Sa, swap sur rendement total	(164)	31
(78)	31 juill. 2024	Basic-Fit Nv, swap sur rendement total	(2 302)	279
(57)	31 juill. 2024	BioMérieux, swap sur rendement total	(7 419)	677
(801)	31 juill. 2024	Bpost Sa, swap sur rendement total	(3 553)	386
(300)	31 juill. 2024	Carmila, swap sur rendement total	(6 881)	884
(1 801)	31 juill. 2024	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(80 214)	8 142
(385)	31 juill. 2024	Corticeira Amorim Sa, swap sur rendement total	(5 087)	336

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(939)	31 juill. 2024	Dalata Hotel Group Plc, swap sur rendement total	(5 481)	323
(1 044)	31 juill. 2024	Dassault Systèmes Sa, swap sur rendement total	(54 046)	2 574
(7)	31 juill. 2024	Elia Group Sa/Nv, swap sur rendement total	(898)	64
(201)	31 juill. 2024	Forfarmers Nv, swap sur rendement total	(794)	15
(9)	31 juill. 2024	Heineken Holding Nv, swap sur rendement total	(972)	22
(1 638)	31 juill. 2024	Heineken Nv, swap sur rendement total	(216 916)	4 396
(197)	31 juill. 2024	Icade, swap sur rendement total	(6 628)	1 579
(57)	31 juill. 2024	Kaufman & Broad Sa, swap sur rendement total	(2 140)	626
(594)	31 juill. 2024	Kerry Group Plc, A, swap sur rendement total	(65 900)	2 027
(103)	31 juill. 2024	Kinepolis, swap sur rendement total	(5 143)	504
(134)	31 juill. 2024	Lectra, swap sur rendement total	(5 414)	724
(598)	31 juill. 2024	M6-Métropole Télévision, swap sur rendement total	(10 296)	876
(187)	31 juill. 2024	Maisons Du Monde Sa, swap sur rendement total	(1 111)	332
(250)	31 juill. 2024	Manitou Bf, swap sur rendement total	(7 626)	2 561
(31)	31 juill. 2024	Mayr-Melnhof Karton Ag, swap sur rendement total	(5 110)	104
(692)	31 juill. 2024	Mercialys, swap sur rendement total	(10 483)	1 307
(187)	31 juill. 2024	Navigator Co Sa/The, swap sur rendement total	(1 066)	33
(18)	31 juill. 2024	Orange Belgium, swap sur rendement total	(394)	(1)
(1 939)	31 juill. 2024	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(2 571)	145
(1 006)	31 juill. 2024	Orion Oyj, cat. B, swap sur rendement total	(58 807)	(3 280)
(431)	31 juill. 2024	Pluxee France Sa, swap sur rendement total	(16 557)	(16 557)
(309)	31 juill. 2024	Porsche Automobil Hldg, actions priv., swap sur rendement total	(19 128)	3 760
(56)	31 juill. 2024	Publicis Groupe, swap sur rendement total	(8 162)	261
(190)	31 juill. 2024	Raisio Oyj, actions, V, swap sur rendement total	(531)	12
(413)	31 juill. 2024	Recticel, swap sur rendement total	(7 523)	834
(430)	31 juill. 2024	Shell Plc, swap sur rendement total	(21 185)	(192)
(200)	31 juill. 2024	Sligro Food Group Nv, swap sur rendement total	(3 790)	256
(12)	31 juill. 2024	Sma Solar Technology Ag, swap sur rendement total	(464)	166
(105)	31 juill. 2024	Soltec Power Holdings Sa, swap sur rendement total	(332)	27
(568)	31 juill. 2024	Technip Energies Nv, swap sur rendement total	(17 443)	1 005
(121)	31 juill. 2024	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(1 526)	56
(2)	31 juill. 2024	Vib Vermoegen Ag, swap sur rendement total	(26)	4
(652)	31 juill. 2024	Voltalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(8 271)	2 243
(186)	31 juill. 2024	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(4 364)	584
				47 153
Dollar de Hong Kong – taux interbancaifre offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(4 000)	31 juill. 2024	Ak Medical Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 053)	467
(24 000)	31 juill. 2024	Akeso Inc, swap sur rendement total	(158 788)	24 639
(37 000)	31 juill. 2024	Anhui Conch Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(127 337)	(2 262)
(3 100)	31 juill. 2024	Ascentage Pharma Group Inter, swap sur rendement total	(13 882)	(3 938)
(26 000)	31 juill. 2024	Beijing Capital Intl Airpo, H, swap sur rendement total	(11 757)	352
(6 000)	31 juill. 2024	Beijing Enterprises Water Gr, swap sur rendement total	(2 615)	8
(3 000)	31 juill. 2024	Canvest Environmental Protec, swap sur rendement total	(2 225)	(157)
(2 000)	31 juill. 2024	Cathay Pacific Airways, swap sur rendement total	(2 801)	27
(7 000)	31 juill. 2024	China Conch Venture Holdings, swap sur rendement total	(8 931)	(1 450)
(31 000)	31 juill. 2024	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	(19 614)	1 476
(2 600)	31 juill. 2024	China International Marine, H, swap sur rendement total	(3 208)	312
(2 000)	31 juill. 2024	China Meidong Auto Holdings, swap sur rendement total	(749)	136
(50 000)	31 juill. 2024	China Petroleum & Chemical, H, swap sur rendement total	(44 342)	(1 314)
(900)	31 juill. 2024	China Resources Gas Group Lt, swap sur rendement total	(4 473)	(177)
(500)	31 juill. 2024	China Resources Medical Hold, swap sur rendement total	(315)	21
(1 500)	31 juill. 2024	China Resources Pharmaceutic, swap sur rendement total	(1 566)	(39)
(2 000)	31 juill. 2024	China Shenhua Energy Co, H, swap sur rendement total	(13 452)	314
(10 000)	31 juill. 2024	China Tower Corp Ltd, H, swap sur rendement total	(1 770)	(153)
(6 006)	31 juill. 2024	China Traditional Chinese Me, swap sur rendement total	(3 821)	587
(8 000)	31 juill. 2024	Citic Telecom International, swap sur rendement total	(3 674)	(72)
(6 000)	31 juill. 2024	Ck Asset Holdings Ltd, swap sur rendement total	(30 759)	1 779
(2 000)	31 juill. 2024	Cofco Joycome Foods Ltd, swap sur rendement total	(582)	89
(14 000)	31 juill. 2024	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(29 220)	6 172
(2 000)	31 juill. 2024	Fosun International Ltd, swap sur rendement total	(1 486)	61
(6 000)	31 juill. 2024	Fu Shou Yuan International, swap sur rendement total	(5 132)	290
(47 800)	31 juill. 2024	Ganfeng Lithium Co Ltd, H, swap sur rendement total	(134 707)	40 647
(48 000)	31 juill. 2024	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(125 045)	19 784
(9 600)	31 juill. 2024	Haitong Securities Co Ltd, H, swap sur rendement total	(6 288)	243
(5 900)	31 juill. 2024	Hangzhou Tigermed Consulti, H, swap sur rendement total	(29 173)	4 944
(500)	31 juill. 2024	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(2 086)	306
(19 000)	31 juill. 2024	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(8 192)	394
(4 000)	31 juill. 2024	Hkt Trust And Hkt Ltd, titres agrafés, swap sur rendement total	(6 141)	152
(300)	31 juill. 2024	Huaxin Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(427)	(6)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(2 400)	31 juill. 2024	Hygeia Healthcare Holdings C, swap sur rendement total	(11 841)	1 859
(6 000)	31 juill. 2024	Jiumaojiu International Hold, swap sur rendement total	(4 417)	258
(2 000)	31 juill. 2024	Lifetech Scientific Corp, swap sur rendement total	(487)	102
(300)	31 juill. 2024	Livzon Pharmaceutical Grou, H, swap sur rendement total	(1 351)	47
(250)	31 juill. 2024	L'Occitane International Sa, swap sur rendement total	(1 455)	(26)
(2 000)	31 juill. 2024	Melco International Develop., swap sur rendement total	(1 840)	326
(1 000)	31 juill. 2024	Nayuki Holdings Ltd, swap sur rendement total	(361)	71
(7 200)	31 juill. 2024	Nongfu Spring Co Ltd, H, swap sur rendement total	(47 774)	4 878
(23 000)	31 juill. 2024	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(15 761)	821
(4 000)	31 juill. 2024	Picc Property & Casualty, H, swap sur rendement total	(6 800)	319
(100)	31 juill. 2024	Prada S.P.A., swap sur rendement total	(1 024)	111
(49 600)	31 juill. 2024	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(141 523)	20 238
(2 000)	31 juill. 2024	Sany Heavy Equipment Intl, swap sur rendement total	(1 704)	394
(8 250)	31 juill. 2024	Shandong Gold Mining Co Lt, H, swap sur rendement total	(22 688)	1 033
(200)	31 juill. 2024	Shanghai Junshi Bioscience, H, swap sur rendement total	(410)	24
(13 300)	31 juill. 2024	Shanghai Pharmaceuticals, H, swap sur rendement total	(27 366)	(235)
(2 000)	31 juill. 2024	Sino Land Co, swap sur rendement total	(2 822)	95
(26 400)	31 juill. 2024	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(100 342)	(1 879)
(12 000)	31 juill. 2024	Sjm Holdings Ltd, swap sur rendement total	(5 573)	438
(21 000)	31 juill. 2024	Smoore International Holding, swap sur rendement total	(34 855)	(2 734)
(1 500)	31 juill. 2024	Sun Art Retail Group Ltd, swap sur rendement total	(392)	59
(22 000)	31 juill. 2024	Travelsky Technology Ltd, H, swap sur rendement total	(35 982)	3 718
(6 000)	31 juill. 2024	Tsingtao Brewery Co Ltd, H, swap sur rendement total	(54 787)	3 437
(1 000)	31 juill. 2024	Union Medical Healthcare Ltd, swap sur rendement total	(212)	55
(4 000)	31 juill. 2024	Vobile Group Ltd, swap sur rendement total	(876)	10
(5 000)	31 juill. 2024	Want Want China Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 136)	6
(4 000)	31 juill. 2024	Wharf Holdings Ltd, swap sur rendement total	(15 388)	850
(312 000)	31 juill. 2024	Wheelock & Co Ltd, swap sur rendement total	(72 180)	339
(14 700)	31 juill. 2024	Wuxi Apptec Co Ltd, H, swap sur rendement total	(77 975)	10 002
(53 000)	31 juill. 2024	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	(107 194)	(312)
(9 200)	31 juill. 2024	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(10 319)	1 528
(6 500)	31 juill. 2024	Xiabuxiabu Catering Manageme, swap sur rendement total	(1 561)	471
(500)	31 juill. 2024	Yangtze Optical Fibre And, H, swap sur rendement total	(728)	19
(4 500)	31 juill. 2024	Zhaojin Mining Industry, H, swap sur rendement total	(10 332)	175
(1 000)	31 juill. 2024	Zhou Hei Ya International Ho, swap sur rendement total	(303)	11
				140 140
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(52)	31 juill. 2024	Lighthouse Properties Plc, swap sur rendement total	(31)	–
				–
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(324)	31 juill. 2024	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(8 603)	(183)
(449)	31 juill. 2024	Axfood Ab, swap sur rendement total	(16 151)	64
(603)	31 juill. 2024	Billerudkorsnas Ab, swap sur rendement total	(7 643)	557
(368)	31 juill. 2024	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	(10 879)	577
(413)	31 juill. 2024	Cellavision Ab, swap sur rendement total	(13 368)	623
(906)	31 juill. 2024	Corem Property Group, actions, B, swap sur rendement total	(1 024)	83
(19 668)	31 juill. 2024	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(59 186)	7 184
(40)	31 juill. 2024	Epiroc Ab, A, swap sur rendement total	(1 093)	35
(378)	31 juill. 2024	Garo Ab, swap sur rendement total	(1 306)	247
(546)	31 juill. 2024	Getinge Ab, actions, B, swap sur rendement total	(12 702)	512
(1 034)	31 juill. 2024	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	(6 800)	(748)
(37)	31 juill. 2024	Hms Networks Ab, swap sur rendement total	(2 010)	167
(142)	31 juill. 2024	Investment Ab Latour, actions, B, swap sur rendement total	(5 251)	121
(722)	31 juill. 2024	Jm Ab, swap sur rendement total	(18 481)	466
(544)	31 juill. 2024	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(1 413)	37
(100)	31 juill. 2024	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(4 522)	(111)
(132)	31 juill. 2024	Mips Ab, swap sur rendement total	(7 078)	237
(1 695)	31 juill. 2024	Nolato Ab, actions, B, swap sur rendement total	(12 593)	1 054
(688)	31 juill. 2024	Ox2 Ab, swap sur rendement total	(5 285)	29
(1 740)	31 juill. 2024	Pandox Ab, swap sur rendement total	(42 492)	242
(154)	31 juill. 2024	Peab Ab, cat. B, swap sur rendement total	(1 326)	37
(383)	31 juill. 2024	Polestar Automotive, droits de tirage spéciaux, swap sur rendement total	(3)	(3)
(342)	31 juill. 2024	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(1 300)	486
(11 467)	31 juill. 2024	Sinch Ab, swap sur rendement total	(38 078)	(3 810)
(406)	31 juill. 2024	Skistar Ab, swap sur rendement total	(7 785)	694
(141)	31 juill. 2024	Troax Group Ab, swap sur rendement total	(4 318)	237
(650)	31 juill. 2024	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(14 639)	888
(1 787)	31 juill. 2024	Volvo Car Ab, actions nominatives, swap sur rendement total	(520)	2
(988)	31 juill. 2024	Volvo Car Ab, B, swap sur rendement total	(4 185)	297

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(3 033)	31 juill. 2024	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(19 732)	561
				10 582
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(420)	31 juill. 2024	Avolta Ag, swap sur rendement total	(22 321)	1 079
(19)	31 juill. 2024	Barry Callebaut Ag, actions ord., swap sur rendement total	(42 357)	2 987
(10)	31 juill. 2024	Bystronic Ag, swap sur rendement total	(5 764)	981
(391)	31 juill. 2024	Cie Financière Richemont, actions ord., swap sur rendement total	(83 505)	2 409
(19)	31 juill. 2024	Daetwyler Holding Ag, actions au porteur, swap sur rendement total	(4 884)	498
(19)	31 juill. 2024	Komax Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(3 773)	788
(1)	31 juill. 2024	Medacta Group Sa, swap sur rendement total	(186)	2
(502)	31 juill. 2024	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(12 919)	242
(115)	31 juill. 2024	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(19 491)	641
				9 627
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(2 715)	31 juill. 2024	10X Genomics Inc, cat. A, swap sur rendement total	(72 258)	10 141
(8 200)	31 juill. 2024	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(55 921)	4 363
(1 427)	31 juill. 2024	89Bio Inc, swap sur rendement total	(15 641)	(158)
(72)	31 juill. 2024	Aar Corp, swap sur rendement total	(7 162)	(129)
(395)	31 juill. 2024	Abdul Mohsen Al-Hokair Touri, swap sur rendement total	(377)	(14)
(785)	31 juill. 2024	Acm Research Inc, cat. A, swap sur rendement total	(24 770)	(1 349)
(68)	31 juill. 2024	Actinium Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(689)	71
(286)	31 juill. 2024	Acwa Power Co, swap sur rendement total	(36 947)	3 375
(295)	31 juill. 2024	Adapthealth Corp, swap sur rendement total	(4 037)	(187)
(1 581)	31 juill. 2024	Adaptive Biotechnologies, swap sur rendement total	(7 831)	(335)
(934)	31 juill. 2024	Adt Inc, swap sur rendement total	(9 783)	(314)
(289)	31 juill. 2024	Adtran Inc, swap sur rendement total	(2 080)	18
(150)	31 juill. 2024	Advanced Micro Devices, swap sur rendement total	(33 294)	(684)
(761)	31 juill. 2024	Advanced Petrochemicals Co, swap sur rendement total	(10 700)	345
(45)	31 juill. 2024	Aehr Test Systems, swap sur rendement total	(688)	44
(809)	31 juill. 2024	Aemetis Inc, swap sur rendement total	(3 332)	494
(470)	31 juill. 2024	Aerovironment Inc, swap sur rendement total	(117 152)	13 557
(494)	31 juill. 2024	Aersale Corp, swap sur rendement total	(4 678)	459
(2 794)	31 juill. 2024	Agilon Health Inc, swap sur rendement total	(25 004)	(537)
(386)	31 juill. 2024	Air Products & Chemicals Inc, swap sur rendement total	(136 298)	7 729
(67)	31 juill. 2024	Akamai Technologies Inc, swap sur rendement total	(8 258)	(84)
(2)	31 juill. 2024	Al Masane Al Kobra Mining Co, swap sur rendement total	(47)	(1)
(29)	31 juill. 2024	Al Moammar Information Syste, swap sur rendement total	(1 768)	(231)
(274)	31 juill. 2024	Albemarle Corp, swap sur rendement total	(35 963)	1 290
(23)	31 juill. 2024	Aldrees Petroleum And Transp, swap sur rendement total	(1 025)	(84)
(72)	31 juill. 2024	Alexandria Real Estate Equit, swap sur rendement total	(11 652)	176
(73)	31 juill. 2024	Align Technology Inc, swap sur rendement total	(24 116)	1 181
(577)	31 juill. 2024	Allegiant Travel Co, swap sur rendement total	(39 658)	2 143
(331)	31 juill. 2024	Allegro Microsystems Inc, swap sur rendement total	(12 791)	421
(3 727)	31 juill. 2024	Allegro.Eu Sa, swap sur rendement total	(47 765)	1 391
(35)	31 juill. 2024	Alteogen Inc, swap sur rendement total	(9 758)	(3 308)
(1 209)	31 juill. 2024	Altice Usa Inc, A, swap sur rendement total	(3 375)	729
(533)	31 juill. 2024	Altus Power Inc, swap sur rendement total	(2 859)	107
(3 207)	31 juill. 2024	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(24 181)	243
(100)	31 juill. 2024	Ambipar Participacoes E Empr, swap sur rendement total	(316)	(104)
(5 511)	31 juill. 2024	Amc Entertainment Hlds, cat. A, swap sur rendement total	(37 554)	(4 781)
(1 408)	31 juill. 2024	Ameresco Inc, cat. A, swap sur rendement total	(55 506)	13 449
(5 624)	31 juill. 2024	America Movil, CAAÉ parrainé, cat. L, swap sur rendement total	(130 825)	12 888
(93)	31 juill. 2024	Amplitude Inc, cat. A, swap sur rendement total	(1 133)	(23)
(190)	31 juill. 2024	Andersons Inc/The, swap sur rendement total	(12 895)	716
(238)	31 juill. 2024	Anglogold Ashanti, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(8 184)	(716)
(630)	31 juill. 2024	Anheuser-Busch Inbev, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(50 129)	1 615
(23)	31 juill. 2024	Aon Plc, swap sur rendement total	(9 240)	(128)
(248)	31 juill. 2024	Apache Corp, swap sur rendement total	(9 990)	(230)
(1 608)	31 juill. 2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(84 404)	3 011
(1 875)	31 juill. 2024	Api Group Corp, swap sur rendement total	(96 546)	(4 002)
(1 393)	31 juill. 2024	Applied Digital Corp, swap sur rendement total	(11 341)	(2 419)
(560)	31 juill. 2024	Applied Materials Inc, swap sur rendement total	(180 833)	(232)
(2 624)	31 juill. 2024	Applovin Corp, cat. A, swap sur rendement total	(298 806)	(12 288)
(358)	31 juill. 2024	Aptargroup Inc, swap sur rendement total	(68 978)	3 619
(664)	31 juill. 2024	Aptiv Plc, swap sur rendement total	(63 983)	4 262
(577)	31 juill. 2024	Arabian Internet & Communica, swap sur rendement total	(61 535)	(5 041)
(300)	31 juill. 2024	Arca Continental Sab De Cv, swap sur rendement total	(4 023)	293
(40)	31 juill. 2024	Arcbest Corp, swap sur rendement total	(5 861)	(63)
(7 459)	31 juill. 2024	Arcutis Biotherapeutics Inc, swap sur rendement total	(94 921)	(9 457)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(1 478)	31 juill. 2024	Ardelyx Inc, swap sur rendement total	(14 986)	(2 655)
(471)	31 juill. 2024	Argenx Se, CAAÉ, swap sur rendement total	(277 158)	(37 136)
(1 634)	31 juill. 2024	Armour Residential Reit Inc, swap sur rendement total	(43 331)	65
(4 884)	31 juill. 2024	Array Technologies Inc, swap sur rendement total	(68 568)	23 736
(623)	31 juill. 2024	Arrowhead Pharmaceuticals In, swap sur rendement total	(22 156)	(1 793)
(318)	31 juill. 2024	Ars Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(3 703)	176
(1 452)	31 juill. 2024	Arvinas Inc, swap sur rendement total	(52 890)	7 867
(9)	31 juill. 2024	Asbury Automotive Group, swap sur rendement total	(2 806)	98
(585)	31 juill. 2024	Ash-Sharqiyah Development Co, swap sur rendement total	(4 195)	282
(23)	31 juill. 2024	Astrana Health Inc, swap sur rendement total	(1 277)	32
(2 909)	31 juill. 2024	Astrazeneca Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(310 442)	3 073
(69)	31 juill. 2024	Astria Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(859)	38
(38)	31 juill. 2024	Asure Software Inc, swap sur rendement total	(437)	(38)
(532)	31 juill. 2024	Aurinia Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(4 157)	(186)
(3 922)	31 juill. 2024	Aurora Innovation Inc, swap sur rendement total	(14 866)	(1 991)
(204)	31 juill. 2024	Autonation Inc, swap sur rendement total	(44 490)	3 207
(61)	31 juill. 2024	Avalonbay Communities Inc, swap sur rendement total	(17 411)	(530)
(313)	31 juill. 2024	Avis Budget Group Inc, swap sur rendement total	(44 765)	4 327
(228)	31 juill. 2024	Avnet Inc, swap sur rendement total	(16 064)	1 013
(783)	31 juill. 2024	Axalta Coating Systems Ltd, swap sur rendement total	(36 610)	2 331
(40)	31 juill. 2024	Axon Enterprise Inc, swap sur rendement total	(16 105)	(16)
(388)	31 juill. 2024	Axsome Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(42 739)	(3 342)
(37)	31 juill. 2024	Azek Co Inc/The, swap sur rendement total	(2 133)	148
(973)	31 juill. 2024	Azenta Inc, swap sur rendement total	(70 059)	(1 264)
(113)	31 juill. 2024	Azz Inc, swap sur rendement total	(11 945)	989
(87)	31 juill. 2024	Banco Bradesco, CAAÉ, swap sur rendement total	(288)	6
(40)	31 juill. 2024	Beacon Roofing Supply Inc, swap sur rendement total	(4 953)	323
(1 259)	31 juill. 2024	Beam Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(40 364)	832
(3 122)	31 juill. 2024	Beauty Health Co/The, swap sur rendement total	(8 202)	1 210
(39 800)	31 juill. 2024	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(98 387)	2 531
(23)	31 juill. 2024	Bel Fuse Inc, cat. B, swap sur rendement total	(2 053)	96
(17 000)	31 juill. 2024	Bes Engineering Corp, swap sur rendement total	(10 613)	1 184
(362)	31 juill. 2024	Bio-Techne Corp, swap sur rendement total	(35 491)	2 884
(565)	31 juill. 2024	Blade Air Mobility Inc, swap sur rendement total	(2 690)	(343)
(3 497)	31 juill. 2024	Bloom Energy Corp, A, swap sur rendement total	(58 570)	15 303
(458)	31 juill. 2024	Bloomin' Brands Inc, swap sur rendement total	(12 052)	1 554
(5 998)	31 juill. 2024	Bp Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(296 286)	13 269
(227)	31 juill. 2024	Brc Inc, A, swap sur rendement total	(1 904)	(39)
(92)	31 juill. 2024	Brightview Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 674)	66
(1 521)	31 juill. 2024	Brinker International Inc, swap sur rendement total	(150 662)	(2 659)
(95)	31 juill. 2024	Brink'S Co/The, swap sur rendement total	(13 311)	151
(2 372)	31 juill. 2024	Brixmor Property Group Inc, swap sur rendement total	(74 944)	(1 620)
(115)	31 juill. 2024	Bruker Corp, swap sur rendement total	(10 041)	321
(54 500)	31 juill. 2024	Bts Group Holdings Pcl, swap sur rendement total	(9 097)	631
(125)	31 juill. 2024	Bumble Inc, A, swap sur rendement total	(1 798)	212
(359)	31 juill. 2024	Burlington Stores Inc, swap sur rendement total	(117 897)	(42)
(23)	31 juill. 2024	Cactus Inc, A, swap sur rendement total	(1 660)	(33)
(203)	31 juill. 2024	Cadence Bancorp, swap sur rendement total	(7 925)	5
(2 194)	31 juill. 2024	Caesars Entertainment Inc, swap sur rendement total	(119 306)	(8 280)
(463)	31 juill. 2024	Cal-Maine Foods Inc, swap sur rendement total	(38 716)	468
(190)	31 juill. 2024	Cambium Networks Corp, swap sur rendement total	(725)	106
(2 923)	31 juill. 2024	Canadian Solar Inc, swap sur rendement total	(58 995)	19 562
(48)	31 juill. 2024	Canoo Inc, swap sur rendement total	(140)	8
(74)	31 juill. 2024	Carlisle Cos Inc, swap sur rendement total	(41 031)	1 502
(881)	31 juill. 2024	Carvana Co, swap sur rendement total	(155 174)	(30 212)
(82)	31 juill. 2024	Casella Waste Systems Inc, A, swap sur rendement total	(11 133)	211
(1 320)	31 juill. 2024	Catalyst Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(27 978)	1 340
(6 000)	31 juill. 2024	Catcher Technology Co Ltd, swap sur rendement total	(58 718)	(1 764)
(901)	31 juill. 2024	Cd Projekt Sa, swap sur rendement total	(42 559)	(1 620)
(52)	31 juill. 2024	Celldex Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(2 633)	(130)
(2 523)	31 juill. 2024	Celsius Holdings Inc, swap sur rendement total	(197 094)	55 855
(1 000)	31 juill. 2024	Center Laboratories Inc, swap sur rendement total	(2 295)	(272)
(46)	31 juill. 2024	Centrus Energy Corp, cat. A, swap sur rendement total	(2 691)	445
(1 000)	31 juill. 2024	Chailease Holding Co Ltd, swap sur rendement total	(6 475)	108
(5 023)	31 juill. 2024	Chargepoint Holdings Inc, swap sur rendement total	(10 379)	927
(85)	31 juill. 2024	Charles River Laboratories, swap sur rendement total	(24 027)	311
(550)	31 juill. 2024	Chart Industries Inc, swap sur rendement total	(108 629)	4 478
(959)	31 juill. 2024	Check Point Software Tech, swap sur rendement total	(216 521)	(16 408)
(969)	31 juill. 2024	Cheesecake Factory Inc/The, swap sur rendement total	(52 096)	827
(81)	31 juill. 2024	Chefs' Warehouse Inc/The, swap sur rendement total	(4 335)	50

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(1 073)	31 juill. 2024	Cheniere Energy Inc, swap sur rendement total	(256 692)	(23 294)
(42)	31 juill. 2024	Chimera Investment Corp, swap sur rendement total	(756)	(40)
(3 000)	31 juill. 2024	China General Plastics, swap sur rendement total	(2 120)	102
(16)	31 juill. 2024	Chunbo Co Ltd, swap sur rendement total	(1 142)	24
(1 000)	31 juill. 2024	Chung Hung Steel Corp, swap sur rendement total	(907)	29
(1 000)	31 juill. 2024	Chung-Hsin Electric & Machin, swap sur rendement total	(7 930)	(92)
(234)	31 juill. 2024	Churchill Downs Inc, swap sur rendement total	(44 699)	(2 675)
(18)	31 juill. 2024	Cincinnati Financial Corp, swap sur rendement total	(2 929)	(86)
(6 222)	31 juill. 2024	Cisco Systems Inc, swap sur rendement total	(404 494)	(7 153)
(1 348)	31 juill. 2024	Civitas Resources Inc, swap sur rendement total	(127 273)	4 665
(2)	31 juill. 2024	Cj Cheiljedang Corp, swap sur rendement total	(766)	(74)
(187)	31 juill. 2024	Clean Harbors Inc, swap sur rendement total	(57 868)	(2 232)
(800)	31 juill. 2024	Clear Sale Sa, swap sur rendement total	(1 427)	117
(1 729)	31 juill. 2024	Cleveland-Cliffs Inc, swap sur rendement total	(36 411)	1 605
(2 740)	31 juill. 2024	Cloudflare Inc, cat. A, swap sur rendement total	(310 553)	(43 612)
(105)	31 juill. 2024	Coastal Financial Corp/Wa, swap sur rendement total	(6 629)	(235)
(250)	31 juill. 2024	Cogent Biosciences Inc, swap sur rendement total	(2 884)	(132)
(65)	31 juill. 2024	Cogent Communications Holdin, swap sur rendement total	(5 020)	(268)
(68)	31 juill. 2024	Collegium Pharmaceutical Inc, swap sur rendement total	(2 996)	92
(548)	31 juill. 2024	Comcast Corp, cat. A, swap sur rendement total	(29 364)	(858)
(1 799)	31 juill. 2024	Commscope Holding Co Inc, swap sur rendement total	(3 028)	694
(2 425)	31 juill. 2024	Compass Inc, cat. A, swap sur rendement total	(11 946)	415
(409)	31 juill. 2024	Compass Minerals Internation, swap sur rendement total	(5 781)	1 428
(41)	31 juill. 2024	Concentrix Corp, swap sur rendement total	(3 550)	(57)
(228)	31 juill. 2024	Conduent Inc, swap sur rendement total	(1 017)	79
(62)	31 juill. 2024	Consolidated Water Co, actions ord., swap sur rendement total	(2 252)	48
(1 750)	31 juill. 2024	Core & Main Inc, cat. A, swap sur rendement total	(117 192)	14 940
(591)	31 juill. 2024	Cormedix Inc, swap sur rendement total	(3 502)	629
(700)	31 juill. 2024	Corp Inmobiliaria Vesta Sab, swap sur rendement total	(2 864)	258
(137)	31 juill. 2024	Corpay Inc, swap sur rendement total	(49 942)	513
(4 813)	31 juill. 2024	Corteva Inc, swap sur rendement total	(355 242)	13 009
(532)	31 juill. 2024	Cousins Properties Inc, swap sur rendement total	(16 852)	48
(5)	31 juill. 2024	Credit Acceptance Corp, swap sur rendement total	(3 521)	(150)
(502)	31 juill. 2024	Crocs Inc, swap sur rendement total	(100 248)	6 818
(29)	31 juill. 2024	Cryoport Inc, swap sur rendement total	(274)	134
(330)	31 juill. 2024	Cubesmart, swap sur rendement total	(20 397)	(1 113)
(2 900)	31 juill. 2024	Cvc Brasil Operadora E Agenc, swap sur rendement total	(1 391)	76
(601)	31 juill. 2024	Cvrx Inc, swap sur rendement total	(9 860)	(3 292)
(2 669)	31 juill. 2024	Cvs Health Corp, swap sur rendement total	(215 695)	5 179
(473)	31 juill. 2024	Cytokinetics Inc, swap sur rendement total	(35 067)	(3 135)
(7 000)	31 juill. 2024	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(17 510)	551
(256)	31 juill. 2024	Danimer Scientif Warrant, swap sur rendement total	(8)	(8)
(769)	31 juill. 2024	Danimer Scientific Inc, swap sur rendement total	(635)	187
(2 927)	31 juill. 2024	Dar Al Arkan Real Estate Dev, swap sur rendement total	(12 597)	214
(498)	31 juill. 2024	Dave & Buster'S Entertainmen, swap sur rendement total	(27 128)	1 998
(228)	31 juill. 2024	Definitive Healthcare Corp, swap sur rendement total	(1 703)	(37)
(239)	31 juill. 2024	Dell Technologies, C, swap sur rendement total	(45 101)	2 083
(4 080)	31 juill. 2024	Delta Air Lines Inc, swap sur rendement total	(264 851)	21 090
(969)	31 juill. 2024	Designer Brands Inc, cat. A, swap sur rendement total	(9 056)	2 790
(123)	31 juill. 2024	Desktop Metal Inc, A, swap sur rendement total	(695)	61
(2 328)	31 juill. 2024	Dexcom Inc, swap sur rendement total	(361 174)	10 961
(1 178)	31 juill. 2024	Diageo Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(203 230)	16 325
(400)	31 juill. 2024	Diagnosticos Da America Sa, swap sur rendement total	(271)	102
(235)	31 juill. 2024	Digi International Inc, swap sur rendement total	(7 373)	489
(229)	31 juill. 2024	Digitalocean Holdings Inc, swap sur rendement total	(10 889)	758
(829)	31 juill. 2024	Dino Polska Sa, swap sur rendement total	(114 473)	(1 078)
(250)	31 juill. 2024	Disc Medicine Inc, swap sur rendement total	(15 418)	(620)
(145)	31 juill. 2024	Diversified Healthcare Trust, swap sur rendement total	(605)	(112)
(501)	31 juill. 2024	Dolby Laboratories Inc, cat. A, swap sur rendement total	(54 316)	1 422
(235)	31 juill. 2024	Dollar General Corp, swap sur rendement total	(42 520)	(1 071)
(118)	31 juill. 2024	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(2 481)	385
(1 846)	31 juill. 2024	Doubleverify Holdings Inc, swap sur rendement total	(49 181)	(2 101)
(82)	31 juill. 2024	Douglas Dynamics Inc, swap sur rendement total	(2 626)	180
(2 748)	31 juill. 2024	Doximity Inc, cat. A, swap sur rendement total	(105 174)	(504)
(312)	31 juill. 2024	Dr Sulaiman Al Habib Medical, swap sur rendement total	(32 841)	(1 746)
(138)	31 juill. 2024	Driven Brands Holdings Inc, swap sur rendement total	(2 404)	(210)
(594)	31 juill. 2024	Duckhorn Portfolio Inc/The, swap sur rendement total	(5 771)	545
(252)	31 juill. 2024	Duolingo, swap sur rendement total	(71 954)	(5 545)
(2 392)	31 juill. 2024	Dutch Bros Inc, cat. A, swap sur rendement total	(135 506)	(18 816)
(2 772)	31 juill. 2024	Dxc Technology Co, swap sur rendement total	(72 410)	(7 987)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(1 370)	31 juill. 2024	Dynavax Technologies Corp, swap sur rendement total	(21 052)	1 379
(9 000)	31 juill. 2024	E Ink Holdings Inc, swap sur rendement total	(95 669)	(11 671)
(3 135)	31 juill. 2024	Ecopetrol Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(51 434)	1 195
(339)	31 juill. 2024	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(61 661)	2 611
(435)	31 juill. 2024	Ecopro Co Ltd, swap sur rendement total	(38 956)	1 746
(232)	31 juill. 2024	Edgio Inc, swap sur rendement total	(3 467)	(500)
(27)	31 juill. 2024	Eli Lilly & Co, swap sur rendement total	(33 450)	(112)
(1 301)	31 juill. 2024	Ellington Financial Inc, swap sur rendement total	(21 737)	(80)
(165)	31 juill. 2024	Elm Co, swap sur rendement total	(51 586)	(2 204)
(50)	31 juill. 2024	Emaar Economic City, swap sur rendement total	(118)	4
(188)	31 juill. 2024	Energy Recovery Inc, swap sur rendement total	(3 419)	(65)
(255)	31 juill. 2024	Enfusion Inc, cat. A, swap sur rendement total	(2 973)	321
(920)	31 juill. 2024	Enhabit Inc, swap sur rendement total	(11 229)	382
(33)	31 juill. 2024	Enliven Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 055)	(69)
(230)	31 juill. 2024	Enphase Energy Inc, swap sur rendement total	(31 381)	8 815
(569)	31 juill. 2024	Entegris Inc, swap sur rendement total	(105 421)	(4 064)
(800)	31 juill. 2024	Envista Holdings Corp, swap sur rendement total	(18 205)	2 810
(1 493)	31 juill. 2024	Eos Energy Enterprises Inc, swap sur rendement total	(2 595)	(1 088)
(546)	31 juill. 2024	Epr Properties, swap sur rendement total	(31 577)	(805)
(426)	31 juill. 2024	Eqt Corp, swap sur rendement total	(21 556)	434
(7)	31 juill. 2024	Equinix Inc, swap sur rendement total	(7 247)	(113)
(592)	31 juill. 2024	Equity Lifestyle Properties, swap sur rendement total	(53 146)	(2 041)
(226)	31 juill. 2024	Esab Corp, swap sur rendement total	(29 227)	2 685
(748)	31 juill. 2024	Essential Utilities Inc, swap sur rendement total	(38 208)	893
(331)	31 juill. 2024	Establishment Labs Holdings, swap sur rendement total	(20 581)	2 486
(75)	31 juill. 2024	Ethan Allen Interiors Inc, swap sur rendement total	(2 862)	110
(30)	31 juill. 2024	Euronet Worldwide Inc, swap sur rendement total	(4 249)	555
(1 700)	31 juill. 2024	Even Construtora E Inco Sa, swap sur rendement total	(2 725)	175
(2 778)	31 juill. 2024	Evgo Inc, swap sur rendement total	(9 313)	(1 428)
(173)	31 juill. 2024	Evolus Inc, swap sur rendement total	(2 568)	200
(1 359)	31 juill. 2024	Evolution Petroleum Corp, swap sur rendement total	(9 800)	681
(84)	31 juill. 2024	Evolv Technologies Holdings, swap sur rendement total	(293)	26
(443)	31 juill. 2024	Ew Scripps Co/The, A, swap sur rendement total	(1 903)	(336)
(1 152)	31 juill. 2024	Exlservice Holdings Inc, swap sur rendement total	(49 434)	(2 183)
(759)	31 juill. 2024	Expedia Group Inc, swap sur rendement total	(130 850)	(7 474)
(308)	31 juill. 2024	Expro Group Holdings Nv, swap sur rendement total	(9 660)	217
(5 300)	31 juill. 2024	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(16 871)	1 067
(103)	31 juill. 2024	Fair Isaac Corp, swap sur rendement total	(209 812)	(22 479)
(423)	31 juill. 2024	Fastly Inc, cat. A, swap sur rendement total	(4 266)	285
(4 060)	31 juill. 2024	Fate Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(18 222)	2 287
(2)	31 juill. 2024	Fawaz Abdulaziz Alhokair & C, swap sur rendement total	(6)	–
(401)	31 juill. 2024	First Advantage Corp, swap sur rendement total	(8 818)	34
(42)	31 juill. 2024	First Citizens Bcshs, cat. A, swap sur rendement total	(96 758)	668
(136)	31 juill. 2024	First Foundation Inc, swap sur rendement total	(1 219)	(122)
(26)	31 juill. 2024	First Interstate Bancsys, A, swap sur rendement total	(988)	(48)
(54)	31 juill. 2024	First Watch Restaurant Group, swap sur rendement total	(1 298)	162
(13)	31 juill. 2024	Fitaihi Holding Group, swap sur rendement total	(18)	1
(165)	31 juill. 2024	Five Below, swap sur rendement total	(24 603)	2 257
(4 600)	31 juill. 2024	Fleury Sa, swap sur rendement total	(16 921)	5
(1 598)	31 juill. 2024	Flex Ltd, swap sur rendement total	(64 484)	8 332
(109)	31 juill. 2024	Flowserve Corp, swap sur rendement total	(7 205)	210
(8 282)	31 juill. 2024	Fluence Energy Inc, swap sur rendement total	(196 509)	78 766
(64)	31 juill. 2024	Flushing Financial Corp, swap sur rendement total	(1 152)	(37)
(2 000)	31 juill. 2024	Formosa Petrochemical Corp, swap sur rendement total	(5 467)	225
(29 000)	31 juill. 2024	Formosa Plastics Corp, swap sur rendement total	(70 339)	9 420
(47)	31 juill. 2024	Forrester Research Inc, swap sur rendement total	(1 098)	63
(1 493)	31 juill. 2024	Forward Air Corp, swap sur rendement total	(38 898)	452
(21)	31 juill. 2024	Fox Factory Holding Corp, swap sur rendement total	(1 385)	4
(15)	31 juill. 2024	Franklin Covey Co, swap sur rendement total	(780)	(22)
(34)	31 juill. 2024	Fresh Del Monte Produce Inc, swap sur rendement total	(1 017)	75
(130)	31 juill. 2024	Fti Consulting Inc, swap sur rendement total	(38 340)	12
(50)	31 juill. 2024	Fulcrum Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(424)	115
(251)	31 juill. 2024	Funko Inc, cat. A, swap sur rendement total	(3 352)	(104)
(730)	31 juill. 2024	Gamestop Corp, cat. A, swap sur rendement total	(24 663)	(1 461)
(337)	31 juill. 2024	Gaming And Leisure Propertie, swap sur rendement total	(20 848)	(119)
(4 264)	31 juill. 2024	Gap Inc/The, swap sur rendement total	(139 390)	30 184
(83)	31 juill. 2024	Gates Industrial Corp Plc, swap sur rendement total	(1 796)	179
(289)	31 juill. 2024	Ge Healthcare Tech, swap sur rendement total	(30 814)	175
(164)	31 juill. 2024	Generac Holdings Inc, swap sur rendement total	(29 671)	3 644
(1 344)	31 juill. 2024	Genpact Ltd, swap sur rendement total	(59 199)	1 835

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(18 300)	31 juill. 2024	Genting Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(13 536)	615
(1 137)	31 juill. 2024	Geo Group Inc/The, swap sur rendement total	(22 341)	(508)
(4 580)	31 juill. 2024	Geron Corp, swap sur rendement total	(26 572)	(2 704)
(288)	31 juill. 2024	Globus Medical Inc, A, swap sur rendement total	(26 991)	(637)
(366)	31 juill. 2024	Gogo Inc, swap sur rendement total	(4 818)	505
(792)	31 juill. 2024	Gold Fields Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(16 148)	(766)
(418)	31 juill. 2024	Goodyear Tire & Rubber Co, swap sur rendement total	(6 492)	626
(383)	31 juill. 2024	Graco Inc, swap sur rendement total	(41 549)	922
(27)	31 juill. 2024	Grand Korea Leisure Co Ltd, swap sur rendement total	(342)	19
(426)	31 juill. 2024	Greenbrier Companies Inc, swap sur rendement total	(28 884)	2 791
(110)	31 juill. 2024	Grid Dynamics Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 582)	(147)
(458)	31 juill. 2024	Grifols Sa, CAAÉ, swap sur rendement total	(3 951)	555
(2 806)	31 juill. 2024	Gritstone Oncology Inc, swap sur rendement total	(2 372)	604
(1 311)	31 juill. 2024	Grocery Outlet Holding Corp, swap sur rendement total	(39 681)	(190)
(2 635)	31 juill. 2024	Gruma S.A.B., B, swap sur rendement total	(65 747)	3 238
(1 900)	31 juill. 2024	Grupo Bimbo Sab, série A, swap sur rendement total	(9 176)	652
(3 660)	31 juill. 2024	Guardant Health Inc, swap sur rendement total	(144 636)	(7 467)
(59)	31 juill. 2024	Gulfport Energy Corp, swap sur rendement total	(12 191)	814
(100 200)	31 juill. 2024	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(93 922)	10 750
(2 423)	31 juill. 2024	Harmonic Inc, swap sur rendement total	(39 024)	1 549
(297)	31 juill. 2024	Harmony Gold Mng, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(3 727)	(70)
(4 543)	31 juill. 2024	Hdfc Bank Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	(399 902)	(37 991)
(114)	31 juill. 2024	Helen Of Troy Ltd, swap sur rendement total	(14 467)	2 268
(235)	31 juill. 2024	Helix Energy Solutions Group, swap sur rendement total	(3 839)	(232)
(215)	31 juill. 2024	Henry Schein Inc, swap sur rendement total	(18 858)	1 320
(246)	31 juill. 2024	Herc Holdings Inc, swap sur rendement total	(44 867)	3 442
(97)	31 juill. 2024	Hf Sinclair Corp, swap sur rendement total	(7 080)	194
(2 000)	31 juill. 2024	Highwealth Construction Corp, swap sur rendement total	(4 395)	(315)
(92)	31 juill. 2024	Hilton Grand Vacations Inc, swap sur rendement total	(5 090)	150
(282)	31 juill. 2024	Hologic Inc, swap sur rendement total	(28 651)	(415)
(148)	31 juill. 2024	Houlihan Lokey Inc, swap sur rendement total	(27 311)	208
(344)	31 juill. 2024	Hp Inc, swap sur rendement total	(16 484)	203
(4 711)	31 juill. 2024	Hsbc Holdings Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(280 414)	7 766
(2 000)	31 juill. 2024	Htc Corp, swap sur rendement total	(3 893)	(206)
(91)	31 juill. 2024	Hubspot Inc, swap sur rendement total	(73 441)	2 648
(395)	31 juill. 2024	Hudson Pacific Properties In, swap sur rendement total	(2 600)	58
(416)	31 juill. 2024	Humana Inc, swap sur rendement total	(213 198)	(8 868)
(18)	31 juill. 2024	Huntington Ingalls Industrie, swap sur rendement total	(6 067)	71
(254)	31 juill. 2024	Hyatt Hotels Corp, cat. A, swap sur rendement total	(52 801)	(1 668)
(102)	31 juill. 2024	I3 Verticals Inc, cat. A, swap sur rendement total	(3 082)	(353)
(62)	31 juill. 2024	Iac/Interactivecorp, swap sur rendement total	(3 975)	320
(39)	31 juill. 2024	Icf International Inc, swap sur rendement total	(7 930)	(284)
(277)	31 juill. 2024	Independence Realty Trust In, swap sur rendement total	(7 164)	(790)
(1 435)	31 juill. 2024	Indie Semiconductor Inc, A, swap sur rendement total	(12 115)	888
(1 781)	31 juill. 2024	Infinera Corp, swap sur rendement total	(14 842)	(1 055)
(7 166)	31 juill. 2024	Infosys Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(185 870)	(16 525)
(666)	31 juill. 2024	Ingredion Inc, swap sur rendement total	(104 529)	2 838
(4 574)	31 juill. 2024	Inmode Ltd, swap sur rendement total	(114 161)	3 370
(119)	31 juill. 2024	Insperity Inc, swap sur rendement total	(14 852)	584
(84)	31 juill. 2024	Inspired Entertainment Inc, swap sur rendement total	(1 052)	–
(2 328)	31 juill. 2024	Intellia Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(71 292)	1 320
(8)	31 juill. 2024	Intellian Technologies Inc, swap sur rendement total	(468)	(1)
(57)	31 juill. 2024	Inter Parfums Inc, swap sur rendement total	(9 050)	270
(116)	31 juill. 2024	Interdigital Inc, swap sur rendement total	(18 501)	(127)
(60)	31 juill. 2024	International Bancshares Crp, swap sur rendement total	(4 697)	(41)
(163)	31 juill. 2024	Intrepid Potash Inc, swap sur rendement total	(5 226)	776
(419)	31 juill. 2024	Intuitive Machines Inc, swap sur rendement total	(1 892)	357
(27)	31 juill. 2024	Intuitive Surgical Inc, swap sur rendement total	(16 435)	(100)
(2 600)	31 juill. 2024	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	(2 790)	106
(1 406)	31 juill. 2024	Ionq Inc, swap sur rendement total	(13 525)	(11)
(315)	31 juill. 2024	Ipg Photonics Corp, swap sur rendement total	(36 375)	1 146
(143)	31 juill. 2024	Irhythm Technologies Inc, swap sur rendement total	(21 062)	(2 260)
(837)	31 juill. 2024	Itau Unibanco H, CAAÉ parrainé visant des actions priv., swap sur rendement total	(6 747)	137
(134)	31 juill. 2024	Janux Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(7 681)	1 724
(936)	31 juill. 2024	Jastrzebska Spolka Weglowa S, swap sur rendement total	(9 418)	(129)
(1 200)	31 juill. 2024	Jaymart Pcl, swap sur rendement total	(581)	(21)
(8 282)	31 juill. 2024	Jetblue Airways Corp, swap sur rendement total	(69 016)	(4 425)
(3 149)	31 juill. 2024	Jinkosolar Holding Co, CAAÉ, swap sur rendement total	(89 281)	39 088
(2 939)	31 juill. 2024	Johnson Controls Internation, swap sur rendement total	(268 802)	19 857
(52)	31 juill. 2024	K12 Inc, swap sur rendement total	(5 016)	(101)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(2 000)	31 juill. 2024	Kaori Heat Treatment Co Ltd, swap sur rendement total	(40 664)	1 641
(294)	31 juill. 2024	Kb Home, swap sur rendement total	(28 233)	242
(154)	31 juill. 2024	Keros Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(9 630)	283
(13 200)	31 juill. 2024	Khon Kaen Sugar Industry Pcl, swap sur rendement total	(890)	32
(232)	31 juill. 2024	Kilroy Realty Corp, swap sur rendement total	(10 067)	618
(186)	31 juill. 2024	Kimbell Royalty Partners Lp, swap sur rendement total	(4 164)	123
(305)	31 juill. 2024	Kla Corp, swap sur rendement total	(344 107)	(20 776)
(1 375)	31 juill. 2024	Knight-Swift Transportation, swap sur rendement total	(93 924)	(2 944)
(504)	31 juill. 2024	Kornit Digital Ltd, swap sur rendement total	(10 096)	(221)
(42)	31 juill. 2024	Kraft Heinz Co/The, swap sur rendement total	(1 852)	229
(290)	31 juill. 2024	Kratos Defense & Security, swap sur rendement total	(7 940)	634
(144)	31 juill. 2024	Kt&G Corp, swap sur rendement total	(12 624)	(708)
(9)	31 juill. 2024	Kura Sushi Usa Inc, cat. A, swap sur rendement total	(777)	356
(685)	31 juill. 2024	Kymera Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(27 979)	2 263
(588)	31 juill. 2024	L3Harris Technologies Inc, swap sur rendement total	(180 695)	612
(600)	31 juill. 2024	La Comer Sab De Cv, swap sur rendement total	(1 599)	245
(177)	31 juill. 2024	Landstar System Inc, swap sur rendement total	(44 681)	(444)
(1 095)	31 juill. 2024	Las Vegas Sands Corp, swap sur rendement total	(66 302)	367
(445)	31 juill. 2024	Lattice Semiconductor Corp, swap sur rendement total	(35 311)	9 859
(44)	31 juill. 2024	Legacy Housing Corp, swap sur rendement total	(1 381)	23
(3 268)	31 juill. 2024	Legend Biotech Corp, CAAÉ, swap sur rendement total	(198 055)	(12 541)
(61)	31 juill. 2024	Lg Energy Solution, swap sur rendement total	(19 796)	218
(9)	31 juill. 2024	Lgi Homes Inc, swap sur rendement total	(1 102)	3
(1 417)	31 juill. 2024	Liberty Broadband, C, swap sur rendement total	(106 293)	(1 552)
(59)	31 juill. 2024	Life Time Group Holdings Inc, swap sur rendement total	(1 520)	(104)
(723)	31 juill. 2024	Light & Wonder Inc, swap sur rendement total	(103 760)	(8 515)
(196)	31 juill. 2024	Lightwave Logic Inc, swap sur rendement total	(802)	82
(8)	31 juill. 2024	Limbach Holdings Inc, swap sur rendement total	(623)	3
(87)	31 juill. 2024	Lithia Motors Inc, cat. A, swap sur rendement total	(30 053)	201
(1 206)	31 juill. 2024	Live Nation Entertainment In, swap sur rendement total	(154 693)	(3 002)
(202)	31 juill. 2024	Lkq Corp, swap sur rendement total	(11 496)	(92)
(200)	31 juill. 2024	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(2 075)	142
(2)	31 juill. 2024	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(4)	(4)
(80)	31 juill. 2024	Lockheed Martin Corp, swap sur rendement total	(51 133)	990
(500)	31 juill. 2024	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(2 857)	(21)
(500)	31 juill. 2024	Log-In Logistica Intermodal, swap sur rendement total	(4 375)	294
(1 000)	31 juill. 2024	Lotus Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(13 055)	(963)
(121)	31 juill. 2024	Lovesac Co/The, swap sur rendement total	(3 739)	231
(338)	31 juill. 2024	Lululemon Athletica Inc, swap sur rendement total	(138 149)	8 367
(256)	31 juill. 2024	Luminar Technologies Inc, swap sur rendement total	(522)	40
(1 207)	31 juill. 2024	Lyondellbasell Indu, cat. A, swap sur rendement total	(157 992)	5 681
(510)	31 juill. 2024	Macom Technology Solutions H, swap sur rendement total	(77 790)	(6 944)
(419)	31 juill. 2024	Madison Square Garden Entert, swap sur rendement total	(20 101)	447
(252)	31 juill. 2024	Manhattan Associates Inc, swap sur rendement total	(85 061)	(8 058)
(277)	31 juill. 2024	Marinemax Inc, swap sur rendement total	(12 269)	(1 022)
(641)	31 juill. 2024	Marinus Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(1 026)	233
(584)	31 juill. 2024	Marqeta Inc, A, swap sur rendement total	(4 379)	(132)
(1 199)	31 juill. 2024	Marriott International, cat. A, swap sur rendement total	(396 660)	(13 623)
(52)	31 juill. 2024	Marten Transport Ltd, swap sur rendement total	(1 313)	(48)
(586)	31 juill. 2024	Masimo Corp, swap sur rendement total	(100 985)	(59)
(407)	31 juill. 2024	Mastec Inc, swap sur rendement total	(59 585)	1 684
(419)	31 juill. 2024	Match Group Inc, swap sur rendement total	(17 418)	73
(511)	31 juill. 2024	Matson Inc, swap sur rendement total	(91 578)	(1 564)
(53)	31 juill. 2024	Maxeon Solar Technologie, swap sur rendement total	(62)	60
(1 488)	31 juill. 2024	Mdu Resources Group Inc, swap sur rendement total	(51 361)	191
(4 251)	31 juill. 2024	Mediaalpha Inc, cat. A, swap sur rendement total	(76 608)	19 512
(742)	31 juill. 2024	Medical-Biomedical/Gene, swap sur rendement total	(3 909)	202
(352)	31 juill. 2024	Medifast Inc, swap sur rendement total	(10 510)	1 917
(11 171)	31 juill. 2024	Melco Resorts & Entert, CAAÉ, swap sur rendement total	(114 032)	6 192
(1 000)	31 juill. 2024	Meliuz Sa – On, swap sur rendement total	(1 432)	(47)
(676)	31 juill. 2024	Mercury Systems Inc, swap sur rendement total	(24 966)	3 465
(97)	31 juill. 2024	Meridianlink Inc, swap sur rendement total	(2 835)	(314)
(634)	31 juill. 2024	Mersana Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 744)	208
(1 120)	31 juill. 2024	Merus Nv, swap sur rendement total	(90 681)	(8 754)
(4)	31 juill. 2024	Methanol Chemicals Co, swap sur rendement total	(22)	–
(100)	31 juill. 2024	Mfa Financial Inc, swap sur rendement total	(1 504)	(33)
(391)	31 juill. 2024	Mge Energy Inc, swap sur rendement total	(39 977)	3 031
(1 058)	31 juill. 2024	Mgm Resorts International, swap sur rendement total	(64 336)	(5 093)
(4 000)	31 juill. 2024	Microbio Co Ltd, swap sur rendement total	(6 994)	(126)
(499)	31 juill. 2024	Middle East Healthcare Co, swap sur rendement total	(15 725)	(521)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(3)	31 juill. 2024	Middle East Paper Co, swap sur rendement total	(44)	–
(123)	31 juill. 2024	Middleby Corp, swap sur rendement total	(20 636)	1 234
(134)	31 juill. 2024	Middlesex Water Co, swap sur rendement total	(9 582)	333
(212)	31 juill. 2024	Mitek Systems Inc, swap sur rendement total	(3 243)	439
(10 335)	31 juill. 2024	Mitsubishi Ufj Finl, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(154 531)	(6 296)
(167)	31 juill. 2024	Mks Instruments Inc, swap sur rendement total	(29 839)	(172)
(800)	31 juill. 2024	Moderna Inc, swap sur rendement total	(129 993)	26 654
(50)	31 juill. 2024	Modivcare Inc, swap sur rendement total	(1 795)	89
(184)	31 juill. 2024	Mohawk Industries Inc, swap sur rendement total	(28 599)	1 799
(130)	31 juill. 2024	Mongodb Inc, swap sur rendement total	(44 464)	(1 094)
(245)	31 juill. 2024	Monolithic Power Systems Inc, swap sur rendement total	(275 884)	(28 081)
(923)	31 juill. 2024	Monster Beverage Corp, swap sur rendement total	(63 086)	(2)
(64)	31 juill. 2024	Monte Rosa Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(328)	19
(65)	31 juill. 2024	Morningstar Inc, swap sur rendement total	(26 314)	(581)
(431)	31 juill. 2024	Mosaic Co/The, swap sur rendement total	(17 044)	2 315
(5 075)	31 juill. 2024	Mp Materials Corp, swap sur rendement total	(88 402)	24 682
(7 300)	31 juill. 2024	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(1 822)	395
(87)	31 juill. 2024	Mueller Industries Inc, swap sur rendement total	(6 779)	259
(75)	31 juill. 2024	Mueller Water Products Inc, A, swap sur rendement total	(1 839)	48
(136)	31 juill. 2024	Murphy Usa Inc, swap sur rendement total	(87 364)	(4 980)
(4 000)	31 juill. 2024	Nan Ya Plastics Corp, swap sur rendement total	(8 318)	677
(90)	31 juill. 2024	Napco Security Technologies, swap sur rendement total	(6 398)	(260)
(342)	31 juill. 2024	Natera Inc, swap sur rendement total	(50 677)	(537)
(31)	31 juill. 2024	National Research Corp, swap sur rendement total	(979)	217
(247)	31 juill. 2024	National Retail Properties, swap sur rendement total	(14 398)	(75)
(1 020)	31 juill. 2024	Navitas Semiconductor Corp, swap sur rendement total	(5 485)	160
(80)	31 juill. 2024	Nayifat Finance Co, swap sur rendement total	(359)	24
(2 000)	31 juill. 2024	Neo Solar Power Corp, swap sur rendement total	(1 152)	(124)
(7 806)	31 juill. 2024	Neogen Corp, swap sur rendement total	(166 949)	(17 846)
(1 769)	31 juill. 2024	Neogenomics Inc, swap sur rendement total	(33 574)	(352)
(2 536)	31 juill. 2024	New Fortress Energy Inc, swap sur rendement total	(76 274)	5 597
(42)	31 juill. 2024	New York Times Co, A, swap sur rendement total	(2 943)	3
(364)	31 juill. 2024	Newpark Resources Inc, swap sur rendement total	(4 139)	8
(417)	31 juill. 2024	Nexstar Media Group Inc, cat. A, swap sur rendement total	(94 726)	180
(978)	31 juill. 2024	Nextdecade Corp, swap sur rendement total	(10 626)	(758)
(2 442)	31 juill. 2024	Nextera Energy Inc, swap sur rendement total	(236 612)	26 728
(191)	31 juill. 2024	Nextera Energy Partners Lp, swap sur rendement total	(7 224)	1 619
(671)	31 juill. 2024	Nextnav Inc, swap sur rendement total	(7 446)	(197)
(853)	31 juill. 2024	Nice Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(200 724)	14 599
(796)	31 juill. 2024	Nikola Corp, swap sur rendement total	(8 921)	7 868
(189)	31 juill. 2024	Northrop Grumman Corp, swap sur rendement total	(112 745)	2 952
(1 523)	31 juill. 2024	Norwegian Cruise Line Holdin, swap sur rendement total	(39 158)	(4 286)
(2 575)	31 juill. 2024	Nuscale Power Corp, swap sur rendement total	(41 190)	(9 997)
(62)	31 juill. 2024	Occidental Petroleum Corp, swap sur rendement total	(5 366)	(24)
(6 779)	31 juill. 2024	Ocular Therapeutix Inc, swap sur rendement total	(63 448)	(10 361)
(3 709)	31 juill. 2024	Old National Bancorp, swap sur rendement total	(87 243)	(416)
(460)	31 juill. 2024	Olin Corp, swap sur rendement total	(29 678)	3 956
(43)	31 juill. 2024	Ollie'S Bargain Outlet Holdi, swap sur rendement total	(5 776)	25
(6)	31 juill. 2024	Olympic Steel Inc, swap sur rendement total	(368)	57
(1 902)	31 juill. 2024	Omega Healthcare Investors, swap sur rendement total	(89 139)	(4 636)
(1 036)	31 juill. 2024	Omnicom Group, swap sur rendement total	(128 152)	2 898
(256)	31 juill. 2024	On Semiconductor, swap sur rendement total	(24 013)	(211)
(873)	31 juill. 2024	Onemain Holdings Inc, swap sur rendement total	(57 925)	916
(9 000)	31 juill. 2024	Oneness Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	(62 261)	(4 958)
(20)	31 juill. 2024	Onewater Marine Inc, cat. A, swap sur rendement total	(755)	(38)
(780)	31 juill. 2024	Open Lending Corp, cat. A, swap sur rendement total	(5 956)	995
(4 800)	31 juill. 2024	Operadora De Sites Mex, A-1, swap sur rendement total	(5 917)	949
(1 269)	31 juill. 2024	Optinose Inc, swap sur rendement total	(1 806)	77
(2 000)	31 juill. 2024	Optotech Corp, swap sur rendement total	(3 531)	(26)
(3 400)	31 juill. 2024	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(6 489)	1 126
(86)	31 juill. 2024	O'Reilly Automotive Inc, swap sur rendement total	(124 275)	(3 686)
(976)	31 juill. 2024	Origin Materials Inc, swap sur rendement total	(1 204)	261
(100)	31 juill. 2024	Origin Property Pcl, swap sur rendement total	(17)	2
(914)	31 juill. 2024	Oscar Health Inc, cat. A, swap sur rendement total	(19 786)	5 190
(409)	31 juill. 2024	Owens Corning, swap sur rendement total	(97 223)	3 911
(4 617)	31 juill. 2024	P G & E Corp, swap sur rendement total	(110 370)	6 926
(775)	31 juill. 2024	Pacific Biosciences Of Calif, swap sur rendement total	(1 453)	452
(79)	31 juill. 2024	Pacific Premier Bancorp Inc, swap sur rendement total	(2 483)	(100)
(10 808)	31 juill. 2024	Palantir Technologies Inc, A, swap sur rendement total	(374 609)	(35 760)
(751)	31 juill. 2024	Par Pacific Holdings Inc, swap sur rendement total	(25 948)	885

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(36)	31 juill. 2024	Paragon 28 Inc, swap sur rendement total	(337)	35
(3 656)	31 juill. 2024	Paramount Global, cat. B, swap sur rendement total	(52 228)	7 305
(48)	31 juill. 2024	Patrick Industries Inc, swap sur rendement total	(7 130)	225
(1 702)	31 juill. 2024	Patterson-Uti Energy Inc, swap sur rendement total	(24 128)	1 404
(247)	31 juill. 2024	Paycom Software Inc, swap sur rendement total	(48 345)	658
(8 708)	31 juill. 2024	Peloton Interactive Inc, A, swap sur rendement total	(40 275)	3 688
(618)	31 juill. 2024	Pennymac Mortgage Investment, swap sur rendement total	(11 628)	(18)
(629)	31 juill. 2024	Performance Food Group Co, swap sur rendement total	(56 900)	2 997
(40)	31 juill. 2024	Petiq Inc, swap sur rendement total	(1 207)	(63)
(1 300)	31 juill. 2024	Petronas Chemicals Group Bhd, swap sur rendement total	(2 379)	156
(4 600)	31 juill. 2024	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(20 872)	4 116
(904)	31 juill. 2024	Phathom Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(12 741)	(869)
(1 000)	31 juill. 2024	Phoenix Silicon Intl Corp, swap sur rendement total	(3 750)	(246)
(20)	31 juill. 2024	Phreesia Inc, swap sur rendement total	(580)	(48)
(834)	31 juill. 2024	Physicians Realty Trust, swap sur rendement total	(22 368)	291
(2 619)	31 juill. 2024	Pko Bank Polski Sa, swap sur rendement total	(56 019)	(1 777)
(447)	31 juill. 2024	Planet Fitness Inc, cat. A, swap sur rendement total	(45 012)	(1 339)
(39)	31 juill. 2024	Plexus Corp, swap sur rendement total	(5 506)	685
(17 679)	31 juill. 2024	Polski Koncern Naftowy Orlen, swap sur rendement total	(406 810)	(15 594)
(410)	31 juill. 2024	Popular Inc, swap sur rendement total	(49 959)	17
(139)	31 juill. 2024	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	(35 714)	(1 203)
(391)	31 juill. 2024	Privia Health Group Inc, swap sur rendement total	(9 299)	2
(975)	31 juill. 2024	Progyny Inc, swap sur rendement total	(38 170)	(2 221)
(851)	31 juill. 2024	Propetro Holding Corp, swap sur rendement total	(10 096)	724
(1 070)	31 juill. 2024	Prudential Plc, CAAÉ, swap sur rendement total	(26 823)	1 391
(494)	31 juill. 2024	Public Service Enterprise Gp, swap sur rendement total	(49 819)	1 624
(35)	31 juill. 2024	Pultegroup Inc, swap sur rendement total	(5 283)	462
(1 807)	31 juill. 2024	Purecycle Technologies Inc, swap sur rendement total	(14 638)	(257)
(160)	31 juill. 2024	Pvh Corp, swap sur rendement total	(23 179)	3 294
(1 100)	31 juill. 2024	Qgep Participacoes Sa, swap sur rendement total	(5 906)	474
(1 258)	31 juill. 2024	Qualcomm Inc, swap sur rendement total	(342 865)	12 144
(20 000)	31 juill. 2024	Quanta Computer Inc, swap sur rendement total	(263 217)	(30 741)
(1 237)	31 juill. 2024	Quantum-Si Inc, swap sur rendement total	(1 777)	767
(160)	31 juill. 2024	Quest Diagnostics Inc, swap sur rendement total	(29 968)	1 277
(1 239)	31 juill. 2024	Quidel Corp, swap sur rendement total	(56 321)	16 648
(27)	31 juill. 2024	Quimica Y Minera Chil, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(1 506)	167
(567)	31 juill. 2024	Quinstreet Inc, swap sur rendement total	(12 871)	842
(8 208)	31 juill. 2024	R1 Rcm Inc, swap sur rendement total	(141 067)	3 673
(121)	31 juill. 2024	Rabigh Refining And Petroche, swap sur rendement total	(297)	6
(836)	31 juill. 2024	Rackspace Technology Inc, swap sur rendement total	(3 409)	(1 128)
(18)	31 juill. 2024	Ralph Lauren Corp, swap sur rendement total	(4 332)	245
(258)	31 juill. 2024	Rambus Inc, swap sur rendement total	(20 744)	(1 127)
(128)	31 juill. 2024	Rayonier Inc, swap sur rendement total	(5 095)	184
(2 999)	31 juill. 2024	Recursion Pharmaceuticals, A, swap sur rendement total	(30 778)	3 376
(292)	31 juill. 2024	Red Rock Resorts Inc, cat. A, swap sur rendement total	(21 948)	(1 402)
(2 263)	31 juill. 2024	Redwood Trust Inc, swap sur rendement total	(20 097)	(387)
(208)	31 juill. 2024	Reliance Steel & Aluminum, swap sur rendement total	(81 287)	4 205
(1 907)	31 juill. 2024	Relx Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(119 721)	(1 446)
(156)	31 juill. 2024	Rev Group Inc, swap sur rendement total	(5 324)	459
(201)	31 juill. 2024	Richardson Elec Ltd, swap sur rendement total	(3 270)	(167)
(8 563)	31 juill. 2024	Rivian Automotive Inc, A, swap sur rendement total	(157 245)	(28 466)
(1 970)	31 juill. 2024	Roblox Corp, cat. A, swap sur rendement total	(100 305)	(7 979)
(1 527)	31 juill. 2024	Roivant Sciences Ltd, swap sur rendement total	(22 086)	(86)
(63)	31 juill. 2024	Royal Gold Inc, swap sur rendement total	(10 790)	1 106
(617)	31 juill. 2024	Royalty Pharma Plc, cat. A, swap sur rendement total	(22 263)	728
(243)	31 juill. 2024	Rxo Inc, swap sur rendement total	(8 695)	(1 881)
(118)	31 juill. 2024	Ryder System Inc, swap sur rendement total	(20 002)	(315)
(151)	31 juill. 2024	Ryerson Holding Corp, swap sur rendement total	(4 029)	846
(1)	31 juill. 2024	Sadr Logistics Co, swap sur rendement total	(1)	–
(15)	31 juill. 2024	Saia Inc, swap sur rendement total	(9 735)	(1 250)
(3 249)	31 juill. 2024	Samsara Inc, cat. A, swap sur rendement total	(149 822)	(1 438)
(1 454)	31 juill. 2024	Sana Biotechnology Inc, swap sur rendement total	(10 863)	4 032
(736)	31 juill. 2024	Sangamo Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(361)	191
(3 778)	31 juill. 2024	Sanofi, CAAE, swap sur rendement total	(250 830)	3 087
(6)	31 juill. 2024	Saudi Airlines Catering Co, swap sur rendement total	(274)	(30)
(9 478)	31 juill. 2024	Saudi Arabian Mining Co, swap sur rendement total	(148 819)	11 531
(8)	31 juill. 2024	Saudi Printing & Packaging C, swap sur rendement total	(41)	(1)
(416)	31 juill. 2024	Saudi Research And Marketing, swap sur rendement total	(31 407)	(296)
(8)	31 juill. 2024	Saudi Vitrified Clay Pipe Co, swap sur rendement total	(126)	(2)
(403)	31 juill. 2024	Scansource Inc, swap sur rendement total	(24 435)	1 596

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(45)	31 juill. 2024	Schnitzer Steel Inds Inc, A, swap sur rendement total	(940)	118
(2 258)	31 juill. 2024	Schrodinger Inc, swap sur rendement total	(59 755)	5 987
(134)	31 juill. 2024	Select Energy Services Inc, A, swap sur rendement total	(1 962)	23
(1 522)	31 juill. 2024	Sempra Energy, swap sur rendement total	(159 696)	612
(767)	31 juill. 2024	Seres Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(760)	278
(606)	31 juill. 2024	Seritage Growth Prop, A Reit, swap sur rendement total	(3 872)	460
(12)	31 juill. 2024	Servisfirst Bancshares Inc, swap sur rendement total	(1 038)	(31)
(368)	31 juill. 2024	Shake Shack Inc, cat. A, swap sur rendement total	(45 320)	1 196
(3 706)	31 juill. 2024	Shell Plc, CAAE, swap sur rendement total	(366 032)	(1 803)
(401)	31 juill. 2024	Shift4 Payments Inc, cat. A, swap sur rendement total	(40 248)	(3 071)
(1 000)	31 juill. 2024	Shinfox Energy Co Ltd, swap sur rendement total	(6 665)	(1 321)
(3 683)	31 juill. 2024	Shoals Technologies Group, A, swap sur rendement total	(31 447)	7 497
(140)	31 juill. 2024	Shoe Carnival Inc, swap sur rendement total	(7 067)	199
(53 887)	31 juill. 2024	Sibanye-Stillwater Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	(320 753)	39 720
(294)	31 juill. 2024	Signet Jewelers Ltd, swap sur rendement total	(36 038)	7 012
(333)	31 juill. 2024	Simply Good Foods Co/The, swap sur rendement total	(16 463)	1 115
(263)	31 juill. 2024	Site Centers Corp, swap sur rendement total	(5 265)	(55)
(166)	31 juill. 2024	Sitio Royalties Corp, swap sur rendement total	(5 363)	(56)
(26)	31 juill. 2024	Sjw Group, swap sur rendement total	(1 929)	31
(197)	31 juill. 2024	Skechers Usa Inc, cat. A, swap sur rendement total	(18 632)	1 179
(96)	31 juill. 2024	Skyline Champion Corp, swap sur rendement total	(8 900)	75
(633)	31 juill. 2024	Skywest Inc, swap sur rendement total	(71 086)	(6 166)
(518)	31 juill. 2024	Skyworks Solutions Inc, swap sur rendement total	(75 544)	(402)
(801)	31 juill. 2024	Sl Green Realty Corp, swap sur rendement total	(62 354)	(2 910)
(3 520)	31 juill. 2024	Slc Agricola Sa, swap sur rendement total	(15 033)	1 386
(147)	31 juill. 2024	Slm Corp, swap sur rendement total	(4 182)	145
(191)	31 juill. 2024	Smart Global Holdings Inc, swap sur rendement total	(5 977)	(465)
(27)	31 juill. 2024	Snap-On Inc, swap sur rendement total	(9 657)	(35)
(4 461)	31 juill. 2024	Soundhound Ai Inc, A, swap sur rendement total	(24 112)	5 824
(1 123)	31 juill. 2024	Spirit Aerosystems Hold, cat. A, swap sur rendement total	(50 510)	(3 552)
(1 391)	31 juill. 2024	Sprinklr Inc, A, swap sur rendement total	(18 310)	(1 362)
(437)	31 juill. 2024	Stagwell Inc, swap sur rendement total	(4 078)	8
(768)	31 juill. 2024	Starbucks Corp, swap sur rendement total	(81 812)	2 022
(1 878)	31 juill. 2024	Stem Inc, swap sur rendement total	(2 852)	442
(64)	31 juill. 2024	Stewart Information Services, swap sur rendement total	(5 437)	139
(703)	31 juill. 2024	Stoke Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(12 996)	1 232
(61)	31 juill. 2024	Stratus Properties Inc, swap sur rendement total	(2 105)	(107)
(164)	31 juill. 2024	Sun Communities Inc, swap sur rendement total	(27 216)	(632)
(4 117)	31 juill. 2024	Sunrun Inc, swap sur rendement total	(66 813)	14 949
(339)	31 juill. 2024	Suzano Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(4 764)	(443)
(786)	31 juill. 2024	Symbotic Inc, swap sur rendement total	(37 815)	3 236
(148)	31 juill. 2024	Synopsys Inc, swap sur rendement total	(120 509)	(5 157)
(1 000)	31 juill. 2024	Ta Ya Electric Wire & Cable, swap sur rendement total	(2 354)	(194)
(2 000)	31 juill. 2024	Taishin Financial Holding, swap sur rendement total	(1 590)	(35)
(26 000)	31 juill. 2024	Taiwan Cement, swap sur rendement total	(37 508)	(1 189)
(10 000)	31 juill. 2024	Taiwan Cogeneration Corp, swap sur rendement total	(20 205)	(412)
(20)	31 juill. 2024	Take-Two Interactive Softwre, swap sur rendement total	(4 255)	230
(385)	31 juill. 2024	Takween Advanced Industries, swap sur rendement total	(1 688)	79
(3 611)	31 juill. 2024	Talos Energy Inc, swap sur rendement total	(60 035)	(2 425)
(832)	31 juill. 2024	Tango Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(9 768)	(223)
(286)	31 juill. 2024	Tapestry Inc, swap sur rendement total	(16 746)	(159)
(224)	31 juill. 2024	Taskus Inc, A, swap sur rendement total	(4 080)	260
(1 083)	31 juill. 2024	Td Synnex Corp, swap sur rendement total	(171 014)	20 414
(1 488)	31 juill. 2024	Technipfmc Plc, swap sur rendement total	(53 244)	(244)
(200)	31 juill. 2024	Telekom Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(392)	(2)
(246)	31 juill. 2024	Tempur Sealy International I, swap sur rendement total	(15 935)	1 420
(925)	31 juill. 2024	Teradyne Inc, swap sur rendement total	(187 694)	(7 428)
(74)	31 juill. 2024	Terns Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(690)	(52)
(562)	31 juill. 2024	Tesla Inc, swap sur rendement total	(152 172)	(9 114)
(11 547)	31 juill. 2024	Teva Pharmaceutical, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(256 755)	12 507
(52)	31 juill. 2024	Texas Pacific Land Trust, swap sur rendement total	(52 246)	(6 466)
(274)	31 juill. 2024	Texas Roadhouse Inc, swap sur rendement total	(64 379)	(527)
(280)	31 juill. 2024	The Saudi National Bank, swap sur rendement total	(3 748)	(277)
(209)	31 juill. 2024	Thor Industries Inc, swap sur rendement total	(26 725)	(666)
(315)	31 juill. 2024	Thredup Inc, cat. A, swap sur rendement total	(733)	126
(423)	31 juill. 2024	Tidewater Inc, swap sur rendement total	(55 109)	5 154
(243)	31 juill. 2024	Titan International Inc, swap sur rendement total	(2 464)	292
(695)	31 juill. 2024	Tko Group Holdings Inc, swap sur rendement total	(102 699)	1 333
(2 854)	31 juill. 2024	Topgolf Callaway Brands Corp, swap sur rendement total	(59 751)	745
(2 521)	31 juill. 2024	Totalenergies Se, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(232 979)	18 791

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(2 090)	31 juill. 2024	Trade Desk Inc/The, cat. A, swap sur rendement total	(279 322)	(10 143)
(5 200)	31 juill. 2024	Transmissora Alianca De, parts, swap sur rendement total	(43 562)	2 909
(294)	31 juill. 2024	Treace Medical Concepts Inc, swap sur rendement total	(2 675)	(303)
(190)	31 juill. 2024	Trex Company Inc, swap sur rendement total	(19 270)	2 978
(144)	31 juill. 2024	Trimble Inc, swap sur rendement total	(11 019)	468
(197)	31 juill. 2024	Trinet Group Inc, swap sur rendement total	(26 956)	1 175
(940)	31 juill. 2024	Twist Bioscience Corp, swap sur rendement total	(63 386)	(9 203)
(1)	31 juill. 2024	Umm Al-Qura Cement Co, swap sur rendement total	(6)	–
(270)	31 juill. 2024	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(24)	2
(3 833)	31 juill. 2024	Unilever Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(288 416)	772
(16 000)	31 juill. 2024	Unimicron Technology Corp, swap sur rendement total	(121 485)	1 982
(844)	31 juill. 2024	United Airlines Holdings Inc, swap sur rendement total	(56 197)	6 196
(9)	31 juill. 2024	United International Transpo, swap sur rendement total	(289)	(36)
(24)	31 juill. 2024	United Parks & Resorts Inc, swap sur rendement total	(1 784)	(127)
(285)	31 juill. 2024	Uniti Group Inc, swap sur rendement total	(1 139)	100
(219)	31 juill. 2024	Universal Display Corp, swap sur rendement total	(63 005)	(2 911)
(12)	31 juill. 2024	Universal Forest Products, swap sur rendement total	(1 839)	93
(263)	31 juill. 2024	Universal Health Services, B, swap sur rendement total	(66 552)	1 782
(115)	31 juill. 2024	Us Cellular Corp, swap sur rendement total	(8 784)	(19)
(1 172)	31 juill. 2024	Us Foods Holding Corp, swap sur rendement total	(84 964)	444
(117)	31 juill. 2024	Utz Brands Inc, swap sur rendement total	(2 677)	302
(51)	31 juill. 2024	Valmont Industries, swap sur rendement total	(19 195)	(1 483)
(4 167)	31 juill. 2024	Valvoline Inc, swap sur rendement total	(246 323)	(13 170)
(9 600)	31 juill. 2024	Vamos Locacao De Caminhoes M, swap sur rendement total	(17 786)	2 593
(102)	31 juill. 2024	Vericel Corp, swap sur rendement total	(6 404)	304
(93)	31 juill. 2024	Verisk Analytics Inc, swap sur rendement total	(34 302)	498
(468)	31 juill. 2024	Veru Inc, swap sur rendement total	(539)	75
(12 366)	31 juill. 2024	Viatris Inc, swap sur rendement total	(179 870)	154
(3 171)	31 juill. 2024	Vici Properties Inc, swap sur rendement total	(126 071)	(1 556)
(86)	31 juill. 2024	Vicor Corp, swap sur rendement total	(3 902)	226
(252)	31 juill. 2024	Victoria'S Secret & Co, swap sur rendement total	(6 093)	229
(98)	31 juill. 2024	Viridian Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(1 745)	(123)
(694)	31 juill. 2024	Vista Outdoor Inc, swap sur rendement total	(35 754)	(2 507)
(60)	31 juill. 2024	Visteon Corp, swap sur rendement total	(8 760)	402
(470)	31 juill. 2024	Vital Energy Inc, swap sur rendement total	(28 825)	(554)
(98)	31 juill. 2024	Walker & Dunlop Inc, swap sur rendement total	(13 168)	(309)
(181)	31 juill. 2024	Walmart Inc, swap sur rendement total	(16 770)	131
(7 000)	31 juill. 2024	Walsin Lihwa Corp, swap sur rendement total	(10 807)	130
(3 086)	31 juill. 2024	Warner Bros Discovery Inc, swap sur rendement total	(31 417)	(611)
(407)	31 juill. 2024	Weatherford International Pl, swap sur rendement total	(68 195)	(915)
(34)	31 juill. 2024	Webster Financial Corp, swap sur rendement total	(2 028)	(94)
(1 823)	31 juill. 2024	Wendy'S Co/The, swap sur rendement total	(42 307)	(241)
(165)	31 juill. 2024	Western Alliance Bancorp, swap sur rendement total	(14 183)	100
(625)	31 juill. 2024	Westlake Chemical Corp, swap sur rendement total	(123 853)	12 347
(173)	31 juill. 2024	Wheels Up Experience Inc, swap sur rendement total	(447)	173
(299)	31 juill. 2024	Willis Towers Watson Plc, swap sur rendement total	(107 611)	(1 673)
(262)	31 juill. 2024	Willscot Corp, swap sur rendement total	(13 494)	1 668
(7)	31 juill. 2024	Winmark Corp, swap sur rendement total	(3 378)	44
(181)	31 juill. 2024	Winnebago Industries, swap sur rendement total	(13 424)	(232)
(2 237)	31 juill. 2024	Woodside Energy Group, CAAÉ, swap sur rendement total	(57 577)	(789)
(136)	31 juill. 2024	Workday Inc, cat. A, swap sur rendement total	(41 604)	(1 878)
(531)	31 juill. 2024	World Kinect Corp, swap sur rendement total	(18 870)	340
(1 247)	31 juill. 2024	Wp Carey Inc, swap sur rendement total	(95 418)	1 183
(169)	31 juill. 2024	Wpp Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(10 944)	563
(228)	31 juill. 2024	Wynn Resorts Ltd, swap sur rendement total	(27 923)	206
(95)	31 juill. 2024	Xenon Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(5 068)	(124)
(2 000)	31 juill. 2024	Yulon Motor Company, swap sur rendement total	(5 636)	325
(190)	31 juill. 2024	Zebra Technologies Corp, cat. A, swap sur rendement total	(80 318)	1 199
(2 730)	31 juill. 2024	Zoominfo Technologies Inc, swap sur rendement total	(47 704)	(1 644)
(108)	31 juill. 2024	Zymeworks Inc, swap sur rendement total	(1 258)	9
(76)	31 juill. 2024	Zynex Inc, swap sur rendement total	(969)	94
				291 751
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		526 158

Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total	1 648 920
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total	(1 155 262)
Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net	**493 658**

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds mondial neutre au marché CC&L II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2024 et 2023 (non audité)

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

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

Le Fonds 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 1er 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 titres de capitaux propres.

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 30 juin 2024

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	2 426 672 $	– $	– $	2 426 672 $
Actions américaines – position acheteur	26 004 790	178	–	26 004 968
Actions étrangères – position acheteur	27 298 271	2 471	–	27 300 742
Contrats de change à terme	–	283 612	–	283 612
Contrats de swap	–	1 648 920	–	1 648 920
	55 729 733 $	1 935 181 $	– $	57 664 914 $

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	2 512 338 $	574 $	– $	2 512 912 $
Actions américaines – position vendeur	5 359 235	341	–	5 359 576
Actions étrangères – position vendeur	18 171 014	2 858	–	18 173 872
Contrats de change à terme	–	10 011	–	10 011
Contrats de swap	–	1 155 262	–	1 155 262
	26 042 587 $	1 169 046 $	– $	27 211 633 $

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 $

Il n'y a eu aucun transfert important d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

2024	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
Série A	**37 609**	**107 874**	–	**(10 948)**	**134 535**
Série F	**1 044 406**	**1 633 062**	–	**(296 940)**	**2 380 528**
Série I	**1 018 642**	–	–	**(595)**	**1 018 047**
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

Imposition du Fonds (note 7)

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

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2023).

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

Frais de gestion

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

Rémunération au rendement

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

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 30 juin 2024, CCLFGII détenait 934 361 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 11 323 427 $ (934 361 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 541 180$ au 31 décembre 2023). Au 30 juin 2024, 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 77 570 $, 81 092$ et 87 980 $ (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 $ au 31 décembre 2023).

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

Le Fonds a payé 62 446 $ (27 649 $ en 2023) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Les paiements indirects effectués pour la période se sont établis à 9 893 $ (4 902 $ en 2023).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 significative.

Au 30 juin 2024

Devise	Actifs (passifs) monétaires ($)	Contrats dérivés de change ($)	Exposition nette ($)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net ($)
Dollar australien	(31 895)	615 937	584 042	1,4	29 202
Livre sterling	119 240	321 730	440 970	1,1	22 049
Renminbi chinois	10 740	–	10 740	–	537
Couronne danoise	326 652	–	326 652	0,8	16 333
Euro	(9 389)	(2 020 877)	(2 030 266)	(4,8)	(101 513)
Dollar de Hong Kong	98 368	(1 568 781)	(1 470 413)	(3,5)	(73 521)
Forint hongrois	1 736	–	1 736	–	87
Roupie indonésienne	(2 294)	–	(2 294)	–	(115)
Nouveau shekel israélien	71 652	–	71 652	0,2	3 583
Yen japonais	41 136	(800 765)	(759 629)	(1,8)	(37 981)
Ringgit malaisien	1 021	–	1 021	–	51
Peso mexicain	12 255	251 886	264 141	0,6	13 207
Dollar néo-zélandais	4 717	–	4 717	–	236
Couronne norvégienne	26 195	(280 545)	(254 350)	(0,6)	(12 718)
Zloty polonais	(66)	–	(66)	–	(3)
Dollar de Singapour	11 390	–	11 390	–	570
Rand sud-africain	4 387	–	4 387	–	219
Couronne suédoise	63 995	478 203	542 198	1,3	27 110
Franc suisse	54 470	–	54 470	0,1	2 724
Baht thaïlandais	(2 233)	–	(2 233)	–	(112)
Lire turque	17 015	–	17 015	–	851
Dirham des ÉAU	758	–	758	–	38
Dollar américain	10 396 505	(37 140 556)	(26 744 051)	(63,8)	(1 337 203)
Total	11 216 355	(40 143 768)	(28 927 413)	(69,0)	(1 446 369)

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)
Baht 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)

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le risque de taux d'intérêt était négligeable, l'exposition du Fonds aux placements portant intérêt à long terme n'étant pas importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 2 969 000 $ (1 085 000 $ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être significative.

Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 % (4,6 % au 31 décembre 2023) 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).

Prêt de titre (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2024 ($)	2023 ($)
Revenus bruts tirés du prêt de titres	6 088	1 502
Charges liées au prêt de titres	(1 207)	(297)
Revenus nets tirés du prêt de titres	4 881	1 205
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(266)	(82)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	4 615	1 123

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,8 % (19,8 % en 2023) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

	2024 (en milliers de $)	2023 (en milliers de $)
Titres prêtés	3 091	2 353
Garanties reçues	3 246	2 471
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 137,2 % à 158,1 % (de 72,2 % à 208,0 % en 2023) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2024, l'exposition totale du Fonds correspondait à 145,5 % (146,1 % au 31 décembre 2023) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de 1 591 $ à 3 997 284 $ (de néant à 15 765 279 $ en 2023), avec un taux d'intérêt moyen de 5,68 % (5,36 % en 2023). Au 30 juin 2024, les emprunts en trésorerie correspondaient à 1,4 % (0,0 % au 31 décembre 2023) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2024 (non audité)	31 décembre 2023 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	**25 459 004 $**	12 098 607 $
Placements	**22 778 493**	9 496 123
Plus-value latente des contrats de change à terme	**268 224**	362 813
Plus-value latente des contrats de swap	**1 515 071**	922 862
Marge de variation quotidienne	**13 112 182**	2 760 593
Montant à recevoir du courtier	**657 471**	562 976
Dividendes à recevoir	**46 425**	13 172
Autres créances	**852**	870
Souscriptions à recevoir	**21 756**	–
	63 859 478	26 218 016
Passif		
Passif courant		
Placements vendus à découvert	**28 034 890**	11 684 181
Moins-value latente des contrats de change à terme	**14 213**	112 715
Moins-value latente des contrats de swap	**1 602 435**	409 434
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**43 010**	19 545
Montant à payer au courtier	**1 205 973**	521 056
Frais d'emprunt de titres à payer	**11 823**	10 528
Charges à payer	**66 022**	56 061
Frais de gestion à payer	**14 944**	1 996
Rémunération au rendement à payer	**202 439**	5 485
Rachats à payer	**38 596**	–
	31 234 345	12 821 001
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	**32 625 133 $**	13 397 015 $
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**675 283 $**	476 330 $
Série F	**19 032 804 $**	1 735 199 $
Série I	**12 917 046 $**	11 185 486 $
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	**56 744**	44 592
Série F	**1 564 221**	159 079
Série I	**1 018 292**	1 017 111
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**11,90 $**	10,68 $
Série F	**12,17 $**	10,91 $
Série I	**12,69 $**	11,00 $

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	**447 196 $**	(394 442) $
Variation du gain (perte) de change latent	**194 023**	35 894
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	**378**	1 846
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	**500 913**	280 531
Charges de dividende sur les titres vendus à découvert	**(244 672)**	(105 998)
Intérêts aux fins des distributions	**698 631**	95 510
Gain (perte) net réalisé sur les placements	**1 182 755**	928 126
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	**(2 557 786)**	(257 565)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	**(344 933)**	428 391
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	**323 629**	(19 252)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	**2 934 486**	87 243
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	**596 287**	(119 988)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	**1 084 145**	(547 046)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	**3 913**	151 124
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	**(600 792)**	210 455
Gain (perte) net total sur placements	**3 576 576**	1 131 531
Total des revenus (pertes) nets	**4 218 173**	774 829
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	**15 553**	8 131
Honoraires des dépositaires	**35 920**	28 974
Frais de dépôt	**35 355**	12 389
Honoraires du comité d'examen indépendant	**1 975**	2 232
Charges d'intérêts	**112 910**	80 616
Frais de gestion	**93 260**	8 790
Rémunération au rendement	**401 381**	65
Honoraires de professionnels	**17 985**	–
Coût d'emprunt de titres	**97 111**	7 941
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	**21 092**	5 962
Coûts de transaction (note 9)	**55 616**	19 681
Total des charges d'exploitation	**888 158**	174 781
Retenues d'impôts (note 7)	**(83 837)**	(21 155)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**3 246 178 $**	578 893 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**58 147 $**	10 412 $
Série F	**1 471 746 $**	180 096 $
Série I	**1 716 285 $**	388 385 $
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	**47 405**	44 019
Série F	**1 378 238**	119 199
Série I	**1 016 847**	1 209 398
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**1,23 $**	0,24 $
Série F	**1,07 $**	1,51 $
Série I	**1,69 $**	0,32 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2024	Série A 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**476 330 $**	483 210 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**58 147**	10 412
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**140 806**	49 693
Rachat de parts rachetables	**–**	(86 940)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**140 806**	(37 247)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**198 953**	(26 835)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**675 283 $**	456 375 $

	Série F 2024	Série F 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**1 735 199 $**	3 195 816 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**1 471 746**	180 096
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**16 532 492**	541 571
Rachat de parts rachetables	**(706 633)**	(2 973 949)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**15 825 859**	(2 432 378)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**17 297 605**	(2 252 282)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**19 032 804 $**	943 534 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2024	Série I 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**11 185 486 $**	14 815 438 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**1 716 285**	388 385
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**22 448**	15 002
Rachat de parts rachetables	**(7 173)**	(4 640 081)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**15 275**	(4 625 079)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**1 731 560**	(4 236 694)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**12 917 046 $**	10 578 744 $

	Total 2024	Total 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**13 397 015 $**	18 494 464 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**3 246 178**	578 893
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**16 695 746**	606 266
Rachat de parts rachetables	**(713 806)**	(7 700 970)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**15 981 940**	(7 094 704)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**19 228 118**	(6 515 811)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**32 625 133 $**	11 978 653 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

	2024	2023
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**3 246 178 $**	578 893 $
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	**(194 023)**	(35 894)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	**(1 182 755)**	(928 126)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	**2 557 786**	257 565
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	**(596 287)**	119 988
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	**(1 084 145)**	547 046
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	**(3 913)**	(151 124)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	**600 792**	(210 455)
Achat de placements	**(96 914 332)**	(51 637 394)
Produit de la vente de placements	**100 878 494**	66 330 657
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	**(10 351 589)**	399 944
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	**(33 253)**	28 951
(Augmentation) diminution des autres créances	**18**	(32 868)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	**1 295**	(6 277)
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**23 465**	24 785
Augmentation (diminution) des charges à payer	**9 961**	(41 100)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	**12 948**	(225)
Augmentation (diminution) de la rémunération au rendement à payer	**196 954**	(5 991)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	**(2 832 406)**	15 238 375
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	**16 673 990**	555 196
Rachat de parts rachetables	**(675 210)**	(7 700 970)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	**15 998 780**	(7 145 774)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	**13 166 374**	8 092 601
Variation du gain (perte) de change latent	**194 023**	35 894
Trésorerie, à l'ouverture de la période	**12 098 607**	2 409 454
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	**–**	(3 388 108)
	25 459 004	7 149 841
Trésorerie, à la clôture de la période	**25 459 004 $**	7 197 713 $
Dette bancaire, à la clôture de la période	**– $**	(47 872) $
	25 459 004 $	7 149 841 $
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	**383 830 $**	288 372 $
Dividendes payés*	**(221 207)**	(81 213)
Intérêts reçus*	**698 631**	95 510
Intérêts payés*	**(112 910)**	(80 616)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Actions canadiennes – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 2,55 %)				
Bonterra Energy Corp.	400	3 692	2 060	
Corporation Cameco, TSE	2 900	176 559	195 199	
Canadian Natural Resources Ltd.	1 700	86 099	82 841	
Cenovus Energy Inc.	9 300	254 366	250 077	
Crew Energy Inc.	2 600	9 560	11 154	
Ensign Energy Services Inc.	500	1 051	1 140	
Gear Energy Ltd.	1 500	1 692	1 035	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée	400	37 191	37 312	
Parex Resources Inc.	1 186	27 500	25 997	
Suncor Énergie Inc.	5 900	300 801	307 688	
Tourmaline Oil Corp.	4 200	261 988	260 610	
Valeura Energy Inc	4 600	18 727	19 780	
Whitecap Resources Inc.	300	3 144	3 003	
Yangarra Resources Ltd.	1 200	3 153	1 272	
		1 185 523	1 199 168	3,68
Matières premières (31 décembre 2023 : 1,42 %)				
Aris Mining Corp.	800	4 566	4 136	
Barrick Gold Corp.	700	16 709	15 974	
Calibre Mining Corp.	1 800	1 934	3 240	
Cascades inc.	1 300	16 221	11 739	
Centerra Gold Inc.	400	3 745	3 680	
Chemtrade Logistics Income Fund	1 527	13 209	14 109	
Interfor Corp.	1 300	28 869	21 476	
Ivanhoe Mines Ltd.	3 000	45 532	52 950	
Liberty Gold Corp.	4 796	5 276	1 511	
Lucara Diamond Corp.	2 000	3 243	660	
Neo Performance Materials Inc.	200	2 247	1 650	
New Gold Inc.	7 700	11 814	20 790	
Nutrien Ltd.	1 900	142 036	132 335	
OceanaGold Corp.	9 699	26 606	30 455	
Minière Osisko Inc.	2 400	9 633	6 864	
Pan American Silver Corp.	500	13 081	13 595	
Silvercorp Metals Inc.	1 800	11 017	8 244	
Western Forest Products Inc.	100	180	46	
Wheaton Precious Metals Corp.	1 300	96 263	93 249	
		452 181	436 703	1,34
Industries (31 décembre 2023 : 1,85 %)				
ATS Corp.	800	30 476	35 416	
Black Diamond Group Ltd.	1 900	3 999	15 390	
Calian Group Ltd.	100	6 362	5 625	
Civeo Corp.	62	1 051	2 114	
Doman Building Materials Group Ltd.	500	3 491	3 460	
Héroux-Devtek Inc.	300	5 378	7 470	
Magellan Aerospace Corp.	500	6 219	4 070	
NFI Group Inc.	400	4 495	6 336	
		61 471	79 881	0,24
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 0,03 %)				
Les Industries Dorel Inc., cat B	500	5 518	3 475	
Roots Corp.	500	1 465	1 025	
		6 983	4 500	0,01
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : néant)				
Alimentation Couche-Tard Inc.	2 100	159 519	161 217	0,49

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Soins de santé (31 décembre 2023 : 0,01 %)				
Xbiotech Inc.	200	1 018	1 407	–
Services financiers (31 décembre 2023 : 0,21 %)				
Power Corporation du Canada	2 100	79 358	79 842	0,24
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 0,40 %)				
BlackBerry Ltd.	500	1 802	1 710	
CGI Inc.	1 100	152 515	150 205	
Quarterhill Inc.	2 400	3 540	4 248	
		157 857	156 163	0,48
Services de communication (31 décembre 2023 : 0,65 %)				
Aimia Inc.	7 707	28 188	20 809	
BCE Inc.	4 300	198 955	190 533	
		227 143	211 342	0,65
Services publics (31 décembre 2023 : 1,39 %)				
Boralex Inc.	1 100	39 250	36 861	
Brookfield Renewable Corp.	100	4 341	3 876	
Northland Power Inc.	716	18 937	16 840	
Polaris Renewable Energy Inc.	1 100	19 062	14 102	
Superior Plus Corp.	2 428	28 830	21 536	
		110 420	93 215	0,29
Immobilier (31 décembre 2023 : 1,62 %)				
FPI Granite	900	82 430	61 011	
InterRent REIT	900	11 238	10 719	
Killam Apartment REIT	1 100	22 694	18 744	
Morguard North American Residential Real Estate Investment	1 000	15 747	15 480	
		132 109	105 954	0,32
Total des actions canadiennes – position acheteur		2 573 582	2 529 392	7,74
Actions canadiennes – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -1,50 %)				
Baytex Energy Corp.	(900)	(4 183)	(4 266)	
Denison Mines Corp.	(18 500)	(33 779)	(50 690)	
Energy Fuels Inc., NYSE	(6 031)	(42 582)	(50 010)	
Energy Fuels Inc., TSE	(6 000)	(48 773)	(49 740)	
Journey Energy Inc.	(2 000)	(9 072)	(6 120)	
NexGen Energy Ltd.	(6 600)	(62 999)	(62 964)	
Uranium Royalty Corp.	(200)	(643)	(620)	
		(202 031)	(224 410)	(0,69)
Matières premières (31 décembre 2023 : -0,70 %)				
Algoma Steel Group Inc.	(100)	(950)	(949)	
Canfor Pulp Products Inc.	(200)	(1 851)	(212)	
Endeavour Silver Corp.	(1 200)	(5 785)	(5 772)	
Equinox Gold Corp.	(1 200)	(8 742)	(8 568)	
Global Atomic Corp.	(1 100)	(2 474)	(2 266)	
I-80 Gold Corp.	(7 300)	(15 248)	(10 512)	
Largo Inc.	(1 000)	(4 424)	(2 520)	
Lithium Americas Argentina Corp.	(7 000)	(57 297)	(30 520)	
Novagold Resources Inc.	(1 900)	(11 173)	(9 101)	
Orla Mining Ltd.	(1 000)	(4 901)	(5 250)	
Sandstorm Gold Ltd	(1 100)	(6 860)	(8 184)	
Skeena Resources Ltd.	(700)	(5 597)	(5 138)	
SSR Mining Inc.	(4 200)	(28 300)	(25 956)	
		(153 602)	(114 948)	(0,35)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2023 : -1,21%)				
Ballard Power Systems Inc.	(6 900)	(31 683)	(21 321)	
Chorus Aviation Inc.	(1 000)	(3 742)	(2 420)	
GFL Environmental Inc., TSE	(200)	(9 543)	(10 656)	
La Compagnie Électrique Lion	(4 900)	(13 650)	(6 027)	
PyroGenèse Canada Inc.	(2 462)	(8 485)	(1 699)	
RB Global Inc., TSE	(800)	(84 152)	(83 472)	
TELUS International CDA Inc.	(400)	(5 063)	(3 160)	
Xebec Adsorption Inc.	(4 300)	(9 817)	(1 645)	
		(166 135)	(130 400)	(0,40)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -0,58 %)				
Magna International Inc.	(3 400)	(210 009)	(194 956)	
Groupe d'Alimentation MTY Inc.	(500)	(31 237)	(22 470)	
Pet Valu Holdings Ltd.	(200)	(5 588)	(5 262)	
Restaurant Brands International Inc.	(100)	(9 630)	(9 640)	
		(256 464)	(232 328)	(0,71)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -0,37 %)				
SunOpta Inc.	(6 100)	(37 426)	(44 896)	(0,14)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -1,09 %)				
Cronos Group Inc.	(5 800)	(23 104)	(18 502)	
Dentalcorp Holdings Ltd.	(100)	(639)	(824)	
Oncolytics Biotech Inc.	(600)	(1 572)	(810)	
Organigram Holdings Inc.	(5 575)	(14 157)	(11 763)	
SNDL Inc.	(15 208)	(52 286)	(39 539)	
		(91 758)	(71 438)	(0,22)
Services financiers (31 décembre 2023 : -0,39 %)				
ECN Capital Corp.	(10 800)	(27 117)	(18 036)	(0,06)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -1,32 %)				
Bitfarms Ltd.	(13 900)	(45 864)	(49 067)	
Canadian Solar Inc.	(2 717)	(88 422)	(54 837)	
Converge Technology Solutions Corp.	(2 300)	(8 400)	(9 890)	
Dye & Durham Ltd.	(1 400)	(23 504)	(17 248)	
Lightspeed Commerce Inc.	(1 200)	(25 181)	(22 440)	
		(191 371)	(153 482)	(0,47)
Services de communication (31 décembre 2023 : -0,03 %)				
IMAX Corp.	(292)	(6 635)	(6 701)	
WildBrain Ltd.	(600)	(1 398)	(672)	
		(8 033)	(7 373)	(0,02)
Immobilier (31 décembre 2023 : -0,34 %)				
DREAM Unlimited Corp.	(200)	(3 918)	(3 930)	
Morguard REIT	(100)	(533)	(530)	
NorthWest Healthcare Properties REIT	(3 600)	(14 879)	(16 776)	
True North Commercial REIT	(1)	(16)	(9)	
		(19 346)	(21 245)	(0,07)
Total des actions canadiennes – position vendeur		(1 153 283)	(1 018 556)	(3,13)
Actions américaines – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 0,20 %)				
CNX Resources Corp.	164	5 645	5 453	
ConocoPhillips	246	38 263	38 502	
CONSOL Energy Inc.	27	3 602	3 770	
Diamondback Energy Inc.	22	5 873	6 026	
Forum Energy Technologies Inc.	11	428	254	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
NACCO Industries Inc.	8	549	303	
Peabody Energy Corp.	599	18 227	18 130	
Smart Sand Inc.	745	1 827	2 151	
		74 414	74 589	0,23
Matières premières (31 décembre 2023 : 0,58 %)				
Alcoa Corp.	36	1 938	1 960	
Coronado Global Resources Inc.	15 176	22 542	16 434	
Huntsman Corp.	2 039	63 485	63 530	
International Flavors & Fragrances Inc.	17	2 225	2 215	
International Paper Co.	273	16 083	16 119	
McEwen Mining Inc.	530	5 735	6 652	
Rayonier Advanced Materials Inc.	47	345	350	
		112 353	107 260	0,33
Industries (31 décembre 2023 : 2,51 %)				
3M Co.	163	22 918	22 792	
ACCO Brands Corp.	886	5 405	5 698	
American Superconductor Corp.	414	8 965	13 250	
ARC Document Solutions Inc.	100	477	361	
BGSF Inc.	42	713	491	
Concrete Pumping Holdings Inc.	437	3 982	3 594	
EMCOR Group Inc.	34	17 190	16 985	
Ennis Inc.	1 733	49 618	51 909	
Global Industrial Co.	287	10 154	12 316	
Graham Corp.	150	2 694	5 780	
HNI Corp.	75	2 795	4 620	
Hurco Cos Inc.	160	5 362	3 341	
LSI Industries Inc.	884	14 034	17 503	
Mistras Group Inc.	132	1 154	1 497	
Moog Inc.	12	2 730	2 747	
NL Industries Inc.	100	822	825	
Park-Ohio Holdings Corp.	150	2 635	5 314	
Powell Industries Inc.	81	5 178	15 894	
RCM Technologies Inc.	225	6 211	5 763	
Science Applications International Corp.	146	23 518	23 484	
Steelcase Inc.	338	3 772	5 994	
TransUnion	30	3 044	3 044	
Twin Disc Inc.	470	7 265	7 576	
UniFirst Corp.	1	238	235	
V2X Inc.	200	11 124	13 125	
		211 998	244 138	0,75
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 0,66 %)				
Abercrombie & Fitch Co.	28	6 699	6 814	
Biglari Holdings Inc.	90	14 110	23 815	
Chegg Inc.	62	1 625	268	
Chewy Inc.	138	5 036	5 144	
Lindblad Expeditions Holdings Inc.	17	242	224	
Newell Brands Inc.	320	2 817	2 807	
Noodles & Co.	54	360	117	
		30 889	39 189	0,12
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : 0,01 %)				
Altria Group Inc.	70	4 360	4 363	
Conagra Brands Inc.	8	323	311	
Village Super Market Inc.	34	1 020	1 229	
		5 703	5 903	0,02
Soins de santé (31 décembre 2023 : 2,38 %)				
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	2 483	58 521	55 211	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Agios Pharmaceuticals Inc.	226	13 679	13 335	
Akebia Therapeutics Inc.	515	463	719	
ALX Oncology Holdings Inc.	83	749	685	
AMN Healthcare Services Inc.	11	1 317	771	
ANI Pharmaceuticals Inc.	32	2 794	2 788	
Axogen Inc.	1 084	13 593	10 739	
BioAtla Inc.	1 359	4 664	2 548	
BioCryst Pharmaceuticals Inc.	802	7 796	6 782	
Biogen Inc.	12	3 747	3 807	
CareDx Inc.	161	3 620	3 421	
Chimerix Inc.	675	4 668	809	
Clover Health Investments Corp.	709	1 011	1 193	
Corcept Therapeutics Inc.	656	20 367	29 164	
CytomX Therapeutics Inc.	1 262	3 444	2 107	
Embecta Corp.	118	4 235	2 018	
Epizyme Inc., droits	3	–	4	
Esperion Therapeutics Inc.	129	491	392	
Eton Pharmaceuticals Inc.	100	474	450	
GoodRx Holdings Inc.	509	4 348	5 433	
Halozyme Therapeutics Inc.	129	9 149	9 242	
Hims & Hers Health Inc.	275	8 541	7 597	
Ideaya Biosciences Inc.	115	6 692	5 525	
Insmed Inc.	160	14 900	14 669	
Ionis Pharmaceuticals Inc.	86	5 590	5 609	
iRadimed Corp.	18	1 016	1 082	
Karyopharm Therapeutics Inc.	88	443	104	
KORU Medical Systems Inc.	200	1 096	725	
Kura Oncology Inc.	48	1 345	1 352	
Larimar Therapeutics Inc.	100	585	992	
Lineage Cell Therapeutics Inc.	233	369	318	
MannKind Corp.	2 223	15 308	15 878	
Medpace Holdings Inc.	11	5 913	6 199	
Myriad Genetics Inc.	99	3 317	3 314	
Novavax Inc.	39	718	676	
Owens & Minor Inc.	90	1 704	1 663	
PDL BioPharma Inc.	1 415	5 052	–	
Protagonist Therapeutics Inc.	186	6 651	8 819	
Puma Biotechnology Inc.	327	1 376	1 459	
Rhythm Pharmaceuticals Inc.	15	831	843	
Sarepta Therapeutics Inc.	20	4 364	4 324	
Savara Inc.	1 101	2 569	6 071	
Tandem Diabetes Care Inc.	83	4 597	4 576	
Tilray Brands Inc.	2 600	7 065	5 902	
Travere Therapeutics Inc.	567	16 312	6 377	
Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	44	2 528	2 475	
United Therapeutics Corp.	34	12 607	14 820	
Vanda Pharmaceuticals Inc.	140	1 507	1 082	
Y-mAbs Therapeutics Inc.	305	2 526	5 042	
		294 652	279 111	0,86
Services financiers (31 décembre 2023 : 0,45 %)				
Block Inc.	372	33 355	32 827	
Crawford & Co., cat. A	29	360	343	
Crawford & Co., cat. B	108	821	1 184	
Donnelley Financial Solutions Inc.	207	17 495	16 887	
Eagle Bancorp Inc.	5	363	129	
eHealth Inc.	1 582	18 300	9 806	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
ESSA Bancorp Inc.	100	2 174	2 407	
Heritage Insurance Holdings Inc.	399	1 878	3 865	
Jackson Financial Inc.	11	1 094	1 118	
Medallion Financial Corp.	147	1 248	1 545	
Remitly Global Inc.	280	6 323	4 644	
Selectquote Inc.	706	2 075	2 666	
Universal Insurance Holdings Inc.	188	4 744	4 826	
Visa Inc.	197	72 701	70 752	
Western New England Bancorp Inc.	69	925	650	
		163 856	153 649	0,47
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 4,15 %)				
Alarm.com Holdings Inc.	147	9 765	12 781	
Arlo Technologies Inc.	148	1 526	2 641	
BILL Holdings Inc.	442	29 181	31 825	
Brightcove Inc., droits	1 756	10 543	5 695	
Broadcom Inc.	72	156 763	158 178	
CEVA Inc.	7	391	185	
Cirrus Logic Inc.	22	3 103	3 843	
Clear Secure Inc.	14	560	358	
CPI Card Group Inc.	308	18 159	11 485	
Crowdstrike Holdings Inc.	9	4 734	4 719	
Daktronics Inc.	37	674	706	
Dropbox Inc.	1 106	33 738	34 006	
F-Secure Oyj	1 347	6 153	3 832	
Guidewire Software Inc.	165	14 973	31 132	
Jabil Inc.	344	52 779	51 209	
Jamf Holding Corp.	1 055	27 599	23 819	
Kyndryl Holdings Inc.	258	9 105	9 288	
Magnachip Semiconductor Corp.	1 719	21 531	11 455	
Micron Technology Inc.	35	6 349	6 299	
nCino Inc.	322	10 399	13 857	
NetScout Systems Inc.	791	19 735	19 796	
Qualys Inc.	32	6 243	6 244	
Rapid7 Inc.	442	24 873	26 146	
Rimini Street Inc.	740	4 068	3 109	
SentinelOne Inc.	63	1 493	1 815	
Texas Instruments Inc.	40	10 583	10 647	
Varonis Systems Inc.	109	7 112	7 155	
Viavi Solutions Inc.	364	3 455	3 422	
WM Technology Inc.	684	811	973	
		496 398	496 620	1,52
Services de communication (31 décembre 2023 : 0,79 %)				
Alphabet Inc., cat. C	281	71 284	70 526	
Altice USA Inc.	3	32	8	
Angi Inc.	310	3 765	814	
Bandwidth Inc.	57	2 326	1 317	
HUUUGE Inc.	497	4 303	4 001	
Lumen Technologies Inc.	3 693	25 630	5 559	
Meta Platforms Inc.	23	15 946	15 869	
NII Holdings Inc.	992	2 791	353	
Pinterest Inc.	544	33 066	32 805	
Playstudios Inc.	205	1 134	581	
Snap Inc.	134	2 781	3 046	
Spok Holdings Inc.	583	10 779	11 815	
United States Cellular Corp.	9	658	687	
		174 495	147 381	0,45

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Services publics (31 décembre 2023 : 0,04 %)				
Total des actions américaines – positions acheteur		1 564 758	1 547 840	4,75
Actions américaines – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -1,16 %)				
Aemetis Inc.	(921)	(5 107)	(3 793)	
Civitas Resources Inc.	(250)	(24 677)	(23 604)	
Core Laboratories Inc.	(496)	(12 356)	(13 771)	
Evolution Petroleum Corp.	(299)	(2 305)	(2 156)	
Gevo Inc.	(2 494)	(3 710)	(1 902)	
KLX Energy Services Holdings Inc.	(299)	(2 032)	(2 025)	
New Fortress Energy Inc.	(7 166)	(263 274)	(215 526)	
NextDecade Corp.	(1 348)	(9 956)	(14 646)	
Nine Energy Service Inc.	(1 609)	(5 089)	(3 699)	
Northern Oil and Gas Inc.	(645)	(33 779)	(32 806)	
Par Pacific Holdings Inc.	(60)	(2 331)	(2 073)	
Patterson-UTI Energy Inc.	(2 394)	(36 185)	(33 937)	
ProPetro Holding Corp.	(98)	(1 108)	(1 163)	
RPC Inc.	(1 182)	(11 185)	(10 109)	
Select Water Solutions Inc.	(73)	(911)	(1 069)	
Sitio Royalties Corp.	(200)	(6 001)	(6 461)	
Talos Energy Inc.	(7 035)	(111 164)	(116 960)	
TETRA Technologies Inc.	(191)	(1 185)	(904)	
Tidewater Inc.	(176)	(19 741)	(22 929)	
Vertex Energy Inc.	(6 303)	(24 105)	(8 148)	
Vital Energy Inc.	(2 519)	(155 914)	(154 488)	
World Kinect Corp.	(260)	(8 679)	(9 179)	
		(740 794)	(681 348)	(2,09)
Matières premières (31 décembre 2023 : -4,19 %)				
Air Products and Chemicals Inc.	(227)	(83 612)	(80 154)	
Albemarle Corp.	(103)	(13 424)	(13 463)	
Alto Ingredients Inc.	(2)	(14)	(4)	
American Vanguard Corp.	(305)	(5 678)	(3 589)	
Aspen Aerogels Inc.	(784)	(13 156)	(25 586)	
Carpenter Technology Corp.	(336)	(30 603)	(50 381)	
Century Aluminum Co.	(1 897)	(44 488)	(43 479)	
Chemours Co.	(836)	(31 746)	(25 819)	
Compass Minerals International Inc.	(34)	(580)	(481)	
Corteva Inc.	(3 298)	(218 799)	(243 420)	
Danimer Scientific Inc.	(101)	(142)	(83)	
Danimer Scientific Inc., bons de souscription, éch. le 3 mai 2029	(34)	–	–	
Intrepid Potash Inc.	(47)	(1 238)	(1 507)	
Kaiser Aluminum Corp.	(1)	(84)	(120)	
Loop Industries Inc.	(386)	(1 358)	(1 104)	
LSB Industries Inc.	(67)	(894)	(750)	
Materion Corp.	(3)	(521)	(444)	
MP Materials Corp.	(5 042)	(114 899)	(87 827)	
Myers Industries Inc.	(16)	(379)	(293)	
Origin Materials Inc.	(382)	(555)	(471)	
Pactiv Evergreen Inc.	(37)	(681)	(573)	
Piedmont Lithium Inc.	(347)	(11 809)	(4 739)	
PureCycle Technologies Inc.	(1 768)	(12 477)	(14 322)	
Radius Recycling Inc.	(228)	(7 658)	(4 764)	
Ranpak Holdings Corp.	(7)	(353)	(62)	
Ryerson Holding Corp.	(30)	(944)	(800)	(1,85)
		(596 092)	(604 235)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Industries (31 décembre 2023 : -6,16 %)				
3D Systems Corp.	(2 543)	(16 842)	(10 683)	
AeroVironment Inc.	(126)	(30 519)	(31 406)	
AerSale Corp.	(116)	(1 861)	(1 098)	
Allegiant Travel Co.	(647)	(49 287)	(44 470)	
Ameresco Inc.	(2 524)	(93 432)	(99 501)	
Array Technologies Inc.	(3 923)	(78 573)	(55 076)	
Avis Budget Group Inc.	(90)	(14 931)	(12 872)	
AZZ Inc.	(33)	(3 434)	(3 488)	
Blade Air Mobility Inc.	(1 594)	(7 287)	(7 590)	
Blink Charging Co.	(3 347)	(11 753)	(12 549)	
Bloom Energy Corp.	(7 047)	(135 415)	(118 027)	
ChargePoint Holdings Inc.	(12 437)	(26 959)	(25 697)	
Chart Industries Inc.	(493)	(103 938)	(97 371)	
Core & Main Inc.	(167)	(11 054)	(11 183)	
Delta Air Lines Inc.	(3 925)	(212 522)	(254 789)	
Desktop Metal Inc.	(64)	(374)	(362)	
Douglas Dynamics Inc.	(38)	(1 326)	(1 217)	
Energy Recovery Inc.	(54)	(1 379)	(982)	
Eos Energy Enterprises Inc.	(8 578)	(11 083)	(14 907)	
Esab Corp.	(17)	(2 567)	(2 197)	
Exponent Inc.	(132)	(15 638)	(17 181)	
Fluence Energy Inc.	(7 437)	(188 710)	(176 458)	
Forward Air Corp.	(1 657)	(42 768)	(43 170)	
Franklin Covey Co.	(11)	(579)	(572)	
FuelCell Energy Inc.	(44 630)	(65 070)	(39 011)	
GrafTech International Ltd.	(20)	(48)	(27)	
Greenbrier Cos Inc.	(333)	(21 510)	(22 578)	
GXO Logistics Inc.	(521)	(35 676)	(36 002)	
Hayward Holdings Inc.	(995)	(16 458)	(16 746)	
Heartland Express Inc.	(1 053)	(15 895)	(17 766)	
Herc Holdings Inc.	(719)	(151 925)	(131 136)	
Hub Group Inc.	(152)	(8 845)	(8 954)	
Insteel Industries Inc.	(45)	(2 099)	(1 906)	
JELD-WEN Holding Inc.	(797)	(17 824)	(14 690)	
JetBlue Airways Corp.	(12 525)	(97 981)	(104 374)	
Korn Ferry	(34)	(2 631)	(3 124)	
L3Harris Technologies Inc.	(312)	(92 739)	(95 878)	
Landstar System Inc.	(38)	(9 185)	(9 592)	
MasTec Inc.	(583)	(73 173)	(85 351)	
Masterbrand Inc.	(4)	(44)	(80)	
Mercury Systems Inc.	(138)	(5 251)	(5 097)	
Nikola Corp.	(1 939)	(52 253)	(21 730)	
NuScale Power Corp.	(3 323)	(29 490)	(53 155)	
Plug Power Inc.	(4 771)	(18 952)	(15 211)	
Rocket Lab USA Inc.	(2 659)	(17 788)	(17 464)	
RXO Inc.	(55)	(1 602)	(1 968)	
Shoals Technologies Group Inc.	(5 249)	(78 672)	(44 818)	
SkyWest Inc.	(447)	(35 710)	(50 198)	
Spirit AeroSystems Holdings Inc.	(1 540)	(65 269)	(69 265)	
Standex International Corp.	(3)	(548)	(662)	
Stem Inc.	(8 312)	(17 811)	(12 625)	
Sunrun Inc.	(3 768)	(70 719)	(61 149)	
Symbotic Inc.	(1 341)	(72 271)	(64 517)	
TaskUS Inc.	(143)	(2 523)	(2 604)	
Terex Corp.	(72)	(6 060)	(5 403)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Textron Inc.	(1)	(47)	(117)	
Titan International Inc.	(156)	(2 091)	(1 582)	
TPI Composites Inc.	(7)	(388)	(38)	
Trex Co Inc.	(733)	(88 368)	(74 342)	
TriNet Group Inc.	(22)	(3 063)	(3 010)	
Vicor Corp.	(284)	(13 912)	(12 886)	
Wheels Up Experience Inc.	(1 173)	(3 498)	(3 034)	
		(2 259 620)	(2 150 936)	(6,59)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -6,72 %)				
1-800-Flowers.com Inc.	(175)	(2 253)	(2 280)	
ADT Inc.	(261)	(2 319)	(2 714)	
America's Car-Mart Inc.	(133)	(12 905)	(10 958)	
AMMO Inc.	(899)	(6 274)	(2 067)	
Asbury Automotive Group Inc.	(9)	(2 514)	(2 806)	
AutoNation Inc.	(19)	(4 313)	(4 144)	
BARK Inc.	(1 691)	(2 132)	(4 188)	
Bowlero Corp.	(186)	(3 167)	(3 688)	
Brinker International Inc.	(325)	(26 598)	(32 193)	
Burlington Stores Inc.	(74)	(20 001)	(24 302)	
Caesars Entertainment Inc.	(1 080)	(55 545)	(58 728)	
Camping World Holdings Inc.	(1 369)	(45 415)	(33 456)	
Canoo Inc.	(1 197)	(2 610)	(3 489)	
Carvana Co.	(194)	(25 167)	(34 170)	
Cavco Industries Inc.	(33)	(14 286)	(15 631)	
Churchill Downs Inc.	(74)	(13 199)	(14 136)	
Citi Trends Inc.	(28)	(1 033)	(815)	
Crocs Inc.	(30)	(6 269)	(5 991)	
Dave & Buster's Entertainment Inc.	(287)	(17 150)	(15 634)	
Designer Brands Inc.	(1 253)	(14 705)	(11 710)	
Dorman Products Inc.	(17)	(2 036)	(2 128)	
Dutch Bros Inc.	(1 148)	(49 159)	(65 034)	
Ethan Allen Interiors Inc.	(33)	(1 311)	(1 259)	
European Wax Center Inc.	(39)	(925)	(530)	
Everi Holdings Inc.	(105)	(1 233)	(1 207)	
EVgo Inc.	(10 335)	(37 408)	(34 648)	
Expedia Group Inc.	(711)	(118 440)	(122 575)	
Flexsteel Industries Inc.	(13)	(442)	(553)	
Freyr Battery Inc.	(899)	(2 295)	(2 091)	
GameStop Corp.	(758)	(14 618)	(25 536)	
Gap Inc.	(1 159)	(34 152)	(37 887)	
Gentherm Inc.	(89)	(6 686)	(6 006)	
GrowGeneration Corp.	(375)	(13 215)	(1 103)	
Guess? Inc.	(100)	(3 190)	(2 791)	
Kura Sushi USA Inc.	(10)	(858)	(863)	
Light & Wonder Inc.	(58)	(7 807)	(8 324)	
Lithia Motors Inc.	(166)	(58 105)	(57 343)	
Lovesac Co.	(399)	(13 359)	(12 328)	
Lucid Group Inc.	(4 782)	(49 776)	(17 078)	
Lululemon Athletica Inc.	(6)	(2 617)	(2 452)	
Luminar Technologies Inc.	(1 366)	(2 807)	(2 785)	
MarineMax Inc.	(293)	(11 127)	(12 978)	
Marriott International Inc.	(448)	(145 755)	(148 209)	
MGM Resorts International	(284)	(16 069)	(17 270)	
Mohawk Industries Inc.	(574)	(84 025)	(89 217)	
Movado Group Inc.	(23)	(794)	(782)	
OneWater Marine Inc.	(296)	(11 230)	(11 167)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
O'Reilly Automotive Inc.	(32)	(46 432)	(46 242)	
Patrick Industries Inc.	(99)	(14 512)	(14 705)	
Peloton Interactive Inc.	(7 794)	(39 938)	(36 047)	
PetMed Express Inc.	(300)	(1 655)	(1 663)	
Planet Fitness Inc.	(47)	(4 596)	(4 733)	
Purple Innovation Inc.	(178)	(370)	(253)	
RealReal Inc.	(447)	(2 183)	(1 951)	
Red Rock Resorts Inc.	(1 467)	(100 551)	(110 264)	
Rivian Automotive Inc.	(8 340)	(115 012)	(153 149)	
Shake Shack Inc.	(30)	(3 806)	(3 695)	
Shoe Carnival Inc.	(41)	(1 110)	(2 070)	
Solid Power Inc.	(2 394)	(8 404)	(5 405)	
Sonic Automotive Inc.	(72)	(5 090)	(5 366)	
Starbucks Corp.	(404)	(44 342)	(43 036)	
Tesla Inc.	(315)	(79 126)	(85 292)	
ThredUp Inc.	(142)	(350)	(330)	
Topgolf Callaway Brands Corp.	(453)	(9 381)	(9 484)	
United Parks & Resorts Inc.	(21)	(1 441)	(1 561)	
Valvoline Inc.	(1 762)	(102 692)	(104 156)	
Victoria's Secret & Co.	(110)	(2 762)	(2 660)	
Visteon Corp.	(18)	(2 847)	(2 628)	
Wynn Resorts Ltd.	(44)	(5 389)	(5 389)	
XPEL Inc.	(515)	(28 192)	(25 059)	
		(1 587 475)	(1 632 382)	(5,00)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -1,45 %)				
Alico Inc.	(221)	(8 443)	(7 835)	
Andersons Inc.	(5)	(362)	(339)	
Beauty Health Co.	(1 290)	(5 379)	(3 389)	
BRC Inc.	(3 691)	(23 904)	(30 960)	
Calavo Growers Inc.	(314)	(13 038)	(9 753)	
Celsius Holdings Inc.	(883)	(81 081)	(68 979)	
Chefs' Warehouse Inc.	(1 165)	(45 419)	(62 346)	
Duckhorn Portfolio Inc.	(148)	(1 500)	(1 438)	
Inter Parfums Inc.	(17)	(3 127)	(2 699)	
Lifecore Biomedical Inc.	(701)	(6 270)	(4 921)	
Limoneira Co.	(50)	(1 085)	(1 424)	
Medifast Inc.	(140)	(5 230)	(4 180)	
Performance Food Group Co.	(27)	(2 662)	(2 442)	
Veru Inc.	(858)	(1 580)	(988)	
		(199 080)	(201 693)	(0,62)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -7,20 %)				
10X Genomics Inc.	(1 224)	(65 432)	(32 576)	
2seventy bio Inc.	(782)	(7 966)	(4 120)	
89bio Inc.	(1 652)	(21 241)	(18 107)	
Actinium Pharmaceuticals Inc.	(414)	(3 115)	(4 192)	
AdaptHealth Corp.	(113)	(1 506)	(1 546)	
Adaptive Biotechnologies Corp.	(385)	(2 100)	(1 907)	
Agilon health Inc.	(650)	(5 049)	(5 817)	
Allakos Inc.	(47)	(436)	(64)	
Allogene Therapeutics Inc.	(662)	(4 861)	(2 111)	
American Well Corp.	(998)	(1 908)	(444)	
Arcutis Biotherapeutics Inc.	(6 092)	(80 182)	(77 524)	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc.	(684)	(31 488)	(24 325)	
Arvinas Inc.	(409)	(20 475)	(14 898)	
Asensus Surgical Inc.	(956)	(1 491)	(436)	
Astrana Health Inc.	(100)	(4 720)	(5 550)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Astria Therapeutics Inc.	(61)	(1 276)	(760)	
Avid Bioservices Inc.	(214)	(2 090)	(2 091)	
Axsome Therapeutics Inc.	(95)	(9 788)	(10 464)	
Azenta Inc.	(191)	(16 559)	(13 752)	
Beam Therapeutics Inc.	(3 145)	(114 926)	(100 830)	
BioLife Solutions Inc.	(300)	(7 409)	(8 797)	
Bio-Techne Corp.	(473)	(49 122)	(46 374)	
Bluebird Bio Inc.	(1 753)	(10 547)	(2 361)	
Butterfly Network Inc.	(234)	(872)	(269)	
Caribou Biosciences Inc.	(1 387)	(10 757)	(3 113)	
Certara Inc.	(1 231)	(38 059)	(23 329)	
Charles River Laboratories International Inc.	(23)	(7 344)	(6 501)	
Citius Pharmaceuticals Inc.	(2 775)	(2 680)	(2 216)	
Coherus Biosciences Inc.	(2 572)	(14 612)	(6 089)	
CorMedix Inc.	(1 800)	(12 589)	(10 665)	
CorVel Corp.	(2)	(647)	(696)	
Cross Country Healthcare Inc.	(130)	(3 011)	(2 462)	
CryoPort Inc.	(34)	(788)	(321)	
CVRx Inc.	(423)	(10 762)	(6 940)	
CVS Health Corp.	(1 020)	(84 288)	(82 431)	
Definitive Healthcare Corp.	(166)	(1 973)	(1 240)	
Denali Therapeutics Inc.	(326)	(9 214)	(10 358)	
Dexcom Inc.	(1 189)	(214 482)	(184 465)	
Disc Medicine Inc.	(167)	(9 898)	(10 299)	
DocGo Inc.	(2 908)	(26 706)	(12 296)	
Doximity Inc.	(2 094)	(80 662)	(80 143)	
Eli Lilly & Co.	(7)	(8 539)	(8 672)	
Enanta Pharmaceuticals Inc.	(6)	(389)	(106)	
Enhabit Inc.	(3 621)	(52 365)	(44 197)	
Enliven Therapeutics Inc.	(13)	(431)	(416)	
Enzo Biochem Inc.	(1 686)	(5 341)	(2 515)	
Fate Therapeutics Inc.	(1 631)	(14 000)	(7 320)	
Fulcrum Therapeutics Inc.	(45)	(416)	(382)	
GE HealthCare Technologies Inc.	(93)	(10 072)	(9 916)	
Geron Corp.	(4 484)	(22 761)	(26 015)	
Ginkgo Bioworks Holdings Inc.	(34 794)	(55 755)	(15 916)	
Globus Medical Inc.	(83)	(7 615)	(7 779)	
Gossamer Bio Inc.	(437)	(554)	(539)	
Gritstone bio Inc.	(3 023)	(10 712)	(2 556)	
Guardant Health Inc.	(307)	(11 423)	(12 132)	
Humacyte Inc.	(1 600)	(7 694)	(10 509)	
Humana Inc.	(335)	(147 686)	(171 279)	
IDEXX Laboratories Inc.	(6)	(4 442)	(4 000)	
IGM Biosciences Inc.	(196)	(2 608)	(1 843)	
Inmune Bio Inc.	(83)	(1 229)	(1 002)	
Inovio Pharmaceuticals Inc.	(473)	(7 237)	(5 230)	
Intellia Therapeutics Inc.	(879)	(29 310)	(26 918)	
Intuitive Surgical Inc.	(48)	(28 277)	(29 218)	
iRhythm Technologies Inc.	(37)	(5 915)	(5 450)	
Joint Corp.	(350)	(4 568)	(6 734)	
Keros Therapeutics Inc.	(132)	(9 553)	(8 254)	
Kymera Therapeutics Inc.	(1 235)	(45 442)	(50 444)	
Marinus Pharmaceuticals Inc.	(310)	(1 908)	(496)	
Masimo Corp.	(10)	(1 891)	(1 723)	
MiNK Therapeutics Inc.	(8)	(23)	(10)	
Moderna Inc.	(485)	(66 272)	(78 808)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
National Research Corp.	(9)	(360)	(283)	
Neogen Corp.	(7 896)	(178 807)	(168 874)	
NeoGenomics Inc.	(1 295)	(26 788)	(24 578)	
Ocugen Inc.	(7 280)	(14 047)	(15 440)	
Ocular Therapeutix Inc.	(3 511)	(26 996)	(32 861)	
Omeros Corp.	(72)	(388)	(400)	
Optinose Inc.	(250)	(402)	(356)	
Outlook Therapeutics Inc.	(57)	(615)	(576)	
Pacific Biosciences of California Inc.	(5 198)	(10 261)	(9 744)	
Phathom Pharmaceuticals Inc.	(2 150)	(29 323)	(30 302)	
Precision BioSciences Inc.	(38)	(671)	(506)	
Progyny Inc.	(375)	(13 899)	(14 681)	
ProPhase Labs Inc.	(60)	(627)	(343)	
Quantum-Si Inc.	(922)	(3 739)	(1 325)	
Quest Diagnostics Inc.	(419)	(80 312)	(78 478)	
QuidelOrtho Corp.	(156)	(8 634)	(7 091)	
R1 RCM Inc.	(3 399)	(59 834)	(58 417)	
Recursion Pharmaceuticals Inc.	(770)	(9 612)	(7 902)	
Rigel Pharmaceuticals Inc.	(1)	(43)	(11)	
Rocket Pharmaceuticals Inc.	(87)	(2 879)	(2 563)	
Sana Biotechnology Inc.	(969)	(9 445)	(7 240)	
Schrodinger Inc.	(1 809)	(61 503)	(47 873)	
Senseonics Holdings Inc.	(953)	(1 418)	(520)	
Seres Therapeutics Inc.	(488)	(417)	(483)	
Simulations Plus Inc.	(180)	(10 043)	(11 975)	
Solid Biosciences Inc.	(60)	(717)	(466)	
Stereotaxis Inc.	(328)	(1 098)	(817)	
Stoke Therapeutics Inc.	(267)	(4 963)	(4 936)	
Tango Therapeutics Inc.	(116)	(1 505)	(1 362)	
Taysha Gene Therapies Inc.	(524)	(1 558)	(1 606)	
Treace Medical Concepts Inc.	(105)	(706)	(955)	
Twist Bioscience Corp.	(892)	(34 020)	(60 149)	
Universal Health Services Inc., cat. B	(39)	(9 870)	(9 869)	
Verve Therapeutics Inc.	(752)	(9 747)	(5 022)	
Viatris Inc.	(5 599)	(88 788)	(81 440)	
Vir Biotechnology Inc.	(348)	(10 445)	(4 238)	
X4 Pharmaceuticals Inc.	(742)	(1 620)	(589)	
		(2 273 559)	(2 057 529)	(6,31)
Services financiers (31 décembre 2023 : -5,14 %)				
Amerant Bancorp Inc.	(194)	(5 791)	(6 026)	
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc.	(97)	(1 517)	(1 299)	
ARMOUR Residential REIT Inc.	(4 461)	(113 198)	(118 299)	
Bank of Marin Bancorp	(35)	(685)	(775)	
BayCom Corp.	(33)	(822)	(919)	
Brighthouse Financial Inc.	(45)	(2 819)	(2 669)	
Chimera Investment Corp.	(97)	(1 808)	(1 699)	
Citizens & Northern Corp.	(31)	(1 004)	(759)	
Coastal Financial Corp.	(95)	(5 598)	(5 998)	
Columbia Financial Inc.	(25)	(515)	(512)	
Credit Acceptance Corp.	(3)	(2 128)	(2 113)	
Dime Community Bancshares Inc.	(74)	(1 918)	(2 066)	
Federal Agricultural Mortgage Corp., cat. C	(2)	(355)	(495)	
Fidelity D&D Bancorp Inc.	(50)	(3 112)	(2 997)	
First Financial Northwest Inc.	(100)	(1 827)	(2 891)	
First Foundation Inc.	(1 287)	(14 745)	(11 535)	
First Guaranty Bancshares Inc.	(100)	(2 954)	(1 232)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Flushing Financial Corp.	(546)	(9 888)	(9 825)	
FVCBankcorp Inc.	(17)	(370)	(254)	
Goosehead Insurance Inc.	(96)	(7 786)	(7 545)	
HarborOne Bancorp Inc.	(422)	(5 405)	(6 427)	
Hingham Institution For Savings The	(69)	(21 749)	(16 889)	
I3 Verticals Inc.	(31)	(815)	(937)	
International Bancshares Corp.	(17)	(1 403)	(1 331)	
Intuitive Machines Inc.	(194)	(1 032)	(876)	
Invesco Mortgage Capital Inc.	(150)	(1 882)	(1 923)	
Lakeland Financial Corp.	(6)	(616)	(505)	
Live Oak Bancshares Inc.	(351)	(12 639)	(16 839)	
Metrocity Bankshares Inc.	(36)	(869)	(1 300)	
New York Mortgage Trust Inc.	(155)	(1 488)	(1 239)	
Old National Bancorp/IN	(948)	(21 222)	(22 299)	
OneMain Holdings Inc.	(977)	(66 389)	(64 825)	
Onity Group Inc.	(18)	(678)	(591)	
Open Lending Corp.	(490)	(4 475)	(3 741)	
Oscar Health Inc.	(401)	(9 416)	(8 681)	
Pacific Premier Bancorp Inc.	(648)	(21 120)	(20 367)	
Peapack-Gladstone Financial Corp.	(117)	(4 084)	(3 626)	
PennyMac Financial Services Inc.	(122)	(10 070)	(15 792)	
Popular Inc.	(184)	(21 703)	(22 265)	
Prudential Financial Inc.	(77)	(12 557)	(12 347)	
RBB Bancorp	(52)	(1 049)	(1 338)	
Riverview Bancorp Inc.	(310)	(2 586)	(1 693)	
Rocket Cos Inc.	(2 845)	(55 765)	(53 333)	
Seacoast Banking Corp. of Florida	(361)	(11 516)	(11 678)	
ServisFirst Bancshares Inc.	(213)	(16 037)	(18 417)	
Shift4 Payments Inc.	(1 000)	(98 473)	(100 368)	
Southern First Bancshares Inc.	(82)	(4 216)	(3 281)	
Texas Capital Bancshares Inc.	(5)	(346)	(418)	
TPG Inc.	(243)	(14 393)	(13 782)	
Triumph Financial Inc.	(220)	(21 157)	(24 610)	
Veritex Holdings Inc.	(236)	(6 352)	(6 811)	
Walker & Dunlop Inc.	(850)	(109 164)	(114 216)	
Webster Financial Corp.	(200)	(13 276)	(11 929)	
Western Alliance Bancorp	(364)	(20 549)	(31 289)	
World Acceptance Corp.	(2)	(296)	(338)	
		(773 627)	(796 209)	(2,44)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -9,68 %)				
ACM Research Inc.	(172)	(4 272)	(5 427)	
ADTRAN Holdings Inc.	(660)	(6 029)	(4 750)	
Aehr Test Systems	(42)	(611)	(642)	
Aeva Technologies Inc.	(7)	(369)	(24)	
Allegro MicroSystems Inc.	(662)	(26 740)	(25 581)	
Amkor Technology Inc.	(184)	(8 940)	(10 076)	
Applied Digital Corp.	(13 099)	(85 316)	(106 647)	
Applied Materials Inc.	(500)	(163 702)	(161 458)	
Applied Optoelectronics Inc.	(60)	(877)	(681)	
AppLovin Corp.	(1 309)	(138 751)	(149 061)	
Atomera Inc.	(77)	(702)	(401)	
Cisco Systems Inc.	(3 835)	(247 033)	(249 314)	
Clearfield Inc.	(760)	(35 406)	(40 100)	
Climb Global Solutions Inc.	(39)	(3 117)	(3 352)	
Cloudflare Inc.	(861)	(103 196)	(97 586)	
CommScope Holding Co Inc.	(833)	(1 734)	(1 402)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
CTS Corp.	(84)	(4 699)	(5 819)	
Digi International Inc.	(633)	(22 411)	(19 861)	
Digimarc Corp.	(88)	(3 549)	(3 734)	
Digital Turbine Inc.	(658)	(34 367)	(1 495)	
DigitalOcean Holdings Inc.	(342)	(17 824)	(16 262)	
DoubleVerify Holdings Inc.	(396)	(10 211)	(10 550)	
Duolingo Inc.	(98)	(25 405)	(27 982)	
D-Wave Quantum Inc.	(718)	(1 409)	(1 159)	
DXC Technology Co.	(497)	(12 808)	(12 982)	
E2open Parent Holdings Inc.	(249)	(1 195)	(1 530)	
Edgio Inc.	(306)	(7 808)	(4 572)	
Enfusion Inc.	(95)	(1 134)	(1 108)	
Enphase Energy Inc.	(468)	(76 282)	(63 853)	
Fair Isaac Corp.	(63)	(111 057)	(128 331)	
Fastly Inc.	(599)	(11 025)	(6 041)	
First Solar Inc.	(323)	(65 724)	(99 648)	
Forge Global Holdings Inc.	(358)	(1 132)	(715)	
Genasys Inc.	(100)	(456)	(289)	
Grid Dynamics Holdings Inc.	(28)	(392)	(403)	
Harmonic Inc.	(2 530)	(43 528)	(40 747)	
HubSpot Inc.	(3)	(2 370)	(2 421)	
Indie Semiconductor Inc.	(7 709)	(67 685)	(65 085)	
Infinera Corp.	(947)	(7 270)	(7 892)	
IonQ Inc.	(6 435)	(62 259)	(61 901)	
KLA Corp.	(117)	(124 583)	(132 001)	
Lightwave Logic Inc.	(115)	(550)	(471)	
Luna Innovations Inc.	(995)	(8 277)	(4 357)	
MicroStrategy Inc.	(71)	(123 800)	(133 826)	
MicroVision Inc.	(933)	(3 240)	(1 353)	
Mitek Systems Inc.	(119)	(2 028)	(1 820)	
MKS Instruments Inc.	(280)	(43 833)	(50 030)	
Monolithic Power Systems Inc.	(121)	(93 478)	(136 045)	
Napco Security Technologies Inc.	(260)	(11 880)	(18 482)	
Navitas Semiconductor Corp.	(10 524)	(88 453)	(56 594)	
NextNav Inc.	(3 492)	(25 765)	(38 752)	
NVIDIA Corp.	(929)	(158 902)	(157 043)	
Palantir Technologies Inc.	(7 566)	(238 221)	(262 239)	
PAR Technology Corp.	(132)	(8 058)	(8 505)	
QUALCOMM Inc.	(619)	(172 110)	(168 707)	
Rackspace Technology Inc.	(440)	(1 147)	(1 794)	
Rekor Systems Inc.	(735)	(2 442)	(1 559)	
Richardson Electronics Ltd.	(746)	(10 168)	(12 137)	
Samsara Inc.	(1 376)	(58 459)	(63 452)	
ScanSource Inc.	(361)	(20 620)	(21 888)	
SiTime Corp.	(171)	(25 594)	(29 103)	
SoundHound AI Inc.	(11 434)	(78 369)	(61 800)	
Sprinklr Inc.	(457)	(5 554)	(6 016)	
Synopsys Inc.	(163)	(131 851)	(132 722)	
Universal Display Corp.	(44)	(12 561)	(12 659)	
Wrap Technologies Inc.	(648)	(3 954)	(1 773)	
Zebra Technologies Corp.	(324)	(132 316)	(136 962)	
		(3 005 008)	(3 092 972)	(9,48)
Services de communication (31 décembre 2023 : -1,38 %)				
AMC Entertainment Holdings Inc.	(6 755)	(31 376)	(46 031)	
AMC Networks Inc.	(1 919)	(41 281)	(25 366)	
Anterix Inc.	(82)	(3 493)	(4 442)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	(1 151)	(3 754)	(2 221)	
Daily Journal Corp.	(1)	(479)	(540)	
Entravision Communications Corp.	(152)	(917)	(422)	
EW Scripps Co.	(279)	(1 263)	(1 199)	
FuboTV Inc.	(7 038)	(18 185)	(11 942)	
Globalstar Inc.	(2 428)	(4 100)	(3 721)	
Gogo Inc.	(1 508)	(18 510)	(19 851)	
iHeartMedia Inc.	(221)	(366)	(330)	
Liberty Broadband Corp., cat. C	(28)	(1 958)	(2 100)	
Live Nation Entertainment Inc.	(763)	(95 928)	(97 869)	
Nexstar Media Group Inc.	(322)	(72 764)	(73 145)	
Paramount Global	(2 243)	(33 768)	(31 889)	
PubMatic Inc.	(1 731)	(35 081)	(48 106)	
Sphere Entertainment Co.	(399)	(19 422)	(19 142)	
Stagwell Inc.	(172)	(1 368)	(1 605)	
TKO Group Holdings Inc.	(668)	(96 539)	(98 709)	
Trade Desk Inc.	(958)	(120 739)	(128 033)	
		(601 291)	(616 663)	(1,89)
Services publics (31 décembre 2023 : -0,87 %)				
Altus Power Inc.	(165)	(1 023)	(885)	
Cadiz Inc.	(1 104)	(4 721)	(4 668)	
Energy Vault Holdings Inc.	(626)	(1 205)	(813)	
Genie Energy Ltd., cat. B	(33)	(715)	(660)	
MGE Energy Inc.	(466)	(45 496)	(47 645)	
Middlesex Water Co.	(112)	(8 734)	(8 009)	
NextEra Energy Inc.	(1 951)	(173 743)	(189 037)	
Public Service Enterprise Group Inc.	(812)	(78 919)	(81 888)	
Sempra	(789)	(82 551)	(82 116)	
Spruce Power Holding Corp.	(221)	(11 120)	(1 104)	
		(408 227)	(416 825)	(1,28)
Immobilier (31 décembre 2023 : -3,40 %)				
Apartment Investment and Management Co.	(590)	(5 656)	(6 693)	
Brixmor Property Group Inc.	(943)	(28 546)	(29 794)	
Compass Inc.	(465)	(2 346)	(2 291)	
Cousins Properties Inc.	(113)	(3 733)	(3 580)	
Empire State Realty Trust Inc.	(362)	(4 043)	(4 646)	
eXp World Holdings Inc.	(772)	(16 203)	(11 921)	
Farmland Partners Inc.	(687)	(10 576)	(10 839)	
FRP Holdings Inc.	(22)	(808)	(859)	
Gladstone Commercial Corp.	(69)	(1 200)	(1 347)	
Global Medical REIT Inc.	(1 341)	(17 473)	(16 661)	
Healthpeak Properties Inc.	(930)	(24 296)	(24 942)	
Hudson Pacific Properties Inc.	(6 088)	(70 638)	(40 070)	
Independence Realty Trust Inc.	(282)	(6 134)	(7 231)	
Macerich Co.	(4 508)	(97 433)	(95 242)	
Marcus & Millichap Inc.	(308)	(14 449)	(13 284)	
Maui Land & Pineapple Co Inc.	(113)	(1 830)	(3 409)	
Newmark Group Inc.	(2 366)	(29 731)	(33 120)	
Opendoor Technologies Inc.	(1 650)	(5 220)	(4 154)	
Sabra Health Care REIT Inc.	(216)	(4 300)	(4 552)	
Seritage Growth Properties	(612)	(6 864)	(3 911)	
SITE Centers Corp.	(1 627)	(30 587)	(32 281)	
SL Green Realty Corp.	(1 552)	(78 195)	(120 285)	
Stratus Properties Inc.	(100)	(3 858)	(3 451)	
Sun Communities Inc.	(42)	(6 701)	(6 916)	
Tejon Ranch Co.	(100)	(1 964)	(2 334)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Vornado Realty Trust	(74)	(2 189)	(2 662)	
		(474 973)	(486 475)	(1,49)
Total des actions américaines – position vendeur		(12 919 746)	(12 737 267)	(39,04)
Actions étrangères – position acheteur				
Énergie (31 décembre 2023 : 4,04 %)				
Aker Solutions ASA	5 389	23 272	30 611	
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	24 000	1 766	2 082	
Avance Gas Holding Ltd.	2 116	44 795	46 392	
BP Castrol KK	400	3 386	3 273	
BW Energy Ltd.	139	511	557	
BW LPG Ltd.	7 127	119 071	181 626	
BW Offshore Ltd.	256	1 057	1 012	
Channel Infrastructure NZ Ltd.	21 739	27 703	27 008	
D'Amico International Shipping SA	2 371	20 967	25 661	
Dyna-Mac Holdings Ltd.	47 100	17 122	19 735	
Dyna-Mac Holdings Ltd., bons de souscription, éch. le 22 oct. 2024	4 300	–	1 107	
E1 Corp.	111	6 359	8 496	
FLEX LNG Ltd.	204	5 168	7 692	
Galp Energia SGPS SA	1 210	33 831	34 993	
Hafnia Ltd.	3 688	37 472	42 514	
Harbour Energy PLC	4 290	23 447	23 130	
Horizon Oil Ltd.	5 935	832	976	
Hunting PLC	68	377	486	
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	3 000	19 271	26 578	
Inpex Corp.	1 400	28 125	28 189	
Ithaca Energy PLC	377	1 446	811	
Koninklijke Vopak NV	669	32 848	38 028	
Magnora ASA	4 388	19 082	15 423	
MMA Offshore Ltd.	26 618	37 189	62 758	
Nabors Industries Ltd.	7	797	682	
Nabors Industries Ltd., bons de souscription, éch. le 11 juin 2026	26	–	235	
Nordic American Tankers Ltd.	795	2 688	4 330	
Odfjell Drilling Ltd.	2 180	11 945	16 277	
Oil Refineries Ltd.	45 806	20 075	14 475	
SBM Offshore NV	2 563	53 727	53 750	
Semirara Mining & Power Corp.	30 900	25 456	24 312	
Soechi Lines Tbk PT	199 100	3 232	2 562	
Subsea 7 SA	1 300	29 655	33 547	
Teekay Corp.	1 014	12 605	12 446	
Tethys Oil AB	939	4 347	4 131	
TORM PLC	218	11 028	11 661	
Toyo Kanetsu KK	100	4 051	3 339	
United Tractors Tbk PT	4 300	9 991	7 896	
Viva Energy Group Ltd.	1 396	4 440	4 019	
		699 134	822 800	2,52
Matières premières (31 décembre 2023 : 3,94 %)				
Aica Kogyo Co., Ltd.	1 000	31 900	29 756	
Air Water Inc.	2 500	44 970	46 264	
ArcelorMittal SA, NYSE	44	1 371	1 381	
ARE Holdings Inc.	1 100	19 403	19 641	
ASIA Holdings Co., Ltd.	19	3 169	4 864	
Asia Pile Holdings Corp.	400	3 113	3 369	
Borregaard ASA	188	4 077	4 648	
Braskem SA, actions priv.	200	1 395	880	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Breedon Group PLC	174	1 150	1 165	
CAP SA	45	433	386	
Carlit Co., Ltd.	500	4 279	6 154	
Cementir Holding NV	1 261	15 207	17 235	
China BlueChemical Ltd.	4 000	1 406	1 556	
China Nonferrous Mining Corp. Ltd.	1 000	706	1 194	
Chuetsu Pulp & Paper Co., Ltd.	200	3 433	2 605	
Cia Brasileira de Aluminio	5 200	9 139	8 916	
Cia Siderurgica Nacional SA	400	1 519	1 272	
CK-San-Etsu Co., Ltd.	100	4 356	3 301	
Clariant AG	3 580	75 175	77 083	
Dai Nippon Toryo Co., Ltd.	800	6 681	9 003	
Daiichi Kigenso Kagaku-Kogyo Co., Ltd.	300	2 552	2 159	
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	100	1 844	2 909	
Dexco SA	9 400	20 393	15 191	
Dongil Industries Co., Ltd.	7	432	289	
Dongkuk Holdings Co., Ltd.	78	904	654	
DRDGOLD Ltd.	3 996	49 741	47 079	
DS Smith PLC	11 111	69 898	80 911	
Egypt Aluminium	293	832	810	
Elopak ASA	4 201	17 932	19 517	
Emerald Resources NL	17 805	50 548	57 437	
EMS-Chemie Holding AG	3	3 231	3 365	
Evolution Mining Ltd.	2 158	7 401	6 902	
Evonik Industries AG	1 236	33 999	34 531	
Fresnillo PLC	19 599	194 704	190 522	
Fujikura Kasei Co., Ltd.	2 000	8 677	9 391	
Fujimi Inc.	300	7 789	7 745	
Fujimori Kogyo Co., Ltd.	100	3 672	3 607	
Glencore PLC	5 451	43 301	42 533	
Granges AB	260	4 573	4 569	
Grupo Argos SA	387	2 245	2 157	
Gun-Ei Chemical Industry Co., Ltd.	300	8 043	8 434	
Hakudo Co., Ltd.	400	8 716	9 745	
Harima Chemicals Group Inc.	700	6 076	5 550	
Heidelberg Materials AG	262	37 093	37 201	
Hochschild Mining PLC	1 314	2 805	4 068	
Hokkan Holdings Ltd.	400	5 358	6 148	
Hokko Chemical Industry Co., Ltd.	100	885	1 267	
Holcim AG	93	11 251	11 275	
Huhtamaki Oyj	600	32 712	32 962	
IGO Ltd.	1 246	8 362	6 422	
Imerys SA	292	14 828	14 380	
Ishihara Chemical Co., Ltd.	300	4 606	5 915	
Japan Pure Chemical Co., Ltd.	500	12 396	14 908	
Jaya Tiasa Holdings BHD	44 200	8 437	13 846	
JCU Corp.	100	3 169	3 398	
JSP Corp.	800	14 878	15 734	
Jupiter Mines Ltd.	8 435	1 735	2 428	
K+S AG	3 101	60 702	57 188	
Kaneka Corp.	1 300	43 069	46 722	
Kemira Oyj	49	1 685	1 636	
Kenmare Resources PLC	5 120	27 853	27 941	
KGHM Polska Miedz SA	113	6 019	5 783	
KISCO Corp.	109	712	1 024	
Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	300	2 073	2 498	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Krosaki Harima Corp.	400	10 958	9 500	
Kumkang Kind Co., Ltd.	1 394	10 207	6 887	
Kurimoto Ltd.	400	8 285	15 941	
Kuriyama Holdings Corp.	100	877	1 057	
Kyowa Leather Cloth Co., Ltd.	300	1 730	2 034	
LANXESS AG	216	7 519	7 279	
Macmahon Holdings Ltd.	23 170	4 146	6 140	
Metals X Ltd.	6 986	2 771	2 681	
Mitsubishi Paper Mills Ltd.	1 100	5 525	7 738	
MMG Ltd.	20 000	10 591	10 446	
Moriroku Co., Ltd.	100	1 906	2 436	
Neturen Co., Ltd.	1 500	14 063	14 138	
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	1 600	17 133	17 789	
Nihon Yamamura Glass Co., Ltd.	400	5 130	5 621	
Nippon Carbide Industries Co Inc.	200	2 479	3 379	
Nippon Kayaku Co., Ltd.	500	6 204	5 221	
Nordic Paper Holding AB	2 089	12 267	13 145	
Noroo Holdings Co., Ltd.	195	2 087	2 477	
Norsk Hydro ASA	985	8 178	8 418	
Northern Star Resources Ltd.	3 997	49 247	47 485	
Okura Industrial Co., Ltd.	1 400	32 590	33 738	
Ora Banda Mining Ltd.	11 225	2 655	3 436	
Orora Ltd.	14 398	33 881	25 921	
Pan African Resources PLC	6 414	1 981	2 890	
Perenti Ltd.	9 117	9 235	8 332	
Perseus Mining Ltd.	3 497	6 691	7 510	
Poongsan Corp.	93	4 018	5 852	
POSCO Steeleon Co., Ltd.	15	1 033	688	
Ramelius Resources Ltd.	12 616	18 541	22 136	
Red 5 Ltd.	13 474	4 414	4 433	
Regis Resources Ltd.	7 993	14 288	12 819	
Resolute Mining Ltd.	6 908	2 463	3 283	
Rio Tinto PLC	143	12 992	12 901	
Sakata INX Corp.	1 300	17 065	19 949	
Salzgitter AG	25	899	662	
SAMHWA Paints Industrial Co., Ltd.	80	535	631	
Sanyo Chemical Industries Ltd.	800	32 705	27 119	
Sanyo Special Steel Co., Ltd.	100	2 279	1 810	
Sekisui Kasei Co., Ltd.	1 100	4 692	4 388	
Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	1 161	23 797	24 484	
Shikoku Kasei Holdings Corp.	400	5 542	7 247	
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	312 000	68 371	60 150	
Solvay SA	878	42 024	42 324	
South32 Ltd.	939	2 749	3 141	
St Barbara Ltd.	3 012	1 023	551	
Stanmore Resources Ltd.	16 730	59 250	54 122	
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	100	4 267	4 149	
Synthomer PLC	839	3 106	3 737	
Tayca Corp.	100	1 182	1 380	
Teijin Ltd.	1 000	11 723	11 369	
Ten Sixty Four Ltd.	1 777	1 048	463	
Thyssenkrupp AG	704	4 595	4 169	
Toho Zinc Co., Ltd.	4 700	45 542	33 983	
Tokyo Rope Manufacturing Co., Ltd.	600	6 175	6 900	
Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	800	12 413	11 099	
Tokyo Tekko Co., Ltd.	100	1 878	4 321	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Topy Industries Ltd.	800	15 451	16 938	
Toray Industries Inc.	5 600	35 758	36 275	
Tosoh Corp.	900	15 803	16 062	
Tsaker New Energy Tech Co., Ltd.	2 500	587	438	
Umicore SA	1 080	25 609	22 222	
West African Resources Ltd.	4 244	4 176	6 244	
West China Cement Ltd.	30 000	5 343	5 416	
Westgold Resources Ltd.	22 440	41 290	49 627	
Yamato Kogyo Co., Ltd.	100	6 696	6 657	
Yushiro Chemical Industry Co., Ltd.	400	4 501	6 234	
Zeon Corp.	100	1 371	1 136	
		1 916 543	1 938 572	5,94
Industries (31 décembre 2023 : 11,01 %)				
2020 Bulkers Ltd.	2 363	43 626	47 191	
ABB Ltd.	804	61 478	61 116	
Adecco Group AG	33	1 578	1 498	
Advan Group Co., Ltd.	1 100	10 225	9 133	
AFRY AB	89	1 919	2 185	
AG Anadolu Grubu Holding AS	1 464	18 962	22 227	
Aichi Corp.	900	7 927	9 547	
Alinco Inc.	400	3 947	3 733	
Alstom SA	3 797	90 501	87 424	
ANDRITZ AG	281	23 651	23 840	
Anest Iwata Corp.	400	4 345	5 594	
AP Moller – Maersk A/S	1	2 339	2 380	
AQ Group AB	2 384	34 657	44 819	
Ashtead Technology Holdings PLC	45	580	592	
Austal Ltd.	12 341	19 412	28 082	
BAE Systems PLC	2 087	46 454	47 651	
Balfour Beatty PLC	252	1 628	1 592	
Belimo Holding AG	7	4 435	4 803	
Bergman & Beving AB	70	1 714	2 677	
Bet Shemesh Engines Holdings 1997 Ltd.	323	14 691	24 379	
Bilfinger SE	74	4 841	5 329	
Binjiang Service Group Co., Ltd.	500	1 904	1 439	
Blue Bird Tbk PT	73 600	12 735	9 133	
Bonheur ASA	263	7 805	8 112	
Boustead Singapore Ltd.	8 300	7 177	8 715	
Bravida Holding AB	88	887	894	
Bunka Shutter Co., Ltd.	700	7 512	10 486	
Burckhardt Compression Holding AG	105	90 254	94 334	
Canare Electric Co., Ltd.	100	1 577	1 351	
Capita PLC	2 432	572	568	
Career Design Center Co., Ltd.	200	3 133	3 141	
Careerlink Co., Ltd.	500	11 301	10 518	
Cargotec Oyj	243	26 791	26 710	
Celebi Hava Servisi AS	91	6 764	9 704	
Cembre SpA	259	11 797	14 643	
Central Security Patrols Co., Ltd.	100	2 814	2 684	
Chiyoda Corp.	2 100	5 244	5 395	
CITIC Resources Holdings Ltd.	6 000	462	473	
Computershare Ltd.	4 604	110 322	110 822	
Cosel Co., Ltd.	1 400	16 932	14 898	
CTT Systems AB	1 366	55 613	57 009	
D/S Norden A/S	2 119	127 237	126 345	
Daihatsu Diesel Manufacturing Co., Ltd.	800	8 763	11 249	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Daisue Construction Co., Ltd.	800	10 054	11 725	
Danieli & C Officine Meccaniche SpA, RSP	100	2 779	3 908	
Denyo Co., Ltd.	300	5 253	7 452	
Deutz AG	378	3 011	3 343	
Dormakaba Holding AG	4	2 748	2 808	
DY POWER Corp.	122	2 141	1 625	
E-Commodities Holdings Ltd.	6 000	1 423	1 546	
El Al Israel Airlines	944	1 326	1 426	
Electro Optic Systems Holdings Ltd.	5 097	7 863	7 266	
Elis SA	417	12 518	12 365	
Emeco Holdings Ltd.	11 394	6 754	7 393	
Endo Lighting Corp.	300	3 591	3 917	
Eolus Vind AB	504	4 675	4 598	
Eurogroup Laminations SpA	3	24	18	
Ferreycorp SAA	2 153	1 809	2 115	
Fiera Milano SpA	848	3 488	4 545	
Fila SpA	765	10 000	9 626	
Firstgroup PLC	1 226	3 881	3 357	
Fiverr International Ltd.	76	2 575	2 437	
Flughafen Zurich AG	62	17 538	18 759	
FNM SpA	1 461	1 017	962	
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	96	6 898	6 786	
Frencken Group Ltd.	100 500	123 313	165 398	
FSE Lifestyle Services Ltd.	991	648	976	
Fugro NV	2 529	80 600	83 672	
Fuji Die Co., Ltd.	500	4 006	3 543	
Fujitec Co., Ltd.	900	30 691	32 889	
Fukushima Galilei Co., Ltd.	300	14 289	16 970	
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	600	10 017	7 406	
Gecoss Corp.	2 600	22 328	22 515	
Genuit Group PLC	1 487	11 235	11 099	
Giken Ltd.	100	1 988	1 647	
Golden Ocean Group Ltd., OSL	3 919	68 783	74 489	
HD Hyundai Electric Co., Ltd.	32	9 362	9 861	
Hino Motors Ltd.	1 500	6 892	5 334	
Hirakawa Hewtech Corp.	500	6 617	6 252	
Hoegh Autoliners ASA	8 570	109 869	138 551	
Hokuriku Electrical Construction Co., Ltd.	600	5 170	5 961	
Huber + Suhner AG	34	3 660	3 961	
Ichinen Holdings Co., Ltd.	300	3 748	4 415	
IHI Corp.	200	6 917	8 175	
Implenia AG	11	546	539	
Imura & Co., Ltd.	500	5 290	4 602	
Inaba Denki Sangyo Co., Ltd.	300	9 662	10 004	
InPost SA	39	965	941	
International Container Terminal Services Inc.	60	495	490	
Intrum AB	559	2 392	2 167	
Inwido AB	605	9 875	11 296	
Iwaki Co., Ltd.	200	2 580	4 861	
Japan Pulp & Paper Co., Ltd.	300	13 828	15 516	
JGC Holdings Corp.	500	6 590	5 361	
JK Holdings Co., Ltd.	900	8 579	7 847	
Kamei Corp.	300	5 147	6 048	
Kanaden Corp.	300	3 691	4 318	
Kanamoto Co., Ltd.	700	18 017	17 661	
KAWADA TECHNOLOGIES Inc.	600	7 784	14 097	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Keihin Co., Ltd.	200	3 270	3 836	
Keikyu Corp.	1 000	12 243	9 999	
Keller Group PLC	2 338	42 534	49 661	
Keppel Ltd.	6 800	46 666	44 421	
Kier Group PLC	2 176	5 124	4 983	
Kimura Unity Co., Ltd.	200	2 331	2 976	
Kingspan Group PLC	256	31 258	29 847	
Kinki Sharyo Co., Ltd.	200	3 830	3 397	
KION Group AG	52	2 962	2 981	
Kitano Construction Corp.	200	5 580	6 380	
Kitz Corp.	1 300	13 628	12 573	
Klaveness Combination Carriers ASA	632	8 339	8 918	
Komatsu Wall Industry Co., Ltd.	200	4 935	5 580	
Komori Corp.	100	1 003	1 155	
Kondotec Inc.	500	5 390	5 980	
Kone Oyj	998	69 798	67 457	
Konecranes Oyj	865	43 067	67 170	
Kongsberg Gruppen ASA	2 239	181 545	250 335	
Koninklijke BAM Groep NV	3 216	12 348	18 498	
Korea Line Corp.	1 095	2 576	3 151	
KPP Group Holdings Co., Ltd.	2 900	19 157	19 982	
KRS Corp.	800	6 949	11 473	
Kyodo Printing Co., Ltd.	200	5 613	6 610	
Latam Airlines Group SA	1 170 704	22 599	21 791	
LIKE Inc.	100	1 378	1 297	
Luxfer Holdings PLC	278	5 779	4 409	
Mader Group Ltd.	1 196	7 622	6 875	
Maezawa Kyuso Industries Co., Ltd.	900	9 396	10 266	
Maire Tecnimont SpA	7 398	80 511	83 974	
Marcopolo SA	7 100	13 815	11 107	
Matsui Construction Co., Ltd.	500	2 937	3 619	
McMillan Shakespeare Ltd.	2 907	44 524	46 543	
Mears Group PLC	7 061	44 187	44 763	
Meidensha Corp.	600	13 911	18 629	
Meiji Electric Industries Co., Ltd.	1 000	12 870	15 737	
Meiwa Corp.	800	5 074	4 941	
Metso Oyj	100	1 466	1 450	
Mie Kotsu Group Holdings Inc.	1 700	9 582	8 749	
Mirai Industry Co., Ltd.	200	4 284	6 763	
MISUMI Group Inc.	200	4 616	4 679	
Mitani Sangyo Co., Ltd.	3 000	9 181	9 621	
Mitie Group PLC	505	1 058	1 015	
Mitsubishi Electric Corp.	1 400	30 110	30 576	
Miyaji Engineering Group Inc.	300	9 425	12 402	
Monadelphous Group Ltd.	3 315	40 187	38 898	
Morgan Advanced Materials PLC	93	422	497	
Morgan Sindall Group PLC	59	2 385	2 587	
Mota-Engil SGPS SA	6 328	35 478	31 943	
Mpac Group PLC	2 953	22 380	25 335	
MPC Container Ships ASA	43 797	94 181	126 697	
Munters Group AB	80	2 149	2 065	
Nachi-Fujikoshi Corp.	100	3 238	2 986	
Nagoya Railroad Co., Ltd.	200	3 055	2 983	
Nakabayashi Co., Ltd.	200	974	937	
Nakano Corp.	600	2 421	2 695	
Namyong Terminal PCL	10 500	1 648	1 417	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Nanyo Corp.	500	5 103	4 832	
Nexans SA	32	4 224	4 829	
Nice Corp.	600	8 097	10 249	
Nichiden Corp.	300	5 992	9 174	
Nichiha Corp.	600	16 361	17 481	
Nichireki Co., Ltd.	100	1 549	2 116	
Nikkiso Co., Ltd.	2 800	27 042	27 438	
Nilfisk Holding A/S	349	9 521	9 567	
Nippon Aqua Co., Ltd.	2 000	17 632	15 856	
Nippon Concept Corp.	100	1 582	1 510	
Nippon Express Holdings Inc.	400	26 669	25 230	
Nippon Sharyo Ltd.	600	11 769	13 010	
Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	5 200	29 019	18 711	
Nissei ASB Machine Co., Ltd.	100	4 041	4 721	
Nitto Kogyo Corp.	1 900	58 582	56 568	
Nitto Seiko Co., Ltd.	400	2 295	1 991	
Nittoc Construction Co., Ltd.	400	3 993	3 804	
NKT A/S	2 651	270 682	317 748	
Nordex SE	1 551	28 661	26 021	
NRW Holdings Ltd.	1 052	2 638	2 971	
OC Oerlikon Corp. AG	353	2 427	2 606	
Ochi Holdings Co., Ltd.	1 500	18 579	18 859	
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	600	7 961	7 942	
Odawara Engineering Co., Ltd.	200	3 655	2 974	
Okabe Co., Ltd.	1 000	7 272	6 601	
Okamoto Machine Tool Works Ltd.	300	15 963	11 815	
Okamura Corp.	1 000	19 904	19 182	
Oriental Shiraishi Corp.	2 800	8 432	8 622	
Otokar Otomotiv Ve Savunma Sanayi A.S.	214	4 268	5 886	
Palfinger AG	40	1 407	1 302	
Pentair PLC	12	1 290	1 259	
Per Aarsleff Holding A/S, cat. B	317	18 885	23 782	
Persol Holdings Co., Ltd.	13 300	26 858	25 195	
Porr Ag	156	3 240	3 203	
Pronexus Inc.	500	5 092	5 610	
Prysmian SpA	1 971	159 931	167 131	
QinetiQ Group PLC	344	2 685	2 637	
Quick Co., Ltd.	100	1 825	1 887	
Quinenco SA	86	357	385	
Randon SA Implementos e Participacoes	300	873	807	
Randstad NV	53	3 490	3 290	
Reece Ltd.	1 494	35 206	34 364	
Regional Container Lines PCL	500	576	531	
Reliance Worldwide Corp. Ltd.	5 440	20 875	22 471	
Renew Holdings PLC	85	1 564	1 561	
Rheinmetall AG	73	56 470	50 927	
Rieter Holding AG	2	396	350	
ROCKWOOL A/S	67	35 328	37 235	
Ryanair Holdings PLC	486	81 730	77 434	
Ryobi Ltd.	1 400	35 270	27 295	
Sakai Heavy Industries Ltd.	100	4 736	5 044	
Salcef Group SpA	110	3 488	4 122	
Sammok S-Form Co., Ltd.	278	4 276	5 063	
Sandvik AB	192	5 275	5 269	
Sanix Inc.	2 800	7 994	7 098	
Sanko Gosei Ltd.	400	2 382	2 457	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Sanko Metal Industrial Co., Ltd.	200	7 936	7 775	
Sankyo Tateyama Inc.	200	1 352	1 370	
Sansei Technologies Inc.	500	6 091	7 690	
Sansha Electric Manufacturing Co., Ltd.	100	1 063	931	
Santos Brasil Participacoes SA	3 300	11 602	11 097	
Sanyo Denki Co., Ltd.	300	18 488	18 578	
Sanyo Trading Co., Ltd.	800	10 610	10 977	
Sato Holdings Corp.	300	5 878	5 499	
Sato Shoji Corp.	400	5 716	5 832	
Sdiptech AB	64	2 869	2 671	
Securitas AB	2 081	29 273	28 287	
Seika Corp.	500	9 358	18 799	
Seiko Electric Co., Ltd.	1 500	15 434	18 272	
Sensata Technologies Holding PLC	41	2 112	2 098	
Senshu Electric Co., Ltd.	100	3 027	4 585	
Severfield PLC	1 431	1 696	1 876	
SGS SA	464	58 050	56 524	
Shikun & Binui Ltd.	6	28	15	
Shimizu Corp.	1 500	11 207	11 528	
Shimojima Co., Ltd.	900	9 490	10 243	
Shinmaywa Industries Ltd.	1 200	13 195	14 485	
Shinwa Co., Ltd.	100	2 952	2 504	
SIA Engineering Co., Ltd.	12 800	29 977	29 983	
Siemens AG	174	43 511	44 329	
Siemens Energy AG	2 568	77 111	91 553	
Signify NV	1 268	44 272	43 328	
Sinotruk Hong Kong Ltd.	500	1 510	1 779	
SKF AB	525	14 408	14 435	
SmartGroup Corp. Ltd.	6 871	56 623	53 058	
SNT Dynamics Co., Ltd.	1 400	14 017	31 244	
Space Co., Ltd.	500	4 949	4 759	
SRG Global Ltd.	5 172	3 246	3 947	
Stadler Rail AG	424	18 282	16 496	
SThree PLC	437	3 187	3 114	
Stolt-Nielsen Ltd.	80	2 683	5 192	
Strabag SE	135	8 281	7 711	
Sugimoto & Co., Ltd.	200	3 960	4 161	
Sulzer AG	75	10 854	14 184	
Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	200	4 888	6 218	
Sun Kwang Co., Ltd.	193	3 307	3 336	
Svitzer A/S	4	158	204	
Systemair AB	160	798	1 625	
Takamiya Co., Ltd.	200	881	852	
Takaoka Toko Co., Ltd.	500	9 868	8 583	
Takashima & Co., Ltd.	1 300	11 236	11 534	
Technoflex Corp.	700	7 291	6 788	
Teikoku Electric Manufacturing Co., Ltd.	300	7 004	6 433	
Tekken Corp.	100	1 865	2 224	
Teleperformance SE	157	22 959	22 642	
Thoresen Thai Agencies PCL	1 300	382	349	
Tianjin Port Development Holdings Ltd.	8 000	748	883	
TKH Group NV	241	14 397	14 392	
Toa Corp. /Tokyo	1 200	10 703	10 402	
Tobu Railway Co., Ltd.	2 300	57 342	52 991	
Tokyo Energy & Systems Inc.	100	919	1 188	
Toli Corp.	2 500	7 709	8 464	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Torishima Pump Manufacturing Co., Ltd.	800	15 569	21 606	
Toyo Engineering Corp.	200	2 321	1 492	
Trelleborg AB	432	22 934	23 019	
Trusco Nakayama Corp.	1 100	24 697	23 037	
Tsubakimoto Kogyo Co., Ltd.	300	4 852	5 681	
Tsugami Corp.	400	4 388	5 288	
Tsukishima Holdings Co., Ltd.	100	1 104	1 262	
Tsurumi Manufacturing Co., Ltd.	300	6 558	12 402	
Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de	2 500	10 827	9 374	
Valmet Oyj	80	3 135	3 131	
VAT Group AG	30	21 199	23 271	
Ventia Services Group Pty Ltd.	8 114	20 570	28 399	
Vestas Wind Systems A/S	352	11 269	11 162	
Vesuvius PLC	624	5 214	4 981	
Wakita & Co., Ltd.	2 300	28 797	33 808	
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 167	8 664	16 332	
Wartsila OYJ Abp	2 705	74 319	71 406	
Webuild SpA	434	1 446	1 304	
Wilh Wilhelmsen Holding ASA	450	19 830	22 409	
Will Group Inc.	400	4 628	3 369	
World Holdings Co., Ltd.	1 300	33 992	23 930	
XP Power Ltd.	139	2 602	3 558	
YAMABIKO Corp.	800	11 019	15 529	
YAMADA Consulting Group Co., Ltd.	200	3 044	3 540	
Yamato Holdings Co., Ltd.	4 600	70 019	69 201	
Yamaura Corp.	600	6 793	6 819	
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	43 600	104 843	108 292	
Yasuda Logistics Corp.	100	973	1 361	
Young Poong Precision Corp.	464	6 341	5 360	
Yuasa Trading Co., Ltd.	600	23 455	28 939	
Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	700	4 539	4 490	
		5 148 541	5 556 655	17,05
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 7,14 %)				
Adairs Ltd.	548	1 115	921	
Aisan Industry Co., Ltd.	200	1 898	2 382	
Akebono Brake Industry Co., Ltd.	3 600	4 477	5 237	
Alpha Corp.	400	4 456	4 845	
Amiyaki Tei Co., Ltd.	100	3 233	4 985	
Anima Holding SA	12 400	15 157	9 622	
AO World PLC	2 258	4 134	4 335	
Aristocrat Leisure Ltd.	237	10 611	10 777	
Ashimori Industry Co., Ltd.	100	1 770	2 063	
Astra Otoparts Tbk PT	7 500	1 172	1 188	
Aucnet Inc.	1 900	30 033	44 478	
Auto1 Group SE	241	2 531	2 151	
Avantia Co., Ltd.	1 000	7 769	7 256	
B&M European Value Retail SA	1 127	10 695	8 523	
Bayerische Motoren Werke AG	1 242	175 159	160 978	
Belluna Co., Ltd.	3 200	18 060	20 905	
Bellway PLC	330	15 402	14 476	
Bermaz Auto Bhd	22 200	14 487	16 163	
Bijou Brigitte AG	100	6 521	5 353	
Bloomberry Resorts Corp.	2 400	358	533	
Bookoff Group Holdings Ltd.	1 200	15 286	14 413	
Bridgestone Corp.	100	5 441	5 378	
C&A MODAS SA	5 000	12 574	11 505	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Cairn Homes PLC, ISE	6 141	14 763	14 320	
Cairn Homes PLC, LSE	8 544	19 034	19 951	
Card Factory PLC	266	454	428	
CECONOMY AG	83	379	362	
Central Automotive Products Ltd.	200	5 434	9 068	
China Harmony Auto Holding Ltd.	1 000	167	84	
CIR SpA-Compagnie Industriali	3 864	3 119	3 372	
Clas Ohlson AB	707	14 880	16 078	
Cleanup Corp.	300	2 091	1 896	
Construtora Tenda S/A	900	2 927	2 383	
Continental AG	17	1 555	1 319	
Cruzeiro do Sul Educacional SA	600	679	554	
Crystal International Group Ltd.	4 500	1 854	3 060	
Currys PLC	5 247	6 018	6 535	
Cury Construtora e Incorporadora SA	900	5 021	4 567	
Daido Metal Co., Ltd.	2 200	10 615	11 678	
Dainichi Co., Ltd.	100	711	599	
DD GROUP Co., Ltd.	200	2 574	2 019	
Delivery Hero SE	444	17 649	14 423	
Delta Galil Ltd.	199	11 651	11 478	
DFS Furniture PLC	803	1 705	1 528	
Dongfeng Motor Group Co., Ltd.	16 000	6 333	6 253	
Eagle Industry Co., Ltd.	500	7 089	8 200	
Edvantage Group Holdings Ltd.	4 145	1 312	1 642	
Elior Group SA	1 081	4 478	4 188	
Emak SpA	947	1 562	1 400	
FCC Co., Ltd.	700	12 185	13 987	
First Juken Co., Ltd.	800	8 516	7 397	
Forvia SE, PAR	124	2 066	2 010	
Foster Electric Co., Ltd.	1 600	15 383	24 526	
Frasers Group PLC	59	896	901	
F-Tech Inc.	300	2 399	1 654	
Fuji Corp. Ltd.	4 200	27 890	29 082	
Fujikura Composites Inc.	600	7 892	7 094	
FuKoKu Co., Ltd.	300	3 648	5 862	
Futaba Industrial Co., Ltd.	1 600	10 383	12 018	
G8 Education Ltd.	339	356	367	
Gajah Tunggal Tbk PT	98 200	7 451	9 150	
Genki Sushi Co., Ltd.	500	8 031	14 291	
Geo Holdings Corp.	300	4 800	4 269	
Giordano International Ltd.	28 000	11 826	9 079	
Greens Co., Ltd.	300	3 764	4 912	
Grupo SBF SA	2 200	6 538	6 504	
Guararapes Confeccoes SA	1 200	2 435	2 058	
Hagihara Industries Inc.	400	5 090	5 335	
Harvia Oyj	348	20 532	18 781	
Hi-Lex Corp.	400	4 900	5 005	
H-One Co., Ltd.	800	5 482	6 941	
Honeys Holdings Co., Ltd.	2 400	34 726	32 297	
Hwaseung Corp. Co., Ltd.	991	2 131	2 039	
IDOM Inc.	1 100	9 225	13 081	
Iida Group Holdings Co., Ltd.	200	3 646	3 602	
Imasen Electric Industrial	1 200	7 600	6 349	
IMMSI SpA	4 220	2 812	2 825	
Imperial Hotel Ltd.	400	3 342	3 025	
Isuzu Motors Ltd.	1 300	23 397	23 565	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
JANOME Corp.	600	3 407	3 527	
JB Hi-Fi Ltd.	1 255	69 443	70 201	
JD Sports Fashion PLC	2 753	5 884	5 690	
Johnson Electric Holdings Ltd.	2 500	4 104	5 153	
JP-Holdings Inc.	3 000	12 053	13 959	
JS Corp.	135	2 771	2 391	
JS Global Lifestyle Co., Ltd.	2 500	535	675	
KeyHolder Inc.	200	2 161	1 450	
Kid ASA	1 385	24 079	26 449	
KNT-CT Holdings Co., Ltd.	1 300	14 655	14 752	
Kogan.com Ltd.	516	3 598	1 966	
Komatsu Matere Co., Ltd.	500	3 720	3 292	
Konaka Co., Ltd.	1 200	4 370	2 807	
Koshidaka Holdings Co., Ltd.	1 200	8 845	8 840	
Kurabo Industries Ltd.	100	2 139	4 249	
Lastminute.com NV	36	1 208	1 096	
Lojas Renner SA	100	352	307	
Look Holdings Inc.	400	9 192	9 439	
Matas A/S	145	3 486	3 308	
Matsuoka Corp.	200	2 102	3 037	
Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret AS	2 862	10 221	15 171	
Mazda Motor Corp.	4 200	61 842	55 591	
MBM Resources BHD	1 500	1 681	2 302	
Mikuni Corp.	1 700	5 947	5 972	
Mitchells & Butlers PLC	19	88	94	
Morito Co., Ltd.	600	6 406	7 625	
MrMax Holdings Ltd.	200	1 220	1 164	
MRV Engenharia e Participacoes SA	300	602	494	
Next PLC	62	10 030	9 690	
Nichirin Co., Ltd.	200	5 091	6 099	
Nick Scali Ltd.	4 757	61 278	60 035	
Nihon Tokushu Toryo Co., Ltd.	600	5 789	6 334	
Nissan Motor Co., Ltd.	13 200	66 152	61 296	
Nissan Tokyo Sales Holdings Co., Ltd.	1 500	4 814	6 456	
Onward Holdings Co., Ltd.	1 200	6 014	6 349	
Open House Group Co., Ltd.	200	8 188	8 384	
Oriental Land Co., Ltd.	2 000	80 274	76 252	
OVS SpA	3 246	9 393	11 825	
Pacific Industrial Co., Ltd.	1 200	14 982	15 393	
Pandora A/S	413	76 723	85 359	
Persimmon PLC	1 308	31 665	30 589	
Pinewood Technologies Group PLC	1 031	10 543	6 349	
Plano & Plano Desenvolvimento Imobiliario SA	700	2 606	1 776	
Playtech PLC	9	67	72	
Prinx Chengshan Holdings Ltd.	500	597	708	
PWR Holdings Ltd.	101	1 138	1 013	
Renault SA	860	59 707	60 337	
Rvrc Holding AB	1 262	10 945	7 452	
Sanden Corp.	200	452	291	
Sankyo Seiko Co., Ltd.	200	1 241	1 262	
Sanyo Shokai Ltd.	1 300	29 844	26 551	
Scandic Hotels Group AB	510	3 301	4 231	
Sharp Corp.	1 300	10 932	10 285	
Shikibo Ltd.	1 000	10 250	9 646	
SNT Corp.	1 600	3 700	3 198	
SNT Holdings Co., Ltd.	343	5 583	7 331	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Sogefi SpA	2 292	5 907	10 655	
SPK Corp.	300	5 470	6 030	
Sri Trang Agro-Industry PCL	3 600	2 871	2 899	
SSI Group Inc.	46 000	2 833	3 651	
Step Co., Ltd.	1 000	17 942	16 366	
Sumitomo Electric Industries Ltd.	200	4 287	4 257	
Suncall Corp.	100	580	412	
Super Retail Group Ltd.	3 943	52 733	50 266	
Synsam AB	174	1 288	1 185	
T RAD Co., Ltd.	400	6 760	12 692	
Tachikawa Corp.	300	3 570	3 458	
Taiho Kogyo Co., Ltd.	600	4 580	4 144	
Taylor Wimpey PLC	4 621	11 185	11 362	
TBK Co., Ltd.	1 100	4 103	2 910	
Temple & Webster Group Ltd.	6 221	59 089	53 383	
Texwinca Holdings Ltd.	4 000	965	715	
Toa Corp. /Hyogo	700	6 256	6 615	
Topre Corp.	100	1 288	1 797	
Trainline PLC	521	3 049	2 833	
Unipres Corp.	1 000	9 376	11 390	
Unitika Ltd.	2 800	6 014	7 669	
USS Co., Ltd.	400	4 416	4 605	
Valeo SE	150	2 226	2 186	
Van de Velde NV	275	14 918	12 422	
Vistry Group PLC	993	21 103	20 319	
Volkswagen AG, actions priv.	676	112 262	104 491	
Vulcabras Azaleia SA	200	975	729	
WATAMI Co., Ltd.	200	2 154	1 598	
Watches of Switzerland Group PLC	234	1 587	1 676	
Yamaha Corp.	600	18 758	19 221	
Yossix Holdings Co., Ltd.	300	6 646	7 592	
		1 958 336	1 968 950	6,04
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : 1,38 %)				
Aeon Co M Bhd	21 300	8 104	8 588	
Ajinomoto Co Inc.	100	5 082	4 798	
Albis Co., Ltd.	100	2 248	2 325	
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	4 202	28 869	43 338	
Associated British Foods PLC	98	4 306	4 194	
BIM Birlesik Magazalar AS	103	2 367	2 343	
BRF SA	16 000	77 624	89 356	
Carrefour SA	3 307	74 404	64 018	
Colruyt Group N.V	25	1 590	1 634	
Cranswick PLC	23	1 790	1 768	
DingDong Cayman Ltd.	1 869	5 164	5 089	
Fonterra Co-operative Group Ltd.	4 559	13 222	15 509	
Grupo Herdez SAB de CV	400	1 473	1 583	
Herbalife Ltd.	288	5 594	4 095	
Inghams Group Ltd.	10 313	35 372	34 117	
Japfa Ltd.	12 000	3 850	4 059	
Life Corp.	500	17 276	16 758	
Marfrig Global Foods SA	5 800	16 423	17 660	
Marks & Spencer Group PLC	982	5 145	4 866	
McBride PLC	3 722	7 298	8 917	
Mitsui DM Sugar Holdings Co., Ltd.	200	5 469	5 767	
Miyoshi Oil & Fat Co., Ltd.	200	2 284	2 538	
Nichimo Co., Ltd.	200	3 249	3 804	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Nihon Chouzai Co., Ltd.	700	8 210	8 902	
Nisshin Seifun Group Inc.	100	1 785	1 573	
Oenon Holdings Inc.	1 100	3 411	3 556	
Okuwa Co., Ltd.	800	6 525	6 247	
Ontex Group NV	1 843	18 413	21 920	
Orsero SpA	275	6 652	5 073	
Premium Water Holdings Inc.	200	4 890	4 992	
Ridley Corp. Ltd.	7 540	17 461	14 677	
Salmar ASA	160	13 880	11 556	
Sappe PCL	8 800	20 621	33 305	
Scandi Standard AB	1 022	9 536	10 247	
Toho Co., Ltd.	600	15 040	18 808	
Weilong Delicious Global Holdings Ltd.	70	131	67	
YAKUODO Holdings Co., Ltd.	400	9 799	9 762	
Yamami Co.	100	3 382	2 794	
		467 939	500 603	1,53
Soins de santé (31 décembre 2023 : 4,11 %)				
AddLife AB	26	364	422	
ALK, Abello A/S	1 125	33 009	33 871	
Alkermes PLC	220	7 290	7 255	
Ambea AB	8 159	61 870	82 650	
Ambu A/S	220	4 581	5 797	
Ansell Ltd.	1 874	43 517	45 468	
Asahi Intecc Co., Ltd.	2 100	40 834	40 291	
Attendo AB	1 725	8 848	9 762	
Basilea Pharmaceutica AG	13	738	773	
Bavarian Nordic A/S	77	2 360	2 614	
Bayer AG	255	9 919	9 865	
BoneSupport Holding AB	957	9 869	32 521	
Carl Zeiss Meditec AG	115	13 274	11 072	
Daito Pharmaceutical Co., Ltd.	220	4 466	4 173	
Eisai Co., Ltd.	400	27 769	22 430	
Eurofins Scientific SE	50	3 717	3 413	
FINDEX Inc.	600	4 297	5 191	
Fuji Pharma Co., Ltd.	100	1 064	1 273	
Fukuda Denshi Co., Ltd.	300	20 269	17 353	
Hans Biomed Corp.	57	1 492	662	
Hoya Corp.	100	15 931	15 911	
Humana AB	684	2 491	2 908	
JMS Co., Ltd.	500	2 713	2 297	
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	1 200	38 674	39 300	
Kiniksa Pharmaceuticals International PLC	45	835	1 150	
Kissei Pharmaceutical Co., Ltd.	200	6 092	5 546	
Koa Shoji Holdings Co., Ltd.	700	4 639	4 174	
Kossan Rubber Industries Bhd	7 900	4 479	5 385	
Kyowa Kirin Co., Ltd.	2 100	47 306	49 080	
Linical Co., Ltd.	1 000	6 250	3 624	
LivaNova PLC	78	4 585	5 851	
M3 Inc.	200	2 737	2 609	
Mayne Pharma Group Ltd.	165	1 025	710	
Menicon Co., Ltd.	200	2 928	2 247	
MLP Saglik Hizmetleri AS	1 154	8 033	16 858	
Modern Dental Group Ltd.	1 000	489	754	
Neuren Pharmaceuticals Ltd.	2 894	50 751	56 252	
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	300	8 303	8 307	
Nipro Corp.	2 200	23 580	23 608	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Novo Nordisk A/S, CAAE	44	8 774	8 594	
Novocure Ltd.	273	6 700	6 399	
Orpea SA	523	9 431	8 810	
Oxford Biomedica PLC	246	1 380	1 262	
Pharming Group NV	7 294	9 200	8 049	
Prothena Corp. PLC	189	9 500	5 338	
PureTech Health PLC	100	352	317	
Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	9 100	9 839	3 139	
Regis Healthcare Ltd.	3 121	8 519	12 435	
Riverstone Holdings Ltd.	78 300	59 997	76 685	
Seed Co., Ltd.	1 500	8 048	7 120	
Seikagaku Corp.	500	3 554	3 739	
Software Service Inc.	100	9 041	12 079	
Sonova Holding AG	129	50 224	54 530	
St-Care Holding Corp.	1 500	11 467	11 152	
StemRIM Inc.	1 300	14 841	4 523	
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	900	32 458	31 940	
Telix Pharmaceuticals Ltd.	836	12 315	14 248	
Towa Pharmaceutical Co., Ltd.	800	18 811	20 000	
Vital KSK Holdings Inc.	400	3 721	4 631	
		819 560	878 417	2,69
Services financiers (31 décembre 2023 : 7,18 %)				
ABG Sundal Collier Holding ASA	4 902	4 036	3 874	
ABN AMRO Bank NV	6 681	153 833	150 398	
Abrdn PLC	5 029	12 386	12 892	
AEON Credit Service M Bhd	800	1 394	1 733	
AIA Group Ltd.	1 400	13 290	13 004	
Aizawa Securities Group Co., Ltd.	200	1 514	4 532	
AJ Bell PLC	514	2 815	3 374	
Akatsuki Corp.	1 200	4 054	5 063	
Akita Bank Ltd.	400	7 228	9 075	
Aksigorta AS	6 931	1 995	2 323	
Albaraka Turk Katilim Bankasi AS	63 104	11 349	14 539	
Allfunds Group PLC	142	1 170	1 091	
Anadolu Anonim Turk Sigorta Sirketi	20 901	69 649	93 345	
Anadolu Hayat Emeklilik AS	3 058	7 412	16 133	
Anicom Holdings Inc.	2 200	11 100	12 595	
Ashmore Group PLC	450	1 407	1 324	
Avanza Bank Holding AB	156	5 533	5 190	
B2 Impact ASA	6 763	6 772	7 170	
Bairong Inc.	500	1 082	780	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	22 025	112 923	141 637	
Banco BPM SpA	9 280	58 320	81 847	
Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA, actions priv., cat. B	1 700	7 098	4 753	
Bangkok Bank PCL	100	541	487	
Bank Handlowy w Warszawie SA	154	5 428	5 127	
Bank Hapoalim BM	6 139	72 123	74 276	
Bank Leumi Le-Israel BM	13 018	130 717	145 164	
Bank of Georgia Group PLC	270	18 983	18 844	
Bank of Iwate Ltd.	1 000	19 473	24 379	
Bank of Nagoya Ltd.	200	6 731	13 185	
Bank of Saga Ltd.	500	7 894	11 599	
Bank of the Ryukyus Ltd.	700	6 866	7 663	
Banque Cantonale Vaudoise	291	43 664	42 251	
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	6 689	56 607	70 236	
Berner Kantonalbank AG	2	684	710	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
BNP Paribas SA	44	3 882	3 841	
BPER Banca	2 465	15 888	17 066	
Bright Smart Securities & Commodities Group Ltd.	54 000	15 632	16 468	
Burford Capital Ltd., LSE	8	159	141	
Cembra Money Bank AG	387	42 321	45 199	
Chiba Kogyo Bank Ltd.	200	741	1 729	
Close Brothers Group PLC	1 726	10 728	12 647	
CMC Markets PLC	1 018	5 646	5 758	
Commercial International Bank – Egypt (CIB)	12 649	27 131	25 720	
Credito Emiliano SpA	2 143	22 521	29 228	
CSU Digital SA	700	3 282	3 209	
Dah Sing Banking Group Ltd.	2 800	3 072	3 195	
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	2 000	6 741	7 624	
Daishi Hokuetsu Financial Group Inc.	400	14 422	17 455	
Deutsche Pfandbriefbank AG	462	2 630	3 425	
EFG International AG	140	2 427	2 818	
Ehime Bank Ltd.	1 600	13 573	17 884	
Electreon Wireless Ltd.	295	18 722	16 191	
Entrust Inc.	200	1 665	1 429	
EQT Holdings Ltd.	980	23 532	28 658	
Erste Group Bank AG	244	16 293	15 831	
FinecoBank Banca Fineco SpA	459	9 485	9 370	
First International Bank Of Israel Ltd.	52	3 018	2 697	
FlatexDEGIRO AG	1 055	15 471	20 500	
Funding Circle Holdings PLC	2 516	3 261	4 187	
Georgia Capital PLC	598	12 660	10 137	
GMO Financial Holdings Inc.	2 000	12 945	13 338	
Hanwha General Insurance Co., Ltd.	91	479	452	
Hargreaves Lansdown PLC	1 486	27 816	29 096	
Helia Group Ltd.	24 281	82 691	85 872	
Hiscox Ltd.	54	1 127	1 074	
Hoist Finance AB	2 803	16 544	19 485	
Hong Leong Finance Ltd.	12 300	31 523	29 681	
HS Holdings Co., Ltd.	1 400	12 455	11 802	
HUB24 Ltd.	2 852	91 153	121 323	
Hyakujushi Bank Ltd.	700	13 253	20 245	
Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	22	763	755	
Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	1 000	6 653	7 350	
IDI Insurance Co., Ltd.	15	631	530	
iFAST Corp. Ltd.	14 800	108 899	107 590	
IG Group Holdings PLC	233	3 318	3 301	
Intesa Sanpaolo SpA	56 373	285 251	286 958	
Israel Discount Bank Ltd.	12 488	83 605	85 231	
James River Group Holdings Ltd.	332	7 444	3 512	
Juroku Financial Group Inc.	200	6 457	8 107	
Just Group PLC	515	890	939	
KBC Group NV	550	54 514	53 155	
Keiyo Bank Ltd.	2 300	11 988	17 178	
Kita-Nippon Bank Ltd.	200	3 857	4 789	
Kyushu Leasing Service Co., Ltd.	700	5 851	6 455	
Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros	1 438	2 039	2 438	
Marusan Securities Co., Ltd.	2 200	18 075	20 267	
Matsui Securities Co., Ltd.	12 600	91 299	90 032	
Menora Mivtachim Holdings Ltd.	91	3 329	2 991	
Mirae Asset Life Insurance Co., Ltd.	2 148	7 941	11 680	
Miyazaki Bank Ltd.	300	7 233	9 059	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Musashino Bank Ltd.	900	18 677	25 073	
MyState Ltd.	184	594	629	
Nanto Bank Ltd.	100	2 423	3 033	
Navigator Global Investments Ltd.	886	932	1 644	
Netwealth Group Ltd.	2 886	40 028	58 471	
Nib holdings Ltd.	10 878	74 724	73 065	
Ninety One PLC	215	659	623	
NN Group NV	1 186	76 307	75 573	
NZX Ltd.	14 884	13 874	13 279	
OFX Group Ltd.	11 868	16 902	23 969	
Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	400	7 084	7 785	
Pacific Current Group Ltd.	130	829	1 316	
Panin Financial Tbk PT	160 000	6 013	4 091	
Paragon Banking Group PLC	391	4 782	4 971	
Pareto Bank ASA	636	4 569	4 986	
Phoenix Holdings Ltd.	104	1 381	1 299	
Plus500 Ltd.	1 543	59 603	60 478	
Procrea Holdings Inc.	100	1 989	1 664	
Protector Forsikring ASA	1 492	33 164	49 182	
Raiffeisen Bank International AG	51	1 328	1 213	
RCE Capital Bhd	600	341	491	
Resurs Holding AB	2 379	7 013	7 039	
San ju San Financial Group Inc.	700	10 075	12 772	
SBI Global Asset Management Co., Ltd.	1 600	7 893	9 078	
Seven Bank Ltd.	9 500	24 937	21 738	
Shiga Bank Ltd.	600	18 460	21 513	
Shikoku Bank Ltd.	600	5 534	6 222	
Shimizu Bank Ltd.	400	5 343	5 601	
Shizuoka Financial Group Inc.	200	2 514	2 627	
Spar Nord Bank A/S	114	2 360	3 004	
SpareBank 1 Nord Norge	4 496	57 771	57 283	
SpareBank 1 SMN	418	7 857	8 118	
SpareBank 1 SR-Bank ASA	2 534	41 934	42 530	
Sparebanken Vest	398	6 066	6 419	
St Galler Kantonalbank AG	2	1 468	1 317	
Swiss Re AG	24	4 127	4 075	
Sydbank AS	684	41 191	49 634	
Tamburi Investment Partners SpA	1 613	20 888	22 141	
TBC Bank Group PLC	113	6 349	5 023	
Tochigi Bank Ltd.	1 400	3 375	4 406	
Tokai Tokyo Financial Holdings Inc.	1 800	9 261	8 804	
Tokyo Century Corp.	2 200	30 977	28 240	
TOMONY Holdings Inc.	11 700	41 030	42 000	
Tongyang Life Insurance Co., Ltd.	144	544	1 119	
Towa Bank Ltd.	1 500	7 272	9 059	
TP ICAP Group PLC	1 859	6 258	6 425	
Traders Holdings Co., Ltd.	2 800	15 045	18 530	
Turkiye Garanti Bankasi AS	6 558	24 064	30 766	
Turkiye Sigorta AS	33 054	72 050	107 956	
UBS Group AG	308	11 635	12 405	
Unipol Gruppo SpA	5 987	65 183	81 480	
Van Lanschot Kempen NV	545	30 420	29 972	
Wiz Co.	1 400	2 425	1 969	
XTB SA	194	4 767	4 731	
Yamagata Bank Ltd.	400	3 934	4 131	
Zip Co., Ltd.	7 175	8 251	9 573	
		3 135 471	3 478 220	10,66

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 6,42 %)				
Ad-sol Nissin Corp.	100	1 570	1 611	
Aichi Tokei Denki Co., Ltd.	400	6 544	7 788	
Aiphone Co., Ltd.	500	13 029	13 142	
Alphawave IP Group PLC	158	406	394	
Ambarella Inc.	40	4 250	2 953	
Ams-OSRAM AG	816	1 382	1 546	
AOI Electronics Co., Ltd.	100	1 878	2 156	
ASML Holding NV	8	11 566	11 312	
ASML Holding NV, NASD	9	12 698	12 595	
ASMPT Ltd.	100	1 316	1 909	
Audinate Group Ltd.	1 457	22 918	21 077	
Avaco Co., Ltd.	74	1 638	1 345	
Aval Data Corp.	200	13 416	7 562	
Axell Corp.	300	3 043	3 774	
Azbil Corp.	200	7 385	7 623	
Barco NV	105	1 708	1 595	
Bouvet ASA	1 447	11 806	11 715	
Bravura Solutions Ltd.	18 799	23 331	18 554	
Broadleaf Co., Ltd.	100	438	495	
Business Brain Showa-Ota Inc.	200	3 936	3 826	
Business Engineering Corp.	100	2 964	3 215	
CAC Holdings Corp.	200	3 206	3 185	
Cafe24 Corp.	22	389	884	
Cal-Comp Electronics Thailand PCL, CAÉ sans droit de vote	7 000	545	1 023	
Camtek Ltd.	987	77 636	167 780	
Cellebrite DI Ltd.	20	314	327	
CMK Corp.	300	1 382	1 524	
Codan Ltd.	11 041	82 418	121 381	
Cognyte Software Ltd.	244	2 202	2 551	
Computer Engineering & Consulting Ltd.	600	9 204	10 927	
Comture Corp.	500	8 604	7 762	
CSE Global Ltd.	39 600	17 606	15 993	
Daitron Co., Ltd.	100	1 526	2 468	
Darktrace PLC	105	894	1 047	
Densan System Holdings Co., Ltd.	200	5 738	4 585	
Digital Arts Inc.	300	13 907	11 509	
DMS Co., Ltd.	727	4 581	4 661	
Dustin Group AB	8	12	12	
Dynavox Group AB	239	1 693	1 658	
Ebase Co., Ltd.	300	2 124	1 845	
Econocom Group SA	394	1 389	1 225	
ESPEC Corp.	700	15 727	18 965	
Forval Corp.	100	1 114	1 317	
FTGroup Co., Ltd.	1 000	11 552	9 859	
Furuno Electric Co., Ltd.	500	8 846	8 881	
GemVax & Kael Co., Ltd.	552	7 499	5 718	
GL Sciences Inc.	100	2 426	2 470	
Global Dominion Access SA	1 014	5 145	4 788	
Hamamatsu Photonics KK	100	3 844	3 665	
Hioki EE Corp.	300	17 593	17 328	
Hochiki Corp.	400	7 318	7 625	
Hokuriku Electric Industry Co., Ltd.	200	2 447	2 406	
Hosiden Corp.	400	6 951	7 322	
ID Holdings Corp.	400	4 517	5 053	
Indeks Bilgisayar Sistemleri Muhendislik Sanayi ve Ticaret	9 117	3 913	3 155	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
I-Net Corp.	100	1 500	1 827	
Inficon Holding AG	2	3 897	4 160	
Infomedia Ltd.	11 192	15 357	17 183	
Innotech Corp.	300	4 579	4 517	
Intelbras SA Industria de Telecomunicacao Eletronica	200	1 213	1 138	
Intelligent Wave Inc.	200	1 490	1 837	
I-PEX Inc.	200	2 721	3 580	
IQE PLC	2 139	1 113	1 154	
ISB Corp.	300	3 901	3 695	
Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	600	12 875	13 219	
Japan Electronic Materials Corp.	300	4 952	9 187	
KC Co., Ltd.	252	4 936	5 160	
KC Tech Co., Ltd.	347	7 900	15 643	
Kingboard Holdings Ltd.	4 000	12 852	12 885	
Konica Minolta Inc.	1 900	7 743	7 195	
Kyocera Corp.	1 700	28 574	26 774	
Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	600	3 197	3 685	
Kyowa Electronic Instruments Co., Ltd.	700	3 661	2 739	
Landis+Gyr Group AG	26	2 725	2 874	
Lenovo Group Ltd.	4 000	7 923	7 726	
LG Display Co., Ltd., CAAÉ	28	359	158	
LINK Mobility Group Holding ASA	9 581	15 539	25 303	
Logitech International SA	2 089	240 183	276 493	
LOT Vacuum Co., Ltd.	603	10 256	9 351	
Macquarie Technology Group Ltd.	335	18 671	28 952	
MIMAKI Engineering Co., Ltd.	100	698	1 639	
Mimasu Semiconductor Industry Co., Ltd.	200	5 923	6 278	
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	100	1 460	1 689	
Mitachi Co., Ltd.	700	9 322	6 705	
M-up Holdings Inc.	200	1 852	2 450	
Mycronic AB	1 043	48 049	55 065	
Nagano Keiki Co., Ltd.	500	9 515	12 547	
Nedap NV	42	3 902	3 745	
NEOJAPAN Inc.	100	910	1 432	
NEXTDC Ltd.	400	6 415	6 444	
Nippon Ceramic Co., Ltd.	300	6 689	6 507	
Nokia Oyj	12 857	66 295	67 096	
Nova Ltd.	726	110 500	233 112	
NSW Inc.	300	7 773	8 472	
Nuix Ltd.	1 081	2 914	3 043	
Oki Electric Industry Co., Ltd.	1 100	10 415	9 507	
Optex Group Co., Ltd.	100	2 064	1 438	
Optorun Co., Ltd.	800	11 757	13 746	
Oro Co., Ltd.	200	5 266	4 379	
PAX Global Technology Ltd.	1 000	1 182	1 027	
PC Partner Group Ltd.	4 000	3 013	3 148	
Pexip Holding ASA	3 807	12 920	14 188	
Pro-Ship Inc.	300	3 735	3 550	
QT Group Oyj	3	378	341	
RPMGlobal Holdings Ltd.	4 062	6 104	10 654	
RS Technologies Co., Ltd.	300	7 824	8 932	
RYODEN Corp.	100	1 478	2 352	
Shibaura Electronics Co., Ltd.	200	5 117	5 478	
Shinko Shoji Co., Ltd.	100	1 077	801	
Siltronic AG	206	26 827	21 872	
SK-Electronics Co., Ltd.	500	18 519	13 802	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Soliton Systems KK	200	2 167	2 076	
Southern Cross Payments Ltd.	3 745	3 967	–	
Spectris PLC	59	2 850	2 837	
Spigen Korea Co., Ltd.	410	15 374	11 738	
Startia Holdings Inc.	400	4 793	7 530	
SUESS MicroTec SE	444	28 601	40 045	
Sumida Corp.	1 800	19 949	17 608	
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	1 300	11 142	10 993	
Sun-Wa Technos Corp.	200	2 875	3 887	
Suzuki Co., Ltd.	600	6 380	7 222	
System Research Co., Ltd.	200	2 254	2 836	
Systena Corp.	8 700	24 500	23 238	
TAKEBISHI Corp.	700	11 782	13 558	
Technology One Ltd.	2 465	33 218	41 899	
Technoprobe SpA	59	809	796	
Tecnos Japan Inc.	400	2 358	2 389	
Teikoku Tsushin Kogyo Co., Ltd.	200	2 999	3 583	
Temenos AG	284	28 868	26 812	
TIS Inc.	100	2 563	2 652	
Tokyo Electron Ltd.	400	126 226	118 750	
Tomen Devices Corp.	100	5 318	6 422	
TomTom NV	289	3 009	2 236	
Tongda Group Holdings Ltd.	220 000	3 626	3 355	
Top Engineering Co., Ltd.	358	2 463	1 890	
Trend Micro Inc.	200	10 952	11 111	
Truly International Holdings Ltd.	40 000	6 339	6 309	
Trustpilot Group PLC	5 460	20 081	20 305	
Tsuzuki Denki Co., Ltd.	300	6 019	6 334	
Uchi Technologies Bhd	16 700	16 337	19 279	
Uchida Yoko Co., Ltd.	100	6 202	7 120	
Vaisala Oyj	100	5 758	5 895	
Vista Group International Ltd.	7 629	10 858	14 376	
VusionGroup	13	2 664	2 484	
Wacom Co., Ltd.	100	624	642	
Wasion Holdings Ltd.	20 000	12 959	23 976	
Wonik Holdings Co., Ltd.	824	2 909	2 793	
YE DIGITAL Corp.	1 100	7 124	7 720	
Zuken Inc.	100	3 754	3 594	
		1 760 165	2 101 250	6,44
Services de communication (31 décembre 2023 : 1,43 %)				
4imprint Group PLC	9	806	912	
Amuse Inc.	100	1 837	1 387	
Arnoldo Mondadori Editore SpA	3 390	9 655	12 131	
Aussie Broadband Ltd.	2 911	10 951	9 204	
Auto Trader Group PLC	586	8 365	8 121	
Avex Inc.	800	12 217	9 282	
BT Group PLC	18 712	42 948	45 426	
Cairo Communication SpA	511	1 294	1 559	
COOKPAD Inc.	1 000	1 429	1 591	
Daiichikosho Co., Ltd.	2 000	38 189	28 182	
Freebit Co., Ltd.	400	4 932	4 396	
G5 Entertainment AB	834	14 890	12 392	
Gakken Holdings Co., Ltd.	1 300	11 760	11 700	
Hemnet Group AB	608	23 590	25 155	
Inkeverse Group Ltd.	7	2	1	
Koninklijke KPN NV	100	465	525	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	35	258	208	
Millicom International Cellular SA	828	27 330	27 602	
Modern Times Group MTG AB	275	3 279	3 034	
MONY Group PLC	126	461	484	
Oricon Inc.	600	5 352	4 400	
Pico Far East Holdings Ltd.	42 000	10 417	13 397	
ProSiebenSat.1 Media SE	342	3 373	3 318	
Reach PLC	9 594	10 733	16 313	
Sanoma Oyj	1 276	14 859	12 145	
SKY Network Television Ltd.	31 195	66 843	61 124	
Square Enix Holdings Co., Ltd.	1 800	73 793	73 986	
Storytel AB	1 036	7 606	7 369	
Superloop Ltd.	3 747	4 588	5 496	
Telia Co AB	16 240	52 141	59 656	
Tuas Ltd.	9 871	25 637	39 871	
TX Group AG	139	33 250	34 416	
Ubisoft Entertainment SA	84	2 927	2 518	
Wantedly Inc.	400	6 205	4 628	
Xinhua Winshare Publishing and Media Co., Ltd., HKG	1 000	927	1 704	
Zenrin Co., Ltd.	700	5 555	5 591	
		538 864	549 224	1,68
Services publics (31 décembre 2023 : 1,14 %)				
Acciona SA	40	6 627	6 470	
AGL Energy Ltd.	9 563	75 948	94 645	
Audax Renovables SA	2 448	7 076	6 692	
Aygaz AS	691	5 195	5 191	
Baskent Dogalgaz Dagitim Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	5 785	5 904	7 558	
Cia Energetica de Minas Gerais, CAAE	153	453	369	
Colbun SA	109 706	20 241	19 369	
Contact Energy Ltd.	4 251	30 295	31 900	
Doral Group Renewable Energy Resources Ltd.	934	3 680	3 409	
Drax Group PLC	3 450	29 976	29 372	
Enagas SA	921	19 331	18 761	
EVN AG	68	2 816	2 972	
Fortum Oyj	454	9 465	9 088	
GAIL India Ltd., CIAE	230	4 967	4 941	
Hiroshima Gas Co., Ltd.	300	1 007	1 016	
Kenon Holdings Ltd.	1 148	37 876	39 180	
Manawa Energy Ltd.	1 100	3 968	3 779	
Manila Water Co Inc.	13 400	6 063	8 541	
Okinawa Electric Power Co Inc.	600	6 607	5 691	
Pertamina Geothermal Energy PT	1 444	113	144	
Sembcorp Industries Ltd.	6 900	36 480	33 510	
Severn Trent PLC	38	1 720	1 564	
Shizuoka Gas Co., Ltd.	300	2 728	2 442	
United Utilities Group PLC	1 975	36 760	33 567	
YTL Corp. Bhd	11 400	6 555	11 408	
YTL Power International Bhd	13 100	9 748	18 315	
		371 599	399 894	1,23
Immobilier (31 décembre 2023 : 1,18 %)				
Airport Facilities Co., Ltd.	1 400	7 782	7 193	
Allreal Holding AG	25	5 623	5 855	
Aroundtown SA	14 580	39 261	42 026	
B-Lot Co., Ltd.	1 400	12 667	11 266	
Capitaland India Trust	49 300	54 752	48 781	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Centurion Corp. Ltd.	3 700	2 144	2 185	
City Developments Ltd.	9 600	55 540	50 015	
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	6 000	5 149	5 069	
Daiwa House Industry Co., Ltd.	600	22 303	20 808	
Eurocommercial Properties NV	349	10 168	11 516	
GLP J-Reit	11	12 672	12 286	
Grandy House Corp.	600	3 495	3 083	
HMC Capital Ltd.	213	1 393	1 403	
IMMOFINANZ AG	88	3 059	3 343	
Intershop Holding AG	48	9 522	8 639	
IOI Properties Group Bhd	4 600	1 644	2 949	
Japan Metropolitan Fund Invest	20	15 816	15 397	
KDX Realty Investment Corp.	19	25 439	25 294	
LEG Immobilien SE	64	7 141	7 158	
Lendlease Corp. Ltd.	2 227	11 980	11 010	
Lotus's Retail Growth Freehold And Leasehold Property Fund	800	373	343	
Mah Sing Group Bhd	5 800	1 066	2 910	
Mapletree Pan Asia Commercial Trust	19 000	24 008	23 404	
Matrix Concepts Holdings Bhd	8 100	3 417	4 182	
Mirarth Holdings Inc.	100	514	441	
Mugen Estate Co., Ltd.	500	3 974	5 406	
Nexity SA	216	3 381	2 640	
Nisshin Group Holdings Co., Ltd.	900	4 700	4 303	
OSK Holdings Bhd	26 000	7 742	11 991	
Peet Ltd.	1 662	1 753	1 838	
Reit 1 Ltd.	5	42	25	
Rural Funds Group	623	1 336	1 136	
Sankyo Frontier Co., Ltd.	100	3 750	3 573	
Savills PLC	39	753	751	
Selvaag Bolig ASA	1 393	7 242	6 624	
Shurgard Self Storage Ltd.	230	13 032	12 160	
Starhill Global REIT	12 700	6 637	6 219	
Starts Corp. Inc.	200	5 450	5 776	
Summarecon Agung Tbk PT	40 000	2 525	1 671	
Swire Pacific Ltd.	3 500	35 938	42 326	
Swire Properties Ltd.	400	1 399	872	
SYN prop e tech SA	500	1 197	1 127	
TAG Immobilien AG	497	9 991	9 964	
TOC Co., Ltd.	300	1 920	1 878	
VGP NV	99	15 105	15 099	
Vonovia SE	1 025	42 322	39 910	
Yoma Strategic Holdings Ltd.	38 900	3 516	4 831	
		510 633	506 676	1,55
Total des actions étrangères – position acheteur		17 326 785	18 701 261	57,33
Actions étrangères – position vendeur				
Énergie (31 décembre 2023 : -3,04 %)				
Beach Energy Ltd.	(840)	(1 129)	(1 144)	
Borr Drilling Ltd.	(462)	(3 734)	(4 079)	
Boss Energy Ltd.	(5 714)	(20 568)	(21 566)	
BP PLC, CAAE	(2 029)	(105 299)	(100 227)	
Cooper Energy Ltd.	(9 662)	(3 114)	(1 987)	
Diversified Energy Co PLC	(19)	(588)	(345)	
Ecopetrol SA	(5 544)	(88 501)	(84 889)	
Energean PLC	(49)	(776)	(836)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Eni SpA, MIL	(2 317)	(43 487)	(48 774)	
Eni SpA, NYSE	(3 498)	(145 644)	(147 375)	
Expro Group Holdings NV	(397)	(9 355)	(12 451)	
Gaztransport Et Technigaz SA	(81)	(14 599)	(14 480)	
Geo Energy Resources Ltd.	(200)	(67)	(59)	
John Wood Group PLC	(282)	(637)	(1 006)	
Neste Oyj	(6 261)	(193 802)	(152 650)	
New Hope Corp. Ltd.	(1 379)	(5 621)	(6 150)	
Paladin Energy Ltd.	(4 000)	(46 212)	(45 619)	
Reliance Industries Ltd., CIAE	(176)	(14 849)	(17 966)	
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	(7)	(416)	(388)	
Shell PLC, CAAE	(1 030)	(99 920)	(101 730)	
TGS ASA	(4 136)	(53 180)	(68 142)	
Verbio Vereinigte Bioenergie AG	(466)	(12 161)	(11 919)	
Weatherford International PLC	(125)	(16 715)	(20 944)	
Woodside Energy Group Ltd.	(722)	(18 241)	(18 583)	
		(898 615)	(883 309)	(2,71)
Matières premières (31 décembre 2023 : -2,76 %)				
Anglogold Ashanti PLC	(695)	(22 196)	(23 899)	
APERAM SA	(412)	(16 252)	(14 586)	
Aurubis AG	(9)	(1 003)	(967)	
BEWi ASA	(813)	(3 098)	(2 534)	
Billerud Aktiebolag	(54)	(776)	(684)	
Bowen Coking Coal Ltd.	(13 902)	(1 631)	(661)	
Buzzi SpA	(386)	(19 681)	(21 273)	
Chalice Mining Ltd.	(32 292)	(34 352)	(41 904)	
Champion Iron Ltd., ASX	(256)	(1 464)	(1 497)	
Corbion NV	(346)	(8 887)	(9 504)	
Core Lithium Ltd.	(32 604)	(28 148)	(2 771)	
Croda International PLC	(10)	(838)	(683)	
De Grey Mining Ltd.	(4 558)	(4 820)	(4 748)	
Gold Fields Ltd.	(1 324)	(25 712)	(26 994)	
H+H International A/S	(176)	(2 718)	(3 475)	
Harmony Gold Mining Co., Ltd.	(252)	(3 043)	(3 162)	
ICL Group Ltd.	(443)	(2 799)	(2 624)	
Imdex Ltd.	(1 208)	(2 383)	(2 451)	
Israel Corp. Ltd.	(2)	(649)	(612)	
Liontown Resources Ltd.	(44 735)	(50 459)	(36 997)	
Lynas Rare Earths Ltd.	(14 153)	(77 006)	(76 697)	
Marshalls PLC	(111)	(511)	(562)	
Mineral Resources Ltd.	(3 259)	(170 220)	(160 587)	
Nanofilm Technologies International Ltd.	(100)	(74)	(75)	
Nickel Industries Ltd.	(1 124)	(862)	(822)	
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	(1 300)	(12 654)	(11 589)	
Novonesis (Novozymes) B	(1 480)	(115 687)	(124 014)	
Nufarm Ltd.	(2 287)	(10 117)	(9 614)	
Pilbara Minerals Ltd.	(90 602)	(290 145)	(254 186)	
Sayona Mining Ltd.	(80 834)	(3 563)	(2 659)	
Sibanye Stillwater Ltd.	(37 778)	(245 664)	(224 866)	
Sims Ltd.	(2 424)	(24 406)	(22 816)	
SOL SpA	(29)	(678)	(1 408)	
Suzano SA	(4 219)	(53 372)	(59 289)	
Svenska Cellulosa AB SCA	(2 558)	(52 205)	(51 742)	
Syrah Resources Ltd.	(6 519)	(3 470)	(2 115)	
Talga Group Ltd.	(3 161)	(3 142)	(1 675)	
Tata Steel Ltd.	(14)	(354)	(395)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Yara International ASA	(3 042)	(124 171)	(120 252)	
Zignago Vetro SpA	(28)	(519)	(485)	
		(1 419 729)	(1 327 874)	(4,07)
Industries (31 décembre 2023 : -4,63 %)				
AFC Energy PLC	(3 797)	(986)	(1 103)	
Air France-KLM	(79)	(1 293)	(953)	
Airbus SE	(908)	(207 242)	(170 793)	
Alfen N.V.	(1 004)	(72 511)	(25 414)	
Ashtead Group PLC	(29)	(2 882)	(2 650)	
Ashtrom Group Ltd.	(83)	(1 513)	(1 297)	
Assa Abloy AB	(1 323)	(52 860)	(51 215)	
Atlas Arteria Ltd.	(4 056)	(19 211)	(18 941)	
AutoStore Holdings Ltd.	(3 836)	(8 714)	(6 192)	
Ayvens SA	(159)	(1 407)	(1 263)	
BayWa AG	(22)	(718)	(653)	
Beijer Ref AB	(2 466)	(42 220)	(52 096)	
Bunzl PLC	(35)	(1 808)	(1 822)	
Bystronic AG	(1)	(711)	(576)	
Carel Industries SpA	(22)	(614)	(558)	
Cavendish Hydrogen ASA	(37)	(138)	(131)	
Chrysos Corp. Ltd.	(80)	(396)	(416)	
Clarivate PLC	(3 944)	(40 322)	(30 708)	
Clarkson PLC	(148)	(8 653)	(10 598)	
Daetwyler Holding AG	(3)	(768)	(771)	
Daimler Truck Holding AG	(2 797)	(159 945)	(152 467)	
Dfds A/S	(54)	(2 160)	(2 091)	
DKSH Holding AG	(6)	(550)	(555)	
DSV A/S	(961)	(202 879)	(201 645)	
East Japan Railway Co.	(100)	(2 195)	(2 267)	
Elco Ltd.	(144)	(8 941)	(5 148)	
Emeren Group Ltd.	(971)	(2 773)	(1 993)	
Epiroc AB, cat. A	(971)	(27 537)	(26 535)	
Experian PLC	(746)	(47 691)	(47 563)	
Finnair Oyj	(967)	(3 996)	(3 722)	
Fluidra SA	(955)	(16 914)	(27 297)	
GARO AB	(316)	(1 471)	(1 092)	
Geberit AG	(17)	(14 221)	(13 741)	
Getlink SE	(49)	(1 104)	(1 110)	
Grafton Group PLC	(22)	(444)	(353)	
GVS SpA	(44)	(359)	(424)	
Harmonic Drive Systems Inc.	(1 100)	(35 633)	(42 575)	
Hexagon Purus ASA	(7 179)	(10 253)	(7 316)	
Hexatronic Group AB	(3 754)	(15 820)	(24 689)	
Husqvarna AB	(177)	(2 060)	(1 943)	
IMCD NV	(65)	(13 643)	(12 325)	
IPH Ltd.	(623)	(3 426)	(3 570)	
Japan Steel Works Ltd.	(300)	(11 538)	(10 930)	
Johns Lyng Group Ltd.	(1 283)	(6 773)	(6 683)	
Johnson Controls International PLC	(1 255)	(117 028)	(114 147)	
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	(3 000)	(55 694)	(59 715)	
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	(1 300)	(86 302)	(57 238)	
Kelsian Group Ltd.	(391)	(1 974)	(1 840)	
Komax Holding AG	(112)	(28 678)	(22 239)	
Kornit Digital Ltd.	(3 552)	(84 053)	(71 156)	
Kosaido Holdings Co., Ltd.	(1 000)	(7 007)	(5 265)	
Kuehne + Nagel International AG	(587)	(221 888)	(230 971)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Learning Technologies Group PLC	(354)	(464)	(517)	
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	(6 500)	(80 209)	(95 268)	
Mitsui E&S Co., Ltd.	(1 600)	(23 068)	(19 817)	
MonotaRO Co., Ltd.	(200)	(3 241)	(3 217)	
MTU Aero Engines AG	(432)	(141 929)	(151 290)	
Namura Shipbuilding Co., Ltd.	(200)	(2 708)	(4 098)	
NEL ASA	(2 321)	(2 021)	(1 671)	
Nibe Industrier AB	(11 247)	(78 322)	(65 307)	
Nippon Yusen KK	(2 800)	(120 199)	(111 516)	
Nitto Boseki Co., Ltd.	(100)	(3 811)	(5 521)	
Nomura Micro Science Co., Ltd.	(400)	(10 898)	(14 699)	
NTG Nordic Transport Group A/S	(5)	(359)	(299)	
PNE AG	(21)	(408)	(418)	
PowerCell Sweden AB	(1 233)	(4 787)	(4 687)	
Prosegur Cia de Seguridad SA	(50)	(292)	(125)	
Qantas Airways Ltd.	(442)	(2 201)	(2 363)	
Raksul Inc.	(400)	(5 402)	(3 232)	
Rentokil Initial PLC	(13 505)	(100 398)	(107 735)	
Saab AB	(790)	(25 549)	(26 029)	
Seatrium Ltd.	(21 480)	(39 117)	(29 929)	
SG Holdings Co., Ltd.	(100)	(1 303)	(1 261)	
Shapir Engineering and Industry Ltd.	(438)	(3 773)	(3 040)	
Sixt SE	(72)	(8 843)	(6 995)	
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	(3 596)	(228 307)	(200 513)	
S-Pool Inc.	(100)	(290)	(275)	
Stabilus SE	(7)	(484)	(439)	
Tinexta SpA	(96)	(3 051)	(2 272)	
TOMRA Systems ASA	(6 787)	(103 773)	(111 121)	
Vow ASA	(1 250)	(2 350)	(1 107)	
Wizz Air Holdings PLC	(20)	(750)	(774)	
		(2 658 224)	(2 514 290)	(7,71)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -1,82 %)				
AB Dynamics PLC	(11)	(347)	(390)	
After You PCL	(2)	(1)	(1)	
Aptiv PLC	(160)	(16 606)	(15 417)	
Aston Martin Lagonda Global Holdings PLC	(152)	(353)	(378)	
Auction Technology Group PLC	(700)	(6 133)	(6 066)	
Avolta AG	(2 930)	(156 052)	(155 711)	
Azorim-Investment Development & Construction Co., Ltd.	(1 069)	(4 792)	(5 886)	
Bapcor Ltd.	(815)	(3 760)	(3 828)	
Basic-Fit NV	(1 286)	(43 431)	(37 946)	
Brunello Cucinelli SpA	(15)	(2 076)	(2 057)	
Cie Financière Richemont SA	(824)	(164 926)	(175 977)	
Crest Nicholson Holdings PLC	(282)	(1 076)	(1 172)	
Dometic Group AB	(1 105)	(11 116)	(9 609)	
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	(1 692)	(68 606)	(55 494)	
Eagers Automotive Ltd.	(1 476)	(14 929)	(14 190)	
Entain PLC	(154)	(2 158)	(1 678)	
Flight Centre Travel Group Ltd.	(1 752)	(32 649)	(32 310)	
Food & Life Cos Ltd.	(100)	(2 857)	(2 215)	
GN Store Nord AS	(929)	(34 036)	(35 460)	
GreenTree Hospitality Group Ltd.	(51)	(271)	(170)	
Henry Boot PLC	(100)	(373)	(363)	
IDP Education Ltd.	(9 462)	(162 984)	(131 000)	
JM AB	(4 036)	(91 612)	(103 306)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
KMD Brands Ltd.	(2)	(2)	(1)	
Leifheit AG	(1)	(20)	(25)	
Maytronics Ltd.	(1 315)	(8 227)	(6 697)	
Melco Resorts & Entertainment Ltd.	(3 374)	(35 389)	(34 441)	
Mercari Inc.	(1 900)	(29 495)	(32 284)	
MIPS AB	(776)	(31 102)	(41 610)	
Moncler SpA	(565)	(51 880)	(47 279)	
New Wave Group AB	(117)	(1 677)	(1 655)	
Nextage Co., Ltd.	(900)	(22 340)	(18 397)	
Nokian Renkaat Oyj	(588)	(7 124)	(6 631)	
Ollamani SAB	(8)	(20)	(25)	
Pan Pacific International Holdings Corp.	(100)	(3 426)	(3 202)	
Pirelli & C SpA	(159)	(1 442)	(1 296)	
Porsche Automobil Holding SE, actions priv.	(593)	(42 125)	(36 708)	
Prosus NV	(718)	(29 379)	(35 022)	
Salvatore Ferragamo SpA	(166)	(2 742)	(1 924)	
Sega Sammy Holdings Inc.	(100)	(1 722)	(2 032)	
Signet Jewelers Ltd.	(14)	(1 713)	(1 716)	
SSP Group PLC	(10 162)	(26 670)	(26 032)	
Star Entertainment Grp Ltd.	(40 287)	(21 067)	(18 040)	
Tabcorp Holdings Ltd.	(873)	(702)	(558)	
Tadiran Group Ltd.	(13)	(1 607)	(931)	
Verkkokauppa.com Oyj	(24)	(139)	(77)	
WH Smith PLC	(331)	(8 414)	(6 481)	
		(1 149 568)	(1 113 688)	(3,41)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -1,43 %)				
Aker BioMarine ASA	(100)	(514)	(1 076)	
Anheuser-Busch InBev SA	(18)	(1 430)	(1 432)	
Anora Group Oyj	(100)	(1 064)	(667)	
Atlantic Sapphire ASA	(1 006)	(1 696)	(1 189)	
Axfood AB	(87)	(3 183)	(3 130)	
Bakkafrost P/F	(16)	(1 206)	(1 114)	
Barry Callebaut AG	(19)	(39 126)	(42 357)	
Becle SAB de CV	(600)	(1 980)	(1 485)	
BrasilAgro – Co Brasileira de Propriedades Agricolas	(1 019)	(7 783)	(6 414)	
Calbee Inc.	(100)	(2 866)	(2 628)	
Cia Cervecerias Unidas SA	(1 150)	(20 787)	(17 908)	
Cloetta AB	(2 570)	(6 062)	(6 847)	
Danone SA	(43)	(3 690)	(3 600)	
Davide Campari-Milano NV	(19 477)	(269 589)	(252 046)	
Diageo PLC	(454)	(90 453)	(78 324)	
Elders Ltd.	(318)	(2 360)	(2 371)	
Endeavour Group Ltd.	(1 642)	(7 742)	(7 578)	
Fevertree Drinks PLC	(564)	(10 090)	(10 575)	
ForFarmers NV	(77)	(375)	(304)	
Grieg Seafood ASA	(1 744)	(16 097)	(14 064)	
Heineken NV	(2 003)	(257 444)	(265 253)	
HelloFresh SE	(9 567)	(87 502)	(63 417)	
Interparfums SA	(7)	(419)	(392)	
Italian Wine Brands SpA	(100)	(3 746)	(3 212)	
Kao Corp.	(200)	(11 731)	(11 099)	
Kerry Group PLC	(375)	(43 812)	(41 604)	
Kobayashi Pharmaceutical Co., Ltd.	(600)	(29 543)	(26 657)	
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	(200)	(3 067)	(3 177)	
Kusuri no Aoki Holdings Co., Ltd.	(100)	(2 569)	(2 586)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Nestlé SA	(364)	(51 472)	(50 838)	
Ocado Group PLC	(10 102)	(63 107)	(50 481)	
Orkla ASA	(1 866)	(19 476)	(20 803)	
Pernod Ricard SA	(23)	(5 160)	(4 274)	
Pharmanutra SpA	(65)	(4 822)	(4 533)	
Reckitt Benckiser Group PLC	(393)	(29 562)	(29 108)	
Redcare Pharmacy NV	(168)	(28 047)	(28 087)	
Schouw & Co A/S	(150)	(15 431)	(16 135)	
Select Harvests Ltd.	(2 909)	(10 355)	(10 474)	
Sheng Siong Group Ltd.	(600)	(929)	(903)	
Strauss Group Ltd.	(482)	(11 765)	(9 769)	
Tesco PLC	(771)	(3 891)	(4 081)	
Unilever PLC	(1 331)	(92 102)	(100 151)	
		(1 264 045)	(1 202 143)	(3,68)
Soins de santé (31 décembre 2023 : -3,99 %)				
ArcticZymes Technologies ASA	(243)	(959)	(781)	
Argenx SE	(8)	(4 093)	(4 794)	
Argenx SE, CAAÉ	(389)	(200 884)	(228 904)	
AstraZeneca PLC, CAAÉ	(716)	(64 873)	(76 410)	
Atrys Health SA	(123)	(1 785)	(639)	
Bachem Holding AG	(9)	(1 091)	(1 130)	
BioArctic AB	(745)	(22 720)	(22 024)	
BioMérieux	(6)	(881)	(781)	
Boiron SA	(50)	(3 032)	(2 299)	
Chemometec A/S	(137)	(10 700)	(8 206)	
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	(4 300)	(213 632)	(209 078)	
Clinuvel Pharmaceuticals Ltd.	(102)	(1 407)	(1 433)	
Coloplast A/S	(885)	(140 059)	(145 600)	
CompuGroup Medical SE & Co KgaA	(62)	(2 686)	(2 164)	
COSMO Pharmaceuticals NV	(7)	(744)	(747)	
CRISPR Therapeutics AG	(378)	(28 659)	(27 936)	
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	(500)	(24 373)	(23 495)	
DiaSorin SpA	(481)	(66 311)	(65 645)	
Establishment Labs Holdings Inc.	(88)	(4 967)	(5 472)	
Evotec SE	(6 560)	(91 646)	(86 344)	
Galapagos NV, CAAÉ	(546)	(21 758)	(18 514)	
Genmab A/S	(660)	(261 363)	(226 484)	
Getinge AB	(544)	(15 066)	(12 656)	
GNI Group Ltd.	(600)	(19 529)	(12 091)	
Grifols SA	(1 259)	(12 294)	(10 862)	
I-Mab	(223)	(880)	(510)	
Inmode Ltd.	(5 494)	(152 028)	(137 123)	
Integral Diagnostics Ltd.	(176)	(382)	(429)	
JMDC Inc.	(400)	(16 470)	(11 300)	
Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	(4)	(353)	(514)	
Legend Biotech Corp.	(3 293)	(215 293)	(199 569)	
Lonza Group AG	(67)	(49 238)	(50 032)	
Medacta Group SA	(31)	(5 627)	(5 768)	
Medicover AB	(362)	(5 996)	(8 906)	
MeiraGTx Holdings PLC	(305)	(2 236)	(1 757)	
Merck KgaA	(52)	(12 907)	(11 801)	
Merus NV	(326)	(16 856)	(26 395)	
Mesoblast Ltd.	(6 190)	(4 929)	(5 600)	
Mesoblast Ltd., CAAÉ	(117)	(437)	(1 090)	
Molecular Partners AG	(114)	(2 464)	(1 132)	
Nykode Therapeutics ASA	(1 678)	(3 148)	(3 297)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Orion Oyj	(46)	(2 460)	(2 689)	
Oxford Nanopore Technologies PLC	(2 352)	(4 204)	(3 840)	
PolyNovo Ltd.	(14 156)	(19 105)	(31 694)	
ProQR Therapeutics NV	(95)	(269)	(216)	
QIAGEN NV	(642)	(37 353)	(36 295)	
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	(766)	(54 705)	(54 708)	
Ryman Healthcare Ltd.	(228)	(704)	(677)	
Sanofi SA	(636)	(41 900)	(42 225)	
Sartorius AG	(8)	(2 554)	(2 569)	
Sartorius Stedim Biotech	(13)	(3 793)	(2 923)	
Shionogi & Co., Ltd.	(100)	(6 408)	(5 339)	
Spire Healthcare Group PLC	(98)	(388)	(398)	
Straumann Holding AG	(1 244)	(223 331)	(210 835)	
Surgical Science Sweden AB	(49)	(882)	(792)	
Swedish Orphan Biovitrum AB	(1 231)	(43 337)	(45 108)	
Sysmex Corp.	(200)	(4 583)	(4 408)	
Tecan Group AG	(24)	(11 764)	(10 993)	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	(3 127)	(71 959)	(69 531)	
Valneva SE	(87)	(457)	(406)	
Vetoquinol SA	(100)	(10 465)	(13 741)	
Vimian Group AB	(150)	(581)	(666)	
Virbac SACA	(1)	(540)	(479)	
Vitrolife AB	(347)	(8 081)	(7 815)	
		(2 254 579)	(2 208 059)	(6,77)
Services financiers (31 décembre 2023 : -4,38 %)				
Adyen NV	(173)	(312 105)	(282 430)	
Aegon Ltd., AMS	(3 504)	(27 794)	(29 640)	
Aegon Ltd., NYSE	(807)	(3 229)	(6 769)	
Arch Capital Group Ltd.	(115)	(15 622)	(15 876)	
ASR Nederland NV	(196)	(13 146)	(12 794)	
Bank of Ireland Group PLC	(44)	(577)	(630)	
Credit Corp. Group Ltd.	(1 585)	(21 211)	(21 683)	
Daiwa Securities Group Inc.	(2 800)	(31 797)	(29 225)	
Grupo Aval Acciones y Valores SA	(811)	(2 701)	(2 419)	
HDFC Bank Ltd., CAAÉ	(3 635)	(295 700)	(319 973)	
HSBC Holdings PLC, CAAÉ	(2 398)	(142 419)	(142 736)	
Illimity Bank SpA	(72)	(581)	(503)	
Judo Capital Holdings Ltd.	(533)	(601)	(614)	
Jyske Bank A/S	(1 597)	(177 419)	(173 986)	
MA Financial Group Ltd.	(6 062)	(27 778)	(24 818)	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., CAAÉ	(20 124)	(276 051)	(297 395)	
Nexi SpA	(6 037)	(78 602)	(50 412)	
Nomura Holdings Inc.	(7 300)	(60 776)	(57 253)	
Phoenix Group Holdings PLC	(240)	(2 050)	(2 165)	
Poste Italiane SpA	(266)	(4 757)	(4 640)	
Prudential PLC, CAAÉ	(1 947)	(51 875)	(48 808)	
Ringkjoebing Landbobank A/S	(109)	(25 725)	(24 993)	
St James's Place PLC	(6 834)	(55 932)	(64 601)	
Swedbank AB	(141)	(3 900)	(3 973)	
WealthNavi Inc.	(100)	(1 234)	(1 283)	
Westpac Banking Corp.	(1 004)	(23 831)	(24 984)	
Willis Towers Watson PLC	(146)	(50 994)	(52 370)	
		(1 708 407)	(1 696 973)	(5,20)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -6,83 %)				
Adesso SE	(2)	(334)	(246)	
Adtran Networks SE	(16)	(395)	(464)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Appier Group Inc.	(1 200)	(17 785)	(12 331)	
Aurora Innovation Inc.	(2 337)	(10 262)	(8 858)	
BrainChip Holdings Ltd.	(5 042)	(1 887)	(1 014)	
Canaan Inc.	(10 143)	(20 430)	(13 876)	
Crayon Group Holding ASA	(152)	(1 592)	(2 442)	
Dassault Systèmes SE	(26)	(1 333)	(1 346)	
Digital Garage Inc.	(600)	(26 810)	(12 607)	
Disco Corp.	(100)	(56 279)	(51 923)	
FD Technologies PLC	(20)	(379)	(493)	
Formula Systems 1985 Ltd.	(5)	(498)	(481)	
FUJIFILM Holdings Corp.	(1 600)	(48 410)	(51 202)	
Halma PLC	(66)	(2 450)	(3 089)	
Infineon Technologies AG	(592)	(29 857)	(29 783)	
Infosys Ltd.	(8 983)	(217 181)	(228 874)	
Innoviz Technologies Ltd.	(4 776)	(11 563)	(6 061)	
JinkoSolar Holding Co., Ltd.	(1 103)	(37 739)	(31 272)	
Keyence Corp.	(300)	(181 958)	(180 039)	
Keywords Studios PLC	(226)	(8 568)	(9 038)	
Kitron ASA	(131)	(468)	(532)	
Lasertec Corp.	(1 000)	(321 025)	(306 989)	
Maxeon Solar Technologies Ltd.	(39)	(81)	(46)	
Melexis NV	(104)	(12 307)	(12 263)	
Meyer Burger Technology AG	(56 646)	(1 035)	(949)	
Money Forward Inc.	(1 400)	(73 822)	(64 249)	
Nano Dimension Ltd.	(2 296)	(7 229)	(6 912)	
Netbay PCL	(1)	(1)	(1)	
Netcompany Group A/S	(343)	(21 690)	(20 155)	
Nice Ltd.	(687)	(204 147)	(161 661)	
Nordic Semiconductor ASA	(6 565)	(90 853)	(120 310)	
NPC Inc.	(100)	(1 135)	(1 031)	
PKSHA Technology Inc.	(300)	(14 782)	(9 047)	
Rakus Co., Ltd.	(500)	(10 496)	(8 857)	
REC Silicon ASA	(1 207)	(1 940)	(1 083)	
Renesas Electronics Corp.	(800)	(20 331)	(20 477)	
Reply SpA	(103)	(19 328)	(20 815)	
Rorze Corp.	(200)	(55 573)	(54 016)	
Secunet Security Networks AG	(1)	(821)	(184)	
Sesa SpA	(5)	(727)	(845)	
SHIFT Inc.	(100)	(24 415)	(12 402)	
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	(200)	(9 666)	(9 595)	
Silex Systems Ltd.	(7 733)	(26 924)	(37 666)	
Sinch AB	(23 097)	(73 097)	(76 697)	
SiteMinder Ltd.	(162)	(769)	(754)	
SMA Solar Technology AG	(100)	(3 898)	(3 866)	
SMART Global Holdings Inc.	(484)	(13 575)	(15 146)	
Softcat PLC	(57)	(1 536)	(1 791)	
Softwareone Holding AG	(34)	(561)	(875)	
Tokyo Electron Device Ltd.	(1 000)	(57 327)	(36 408)	
Towa Corp.	(300)	(10 782)	(28 786)	
Tri Chemical Laboratories Inc.	(200)	(8 001)	(7 401)	
Vitec Software Group AB	(35)	(2 393)	(2 487)	
WiseTech Global Ltd.	(2 249)	(144 287)	(206 142)	
		(1 910 732)	(1 895 877)	(5,81)
Services de communication (31 décembre 2023 : -1,54 %)				
America Movil SAB de CV	(1 593)	(39 505)	(37 056)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Ascential PLC	(201)	(1 183)	(1 189)	
Better Collective A/S	(146)	(4 506)	(4 282)	
Cellnex Telecom SA	(5 041)	(238 610)	(224 519)	
Domain Holdings Australia Ltd.	(4 454)	(15 388)	(12 414)	
Embracer Group AB	(13 215)	(34 872)	(39 768)	
Freenet AG	(60)	(2 315)	(2 182)	
Future PLC	(16)	(282)	(290)	
Grupo Televisa SAB	(318)	(1 630)	(1 205)	
Hakuhodo DY Holdings Inc.	(600)	(7 633)	(5 997)	
Heroz Inc.	(200)	(2 789)	(2 144)	
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	(13 304)	(195 764)	(190 230)	
ITV PLC	(14 560)	(20 652)	(20 274)	
Japan Communications Inc.	(400)	(911)	(640)	
Kakaku.com Inc.	(300)	(4 671)	(5 381)	
Métropole Télévision SA	(160)	(3 091)	(2 755)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., A	(2 257)	(8 124)	(10 651)	
MFE-MediaForEurope NV, actions ord., B	(122)	(729)	(725)	
Mobile TeleSystems PJSC	(911)	(8 419)	–	
Nexon Co., Ltd.	(3 500)	(83 680)	(88 573)	
Nine Entertainment Co Holdings Ltd.	(7 168)	(10 261)	(9 171)	
Perion Network Ltd.	(157)	(2 573)	(1 808)	
Remedy Entertainment Oyj	(27)	(644)	(695)	
RTL Group SA	(909)	(41 461)	(37 859)	
SEEK Ltd.	(8 103)	(180 263)	(158 169)	
Southern Cross Media Group Ltd.	(1 688)	(1 529)	(941)	
Viaplay Group AB	(43 577)	(5 284)	(4 039)	
Vivendi SE	(65)	(954)	(930)	
YouGov PLC	(79)	(586)	(555)	
		(918 309)	(864 442)	(2,65)
Services publics (31 décembre 2023 : -0,58 %)				
Consolidated Water Co., Ltd.	(26)	(975)	(944)	
E.ON SE	(3 706)	(65 998)	(66 606)	
EDP Renovaveis SA	(3)	(62)	(57)	
Elia Group SA	(27)	(3 787)	(3 463)	
ERG SpA	(286)	(10 182)	(9 831)	
Hokkaido Electric Power Co Inc.	(300)	(2 924)	(3 047)	
Italgas SpA	(178)	(1 312)	(1 201)	
Kansai Electric Power Co Inc.	(100)	(2 296)	(2 298)	
Neoen SA	(797)	(28 371)	(44 018)	
Snam SpA	(3 426)	(21 537)	(20 756)	
Voltalia SA	(77)	(765)	(977)	
		(138 209)	(153 198)	(0,47)
Immobilier (31 décembre 2023 : -1,32 %)				
Abacus Group	(14 704)	(32 964)	(15 520)	
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	(961)	(9 121)	(8 796)	
Atrium Ljungberg AB	(18)	(325)	(478)	
CapitaLand China Trust	(500)	(357)	(338)	
Castellum AB	(6 113)	(102 928)	(102 207)	
Cedar Woods Properties Ltd.	(473)	(2 019)	(2 045)	
Charter Hall Group	(9 841)	(97 877)	(100 544)	
Charter Hall Long Wale REIT	(777)	(2 739)	(2 308)	
Charter Hall Retail REIT	(2 598)	(7 740)	(7 716)	
Charter Hall Social Infrastructure REIT	(248)	(563)	(537)	
Corem Property Group AB	(1 357)	(1 502)	(1 533)	
Deutsche Wohnen SE	(113)	(6 022)	(2 976)	
Fastighets AB Balder	(4 751)	(43 767)	(44 579)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)
Au 30 juin 2024

	Nombre d'actions	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Frasers Centrepoint Trust	(200)	(431)	(430)	
Great Portland Estates PLC	(648)	(4 070)	(3 760)	
Great Portland Estates PLC, droits	(388)	–	(752)	
Growthpoint Properties Australia Ltd.	(2 668)	(5 881)	(5 291)	
Hamborner REIT AG	(38)	(373)	(363)	
Hongkong Land Holdings Ltd.	(500)	(2 144)	(2 210)	
Hufvudstaden AB	(417)	(6 871)	(6 762)	
Hulic Co., Ltd.	(100)	(1 271)	(1 212)	
Immobel SA	(49)	(5 150)	(1 782)	
IRSA Inversiones y Representaciones SA, bons de souscription, éch. le 5 mars 2026	(290)	–	(287)	
K-fast Holding AB	(174)	(396)	(452)	
Lifestyle Communities Ltd.	(2 605)	(34 853)	(29 591)	
Mercialys SA	(41)	(627)	(621)	
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	(100)	(2 290)	(2 144)	
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	(2 600)	(35 592)	(32 478)	
Mivne Real Estate KD Ltd.	(402)	(1 308)	(1 288)	
Miyakoshi Holdings Inc.	(200)	(1 704)	(3 452)	
Pandox AB	(333)	(4 781)	(8 132)	
PEXA Group Ltd.	(200)	(2 597)	(2 520)	
SRE Holdings Corp.	(400)	(12 507)	(16 332)	
Supermarket Income Reit PLC	(4 266)	(5 484)	(5 350)	
Tokyo Tatemono Co., Ltd.	(100)	(2 190)	(2 160)	
Wallenstam AB	(20)	(95)	(130)	
Wihlborgs Fastigheter AB	(169)	(2 071)	(2 138)	
		(440 610)	(419 214)	(1,28)
Total des actions étrangères – position vendeur		(14 761 027)	(14 279 067)	(43,76)
Commissions de courtage intégrées (note 3)		(22 936)		
Total du portefeuille de placements		(7 391 867)	(5 256 397)	(16,11)
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			268 224	0,82
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)			(14 213)	(0,04)
Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			1 515 071	4,64
Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total (Annexe 2)			(1 602 435)	(4,91)
Autres actifs, moins les passifs			37 714 883	115,60
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			32 625 133	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Contrepartie*	Code de devise	Montant vendu	Code de devise	Montant acheté	Date d'échéance	Plus-value (moins-value) latente $
Banque Royale du Canada	EUR	(182 000)	USD	196 236	13 sept. 2024	592
Banque Royale du Canada	ILS	(1 771 000)	USD	474 539	13 sept. 2024	3 756
Banque Royale du Canada	JPY	(308 357 000)	USD	1 992 975	13 sept. 2024	71 470
Banque Royale du Canada	JPY	(24 039 000)	USD	152 310	13 sept. 2024	1 439
Banque Royale du Canada	USD	(146 332)	MXN	2 728 000	13 sept. 2024	1 410
Banque Royale du Canada	NZD	(188 000)	USD	114 920	13 sept. 2024	493
Banque Royale du Canada	SGD	(1 057 000)	USD	784 168	13 sept. 2024	1 808
Banque Royale du Canada	USD	(21 950 027)	CAD	30 169 000	13 sept. 2024	187 256
						268 224
Banque Royale du Canada	AUD	(663 000)	USD	438 563	13 sept. 2024	(6 906)
Banque Royale du Canada	USD	(448 829)	GBP	354 000	13 sept. 2024	(1 456)
Banque Royale du Canada	EUR	(75 000)	USD	80 554	13 sept. 2024	(178)
Banque Royale du Canada	KRW	(614 744 000)	USD	446 989	13 sept. 2024	(2 186)
Banque Royale du Canada	NOK	(7 349 000)	USD	688 976	13 sept. 2024	(3 487)
						(14 213)
						254 011

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

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				
Livre sterling – taux moyen de l'indice de financement à un jour (SONIA)				
182	31 juill. 2024	4Imprint Group Plc, swap sur rendement total	18 448	(2 055)
2 792	31 juill. 2024	Aj Bell Plc, swap sur rendement total	18 328	(332)
4 935	31 juill. 2024	Alfa Financial Software Hold, swap sur rendement total	15 843	(38)
489	31 juill. 2024	Ashmore Group Plc, swap sur rendement total	1 439	(197)
7 181	31 juill. 2024	Babcock Intl Group Plc, swap sur rendement total	64 839	(5 655)
699	31 juill. 2024	Bakkavor Group Plc, swap sur rendement total	1 729	27
130	31 juill. 2024	Balfour Beatty Plc, swap sur rendement total	839	1
2 121	31 juill. 2024	Bank Of Cyprus Holdings Plc, swap sur rendement total	12 290	(1 222)
231	31 juill. 2024	Bank Of Georgia Group Plc, swap sur rendement total	16 123	1 244
80	31 juill. 2024	Bellway Plc, swap sur rendement total	3 531	(184)
327	31 juill. 2024	Bodycote Plc, swap sur rendement total	3 858	(423)
828	31 juill. 2024	Braemar Shipping Services Pl, swap sur rendement total	4 218	138
2 962	31 juill. 2024	Breedon Group Plc, swap sur rendement total	19 828	6
2 254	31 juill. 2024	Brown (N) Group Plc, swap sur rendement total	785	227
183	31 juill. 2024	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	3 229	(329)
15 417	31 juill. 2024	Capita Plc, swap sur rendement total	3 600	(214)
4 447	31 juill. 2024	Card Factory Plc, swap sur rendement total	7 154	(357)
112	31 juill. 2024	Close Brothers Group Plc, swap sur rendement total	821	(104)
474	31 juill. 2024	Currys Plc, swap sur rendement total	590	(48)
2 269	31 juill. 2024	Dfs Furniture Plc, swap sur rendement total	4 317	(102)
6 520	31 juill. 2024	Domino'S Pizza Group Plc, swap sur rendement total	34 600	(2 902)
13 019	31 juill. 2024	Firstgroup Plc, swap sur rendement total	35 648	(2 911)
846	31 juill. 2024	Foxtons Group Plc, swap sur rendement total	960	(68)
979	31 juill. 2024	Frasers Group Plc, swap sur rendement total	14 944	(31)
1 048	31 juill. 2024	Galliford Try Plc, swap sur rendement total	4 332	(501)
740	31 juill. 2024	Georgia Capital Plc, swap sur rendement total	12 544	380
22 556	31 juill. 2024	Glencore Plc, swap sur rendement total	176 000	(10 250)
22 886	31 juill. 2024	Hammerson Plc, swap sur rendement total	10 965	(132)
634	31 juill. 2024	Hargreaves Lansdown Plc, swap sur rendement total	12 414	779
465	31 juill. 2024	Hiscox Ltd, swap sur rendement total	9 250	29
339	31 juill. 2024	Hostelworld Group Plc, swap sur rendement total	956	58
865	31 juill. 2024	Hunting Plc, swap sur rendement total	6 187	(73)
1 696	31 juill. 2024	Idox Plc, swap sur rendement total	1 778	(189)
164	31 juill. 2024	International Personal Finan, swap sur rendement total	360	39
967	31 juill. 2024	Iomart Group Plc, swap sur rendement total	2 141	(126)
3 090	31 juill. 2024	Jupiter Fund Management, swap sur rendement total	4 110	(359)
138	31 juill. 2024	Keller Group Plc, swap sur rendement total	2 931	(152)
3 983	31 juill. 2024	Kenmare Resources Plc, swap sur rendement total	21 736	(3 111)
6 376	31 juill. 2024	Kier Group Plc, swap sur rendement total	14 602	(1 616)
9	31 juill. 2024	Liontrust Asset Management, swap sur rendement total	107	(28)
1 184	31 juill. 2024	Macfarlane Group Plc, swap sur rendement total	2 437	(39)
1 187	31 juill. 2024	Marston'S Plc, swap sur rendement total	640	(98)
1 034	31 juill. 2024	Mcbride Plc, swap sur rendement total	2 477	294
2 686	31 juill. 2024	Me Group International Plc, swap sur rendement total	7 954	(568)
2 084	31 juill. 2024	Mitchells & Butlers Plc, swap sur rendement total	10 292	(851)
7 263	31 juill. 2024	Mitie Group Plc, swap sur rendement total	14 975	(292)
70	31 juill. 2024	Mj Gleeson Plc, swap sur rendement total	624	(66)
1 958	31 juill. 2024	Moneysupermarket.Com, swap sur rendement total	7 525	(123)
882	31 juill. 2024	Morgan Advanced Materials Pl, swap sur rendement total	4 714	(17)
179	31 juill. 2024	Morgan Sindall Group Plc, swap sur rendement total	7 849	15
1 331	31 juill. 2024	Ncc Group Plc, swap sur rendement total	3 513	229
3 186	31 juill. 2024	Netcall Plc, swap sur rendement total	5 070	339
644	31 juill. 2024	Next Plc, swap sur rendement total	100 656	(3 763)
457	31 juill. 2024	Ninety One Plc, swap sur rendement total	1 323	(27)
121	31 juill. 2024	Norcros Plc, swap sur rendement total	483	32
2 379	31 juill. 2024	Onesavings Bank Plc, swap sur rendement total	17 637	(1 524)
340	31 juill. 2024	Oxford Metrics Plc, swap sur rendement total	588	(62)
9 634	31 juill. 2024	Paragon Banking Group Plc, swap sur rendement total	122 482	(5 286)
1 971	31 juill. 2024	Persimmon Plc, swap sur rendement total	47 457	(1 959)
571	31 juill. 2024	Pinewood Technologies Group, swap sur rendement total	3 516	(15)
1 795	31 juill. 2024	Playtech Plc, swap sur rendement total	14 438	(442)
23	31 juill. 2024	Polar Capital Holdings Plc, swap sur rendement total	224	5
1 923	31 juill. 2024	Prs Reit Plc/The, swap sur rendement total	2 498	(69)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
797	31 juill. 2024	Rank Group Plc, swap sur rendement total	937	(180)
58	31 juill. 2024	Reach Plc, swap sur rendement total	99	17
94	31 juill. 2024	Renew Holdings Plc, swap sur rendement total	1 737	(6)
27 337	31 juill. 2024	Rolls-Royce Holdings Plc, swap sur rendement total	216 001	568
426	31 juill. 2024	Sanderson Design Group Plc, swap sur rendement total	623	(161)
3 638	31 juill. 2024	Senior Plc, swap sur rendement total	10 068	(24)
1 660	31 juill. 2024	Severfield Plc, swap sur rendement total	2 176	205
254	31 juill. 2024	Sig Plc, swap sur rendement total	109	(5)
410	31 juill. 2024	Sirius Real Estate Ltd, swap sur rendement total	684	(10)
1 180	31 juill. 2024	Somero Enterprises Inc, actions ord., swap sur rendement total	6 838	(690)
11 569	31 juill. 2024	Speedy Hire Plc, swap sur rendement total	6 804	1 152
181	31 juill. 2024	Sthree Plc, swap sur rendement total	1 290	(81)
55 447	31 juill. 2024	Taylor Wimpey Plc, swap sur rendement total	136 334	(5 537)
1 500	31 juill. 2024	Tbc Bank Group Plc, swap sur rendement total	69 953	3 603
10 407	31 juill. 2024	Tp Icap Plc, swap sur rendement total	35 967	(3 600)
3 548	31 juill. 2024	Trainline Plc, swap sur rendement total	19 295	(396)
3 258	31 juill. 2024	Trustpilot Group Plc, swap sur rendement total	12 116	404
359	31 juill. 2024	Tt Electronics Plc, swap sur rendement total	907	(30)
10 640	31 juill. 2024	Tullow Oil Plc, swap sur rendement total	5 897	(1 274)
3 355	31 juill. 2024	Vertu Motors Plc, swap sur rendement total	4 260	(382)
337	31 juill. 2024	Volex Plc, swap sur rendement total	1 877	(178)
434	31 juill. 2024	Volution Group Plc, swap sur rendement total	3 386	(8)
809	31 juill. 2024	Warpaint London Plc, swap sur rendement total	8 732	1 540
105	31 juill. 2024	Watches Of Switzerland Group, swap sur rendement total	752	5
1 018	31 juill. 2024	Xps Pensions Group Plc, swap sur rendement total	5 265	555
				(49 581)
Euro – taux à court terme (€STR)				
322	31 juill. 2024	2G Energy Ag, swap sur rendement total	10 436	(1 477)
104	31 juill. 2024	Acciona Sa, swap sur rendement total	16 823	(1 206)
458	31 juill. 2024	Accor Sa, swap sur rendement total	25 725	(682)
429	31 juill. 2024	Acs Actividades Cons Y Serv, swap sur rendement total	25 342	(620)
604	31 juill. 2024	Aedas Homes Sau, swap sur rendement total	18 734	(174)
239	31 juill. 2024	Aena Sme Sa, swap sur rendement total	65 894	2 767
110	31 juill. 2024	Akwel, swap sur rendement total	1 771	(332)
130	31 juill. 2024	Alma Media Corp, swap sur rendement total	1 964	(63)
5 745	31 juill. 2024	Alstom, swap sur rendement total	132 276	(15 446)
30	31 juill. 2024	Argan, swap sur rendement total	3 203	(209)
86	31 juill. 2024	Arkema, swap sur rendement total	10 235	(1 041)
26 782	31 juill. 2024	Aroundtown Sa, swap sur rendement total	77 198	(7 611)
204	31 juill. 2024	Ascencio, swap sur rendement total	13 493	(1 161)
53	31 juill. 2024	Aspo Oyj, swap sur rendement total	455	(12)
150	31 juill. 2024	Assystem, swap sur rendement total	11 659	(1 077)
44	31 juill. 2024	Atoss Software Ag, swap sur rendement total	7 227	(127)
3 332	31 juill. 2024	Audax Renovables Sa, swap sur rendement total	9 108	(375)
166	31 juill. 2024	Axway Software Sa, swap sur rendement total	6 378	367
72 706	31 juill. 2024	Banco Comercial Portugues, R, swap sur rendement total	35 890	(1 232)
474	31 juill. 2024	Bankinter Sa, swap sur rendement total	5 301	(361)
1 067	31 juill. 2024	Barco N.V., swap sur rendement total	16 211	(1 893)
136	31 juill. 2024	Bawag Group Ag, swap sur rendement total	11 787	(335)
1 131	31 juill. 2024	Beneteau, swap sur rendement total	16 205	(5 909)
238	31 juill. 2024	Bertrandt Ag, swap sur rendement total	10 227	(2 660)
117	31 juill. 2024	Bijou Brigitte Modi Access, swap sur rendement total	6 863	(469)
323	31 juill. 2024	Bilfinger Se, swap sur rendement total	23 258	(577)
99	31 juill. 2024	Bnp Paribas, swap sur rendement total	8 643	(482)
1 933	31 juill. 2024	Ca Immobilien Anlagen Ag, swap sur rendement total	87 765	3 016
13 587	31 juill. 2024	Cairn Homes Plc, swap sur rendement total	31 682	(1 804)
42	31 juill. 2024	Capgemini Se, swap sur rendement total	11 438	(116)
5 027	31 juill. 2024	Carrefour Sa, swap sur rendement total	97 314	(13 127)
501	31 juill. 2024	Ceconomy Ag, swap sur rendement total	2 182	(113)
407	31 juill. 2024	Compagnie Des Alpes, swap sur rendement total	8 094	(1 507)
67	31 juill. 2024	Covivio, swap sur rendement total	4 361	(348)
3 150	31 juill. 2024	Deceuninck Nv, swap sur rendement total	11 110	(747)
2 377	31 juill. 2024	Deutsche Pfandbriefbank Ag, swap sur rendement total	17 621	(2 289)
622	31 juill. 2024	Deutz Ag, swap sur rendement total	5 500	703
952	31 juill. 2024	Duerr Ag, swap sur rendement total	27 643	(4 110)
509	31 juill. 2024	Econocom Group, swap sur rendement total	1 702	(101)
328	31 juill. 2024	Edreams Odigeo Sl, swap sur rendement total	3 127	(293)
869	31 juill. 2024	Elecnor Sa, swap sur rendement total	25 284	(1 115)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
233	31 juill. 2024	Elior Group, swap sur rendement total	903	(280)
83	31 juill. 2024	Elmos Semiconductor Ag, swap sur rendement total	9 263	(1 074)
386	31 juill. 2024	Elringklinger Ag, swap sur rendement total	2 816	(561)
6 060	31 juill. 2024	Enagas Sa, swap sur rendement total	123 443	(2 472)
966	31 juill. 2024	Engie, swap sur rendement total	18 891	(3 187)
136	31 juill. 2024	Eramet, swap sur rendement total	18 778	(1 927)
929	31 juill. 2024	Eurocommercial Propertie-Cv, swap sur rendement total	32 098	724
341	31 juill. 2024	Eurofins Scientific, swap sur rendement total	23 279	(3 820)
2 422	31 juill. 2024	Evonik Industries Ag, swap sur rendement total	67 664	(3 688)
421	31 juill. 2024	Evs Broadcast Equipment S.A., swap sur rendement total	17 936	(742)
1 748	31 juill. 2024	Flatex Ag, swap sur rendement total	33 966	(2 195)
265	31 juill. 2024	Fomento De Construc Y Contra, swap sur rendement total	5 402	(436)
333	31 juill. 2024	Forvia, swap sur rendement total	5 399	(414)
238	31 juill. 2024	Fraport Ag Frankfurt Airport, swap sur rendement total	16 823	(1 728)
1 803	31 juill. 2024	F-Secure Corp, swap sur rendement total	5 130	(820)
6	31 juill. 2024	Gesco Ag, swap sur rendement total	147	(15)
27	31 juill. 2024	Groupe Guillin, swap sur rendement total	1 059	(124)
967	31 juill. 2024	Grupo Catalana Occidente Sa, swap sur rendement total	53 605	(495)
3 067	31 juill. 2024	Heidelberger Druckmaschinen, swap sur rendement total	5 712	433
22	31 juill. 2024	Iberdrola Sa, swap sur rendement total	391	(2)
130	31 juill. 2024	Immofinanz Ag, swap sur rendement total	4 938	379
11	31 juill. 2024	Ion Beam Applications, swap sur rendement total	193	(39)
1 202	31 juill. 2024	K+S Ag, actions ord., swap sur rendement total	22 167	(1 681)
1 747	31 juill. 2024	Kingspan Group Plc, swap sur rendement total	203 681	(19 279)
1 922	31 juill. 2024	Kion Group Ag, swap sur rendement total	110 182	(2 630)
552	31 juill. 2024	Klepierre, swap sur rendement total	20 222	(1 444)
100	31 juill. 2024	Kloeckner & Co Se, swap sur rendement total	810	(84)
100	31 juill. 2024	Koenig & Bauer Ag, swap sur rendement total	1 986	(46)
380	31 juill. 2024	Konecranes Oyj, swap sur rendement total	29 508	3
9 331	31 juill. 2024	Koninklijke Bam Groep Nv, swap sur rendement total	53 669	828
5 165	31 juill. 2024	Koninklijke Kpn Nv, swap sur rendement total	27 117	609
2 810	31 juill. 2024	Koninklijke Philips Nv, swap sur rendement total	97 213	(5 583)
35	31 juill. 2024	Ksb Se & Co Kgaa-Vorzug, swap sur rendement total	33 158	117
98	31 juill. 2024	Lanxess Ag, swap sur rendement total	3 303	(195)
2 623	31 juill. 2024	Lar Espana Real Estate Socim, swap sur rendement total	26 273	(879)
90	31 juill. 2024	Legrand Sa, swap sur rendement total	12 227	(889)
2 571	31 juill. 2024	Linea Directa Aseguradora Sa, swap sur rendement total	4 359	(19)
245	31 juill. 2024	Lisi, swap sur rendement total	8 336	(1 237)
1 897	31 juill. 2024	Maurel Et Prom, swap sur rendement total	16 789	(1 793)
100	31 juill. 2024	Mensch Und Maschine Software, swap sur rendement total	8 095	(271)
575	31 juill. 2024	Merlin Properties Socimi Sa, swap sur rendement total	8 770	(547)
87	31 juill. 2024	Mersen, swap sur rendement total	4 064	(822)
646	31 juill. 2024	Mlp Se, swap sur rendement total	5 713	(366)
488	31 juill. 2024	Montea, swap sur rendement total	56 609	(3 522)
14 058	31 juill. 2024	Mota Engil Sgps Sa, swap sur rendement total	70 962	(11 358)
1 484	31 juill. 2024	Naturgy Energy Group Sa, swap sur rendement total	43 875	(9 798)
135	31 juill. 2024	Ned Apparaten Fabriek- Nedap, swap sur rendement total	12 037	(350)
855	31 juill. 2024	Nexans Sa, swap sur rendement total	129 024	(10 560)
471	31 juill. 2024	Nexity, swap sur rendement total	5 757	(1 486)
380	31 juill. 2024	Nextensa, swap sur rendement total	24 242	(2 727)
174	31 juill. 2024	Noho Partners Oyj, swap sur rendement total	2 189	(74)
342	31 juill. 2024	Nordex Se, swap sur rendement total	5 738	(1 516)
288	31 juill. 2024	Norma Group Se, swap sur rendement total	7 298	(378)
3 322	31 juill. 2024	Obrascon Huarte Lain S.A., swap sur rendement total	1 723	(337)
2 280	31 juill. 2024	Ontex Group Nv, swap sur rendement total	27 117	(3 315)
2 849	31 juill. 2024	Origin Enterprises Plc, swap sur rendement total	13 537	627
788	31 juill. 2024	Orpea, swap sur rendement total	13 274	(236)
396	31 juill. 2024	Palfinger Ag, swap sur rendement total	12 893	(1 088)
1 038	31 juill. 2024	Permanent Tsb Group Holdings, swap sur rendement total	1 994	(341)
110	31 juill. 2024	Porr Ag, swap sur rendement total	2 258	(9)
1 766	31 juill. 2024	Prosiebensat.1 Media Se, swap sur rendement total	17 132	(2 532)
2 027	31 juill. 2024	Raiffeisen Bank Internationa, swap sur rendement total	48 216	(2 078)
370	31 juill. 2024	Renault Sa, swap sur rendement total	25 959	339
66	31 juill. 2024	Retail Estates, swap sur rendement total	6 001	(308)
185	31 juill. 2024	Rubis, swap sur rendement total	7 125	(1 464)
2 826	31 juill. 2024	Saf-Holland Sa, swap sur rendement total	76 672	3 070
376	31 juill. 2024	Salzgitter Ag, swap sur rendement total	9 953	(2 313)
46	31 juill. 2024	Sanoma Oyj, swap sur rendement total	438	(65)
266	31 juill. 2024	Scanfil Oyj, swap sur rendement total	2 844	(190)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
2 923	31 juill. 2024	Schaeffler Ag, actions priv., swap sur rendement total	23 041	(2 395)
610	31 juill. 2024	Semapa-Sociedade De Investim, swap sur rendement total	12 864	(1 033)
288	31 juill. 2024	Sgl Carbon Se, swap sur rendement total	2 678	(308)
4 823	31 juill. 2024	Siemens Energy Ag	171 946	(2 060)
166	31 juill. 2024	Siltronic Ag, swap sur rendement total	17 625	(579)
322	31 juill. 2024	Société Générale Sa, swap sur rendement total	10 351	(1 369)
3 284	31 juill. 2024	Solvay Sa, swap sur rendement total	158 305	(2 202)
3	31 juill. 2024	Sopra Steria Group, swap sur rendement total	797	(158)
774	31 juill. 2024	Stmicroelectronics Nv, swap sur rendement total	41 845	(2 512)
2	31 juill. 2024	Sto Se & Co. Kgaa, actions priv., swap sur rendement total	466	(38)
565	31 juill. 2024	Suess Microtec Se, swap sur rendement total	50 958	5 296
106	31 juill. 2024	Tag Immobilien Ag, swap sur rendement total	2 125	(46)
184	31 juill. 2024	Teleperformance, swap sur rendement total	26 536	(519)
34	31 juill. 2024	Thermador Groupe, swap sur rendement total	3 894	(620)
16 188	31 juill. 2024	Thyssenkrupp Ag, swap sur rendement total	95 863	(10 564)
1 338	31 juill. 2024	Tokmanni Group Corp, swap sur rendement total	25 705	(1 122)
1 166	31 juill. 2024	Tomtom, swap sur rendement total	9 020	(727)
2 312	31 juill. 2024	Ubisoft Entertainment, swap sur rendement total	69 304	(6 902)
30 901	31 juill. 2024	Unicaja Banco Sa, swap sur rendement total	57 734	(3 467)
100	31 juill. 2024	Vaisala Oyj, actions, A, swap sur rendement total	5 895	50
5 423	31 juill. 2024	Valeo Sa, swap sur rendement total	79 037	(9 896)
5 591	31 juill. 2024	Vallourec Sa, swap sur rendement total	120 080	(13 944)
809	31 juill. 2024	Van Lanschot Kempen Nv, swap sur rendement total	44 491	(238)
157	31 juill. 2024	Verallia, swap sur rendement total	7 801	(874)
60	31 juill. 2024	Vgp, swap sur rendement total	9 151	(201)
200	31 juill. 2024	Vicat, swap sur rendement total	9 840	(881)
116	31 juill. 2024	Vienna Insurance Group Ag, swap sur rendement total	5 189	158
10 038	31 juill. 2024	Viridien, swap sur rendement total	7 023	(2 065)
2 170	31 juill. 2024	Vopak, swap sur rendement total	123 349	2 758
438	31 juill. 2024	Vusiongroup, swap sur rendement total	83 697	(9 403)
33	31 juill. 2024	Wacker Chemie Ag, swap sur rendement total	4 927	(16)
4 245	31 juill. 2024	Wartsila Oyj Abp, swap sur rendement total	112 057	(7 244)
155	31 juill. 2024	Wavestone, swap sur rendement total	11 638	(1 718)
876	31 juill. 2024	Wienerberger Ag, swap sur rendement total	39 774	(4 720)
205	31 juill. 2024	Worldline Sa, swap sur rendement total	3 042	(15)
1 781	31 juill. 2024	X-Fab Silicon Foundries Se, swap sur rendement total	15 619	(1 647)
70	31 juill. 2024	Zumtobel Group Ag, swap sur rendement total	636	17
				(256 252)
Dollar de Hong Kong – taux interbancaifre offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
8 500	31 juill. 2024	Aac Technologies Holdings In, swap sur rendement total	45 735	9 797
8 400	31 juill. 2024	Aia Group Ltd, swap sur rendement total	78 027	(8 704)
1 000	31 juill. 2024	Alphamab Oncology, swap sur rendement total	421	(38)
5 500	31 juill. 2024	Ane Cayman Inc, swap sur rendement total	6 507	489
6 000	31 juill. 2024	Ascletis Pharma Inc, swap sur rendement total	841	(34)
3 000	31 juill. 2024	Asm Pacific Technology, swap sur rendement total	57 258	8 069
11 500	31 juill. 2024	Baic Motor Corp Ltd, H, swap sur rendement total	4 313	(174)
21 000	31 juill. 2024	Bairong Inc, swap sur rendement total	32 757	(749)
5 000	31 juill. 2024	Beijing Urban Construction, H, swap sur rendement total	1 574	(105)
100	31 juill. 2024	Boc Aviation Ltd, swap sur rendement total	981	(38)
22 000	31 juill. 2024	Brilliance China Automotive, swap sur rendement total	31 656	7 135
300	31 juill. 2024	Chervon Holdings Ltd, swap sur rendement total	957	(245)
17 000	31 juill. 2024	China Dongxiang Group Co, swap sur rendement total	939	(167)
170 000	31 juill. 2024	China Electronics Huada Tech, swap sur rendement total	37 541	(2 518)
115 000	31 juill. 2024	China Hongqiao Group Ltd, swap sur rendement total	238 235	(22 556)
29 000	31 juill. 2024	China Lesso Group Holdings L, swap sur rendement total	16 874	(1 446)
5 000	31 juill. 2024	China Life Insurance Co, H, swap sur rendement total	9 675	(99)
42 000	31 juill. 2024	China Molybdenum Co Ltd, H, swap sur rendement total	53 778	538
30 000	31 juill. 2024	China Nonferrous Mining Corp, swap sur rendement total	35 806	(3 692)
15 000	31 juill. 2024	China Overseas Grand Oceans, swap sur rendement total	5 442	(181)
6 500	31 juill. 2024	China Overseas Land & Invest, swap sur rendement total	15 938	(990)
2 000	31 juill. 2024	China Resources Land Ltd, swap sur rendement total	9 776	(319)
84 000	31 juill. 2024	China Youzan Ltd, swap sur rendement total	1 134	(107)
16 000	31 juill. 2024	Cifi Holdings Group Co Ltd, swap sur rendement total	883	(242)
32 000	31 juill. 2024	Cosco Shipping Ports Ltd, swap sur rendement total	30 229	(664)
5 000	31 juill. 2024	Country Garden Services Hold, swap sur rendement total	4 502	(333)
6 000	31 juill. 2024	Cowell E Holdings Inc, swap sur rendement total	25 816	1 208
32 000	31 juill. 2024	Datang Intl Power Gen Co, H, swap sur rendement total	9 366	306
3 200	31 juill. 2024	Dongfang Electric Corp Ltd, H, swap sur rendement total	6 977	(116)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
62 000	31 juill. 2024	E-Commodities Holdings Ltd, swap sur rendement total	17 256	(1 634)
22 000	31 juill. 2024	Far East Horizon Ltd, swap sur rendement total	19 587	(3 286)
10 000	31 juill. 2024	Frontage Holdings Corp, swap sur rendement total	1 402	(620)
5 000	31 juill. 2024	Fufeng Group Ltd, swap sur rendement total	4 653	(708)
24 000	31 juill. 2024	Future Land Development Hold, swap sur rendement total	5 721	(408)
4 000	31 juill. 2024	Geely Automobile Holdings Lt, swap sur rendement total	6 316	(336)
58 000	31 juill. 2024	Gemdale Properties And Inves, swap sur rendement total	2 501	(454)
46 500	31 juill. 2024	Great Wall Motor Company, H, swap sur rendement total	98 123	(12 257)
17 000	31 juill. 2024	Greentown China Holdings, swap sur rendement total	19 672	(2 893)
1 000	31 juill. 2024	Greentown Management Hld, swap sur rendement total	950	(260)
22 000	31 juill. 2024	Haitong Unitrust Internati, H, swap sur rendement total	2 900	(1)
1 000	31 juill. 2024	Hang Lung Properties Ltd, swap sur rendement total	1 167	(45)
26 000	31 juill. 2024	Harbin Electric Co Ltd, H, swap sur rendement total	11 328	(1 194)
2 000	31 juill. 2024	Hisense Home Appliances Gr, H, swap sur rendement total	9 390	(3 083)
800	31 juill. 2024	Hong Kong Exchanges & Clear, swap sur rendement total	35 081	(1 877)
4 074	31 juill. 2024	Horizon Construction Develop, swap sur rendement total	1 071	1 071
1 000	31 juill. 2024	Hua Hong Semiconductor Ltd, swap sur rendement total	3 865	(226)
32 000	31 juill. 2024	Huadian Power Intl Corp, H, swap sur rendement total	27 432	1 889
70 000	31 juill. 2024	Inke Ltd, swap sur rendement total	9 339	(1 519)
66 000	31 juill. 2024	Inspur International Ltd, swap sur rendement total	36 784	(7 459)
184 000	31 juill. 2024	International Alliance Finan, swap sur rendement total	13 706	(3 438)
10 000	31 juill. 2024	Jiangxi Copper Co Ltd, H, swap sur rendement total	28 439	(1 283)
500	31 juill. 2024	Jnby Design Ltd, swap sur rendement total	1 334	51
500	31 juill. 2024	Johnson Electric Holdings, swap sur rendement total	1 031	(17)
68 000	31 juill. 2024	Kinetic Development Group Lt, swap sur rendement total	13 467	1 659
9 000	31 juill. 2024	Kingboard Holdings Ltd, swap sur rendement total	29 560	(793)
40 000	31 juill. 2024	Lenovo Group Ltd, swap sur rendement total	77 256	(1 721)
14 000	31 juill. 2024	Linklogis Inc, cat. B, swap sur rendement total	5 324	249
34 000	31 juill. 2024	Longfor Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	63 880	(9 338)
4 400	31 juill. 2024	Man Wah Holdings Ltd, swap sur rendement total	4 133	(892)
4 800	31 juill. 2024	Mgm China Holdings Ltd, swap sur rendement total	10 230	(1 499)
600	31 juill. 2024	Midea Real Estate Holding Lt, swap sur rendement total	737	213
208 000	31 juill. 2024	Mmg Ltd, swap sur rendement total	108 635	(21 690)
83 200	31 juill. 2024	Mmg Ltd, droits, swap sur rendement total	5 031	5 031
42 000	31 juill. 2024	Newborn Town Inc, swap sur rendement total	32 977	4 468
19 000	31 juill. 2024	Nexteer Automotive Group Ltd, swap sur rendement total	11 800	(1 613)
4 000	31 juill. 2024	Nine Dragons Paper Holdings, swap sur rendement total	2 278	(545)
5 000	31 juill. 2024	Pacific Basin Shipping Ltd, swap sur rendement total	2 156	(259)
1 000	31 juill. 2024	Poly Property Group Co Ltd, swap sur rendement total	259	(2)
54 000	31 juill. 2024	Powerlong Real Estate Holdin, swap sur rendement total	5 489	(1 307)
4 000	31 juill. 2024	Radiance Holdings Group Co L, swap sur rendement total	1 872	(118)
8 000	31 juill. 2024	S-Enjoy Service Group Co Ltd, swap sur rendement total	4 375	(264)
74 000	31 juill. 2024	Sino Biopharmaceutical, swap sur rendement total	35 018	(1 923)
59 000	31 juill. 2024	Sino-Ocean Group Holding Ltd, swap sur rendement total	3 464	(840)
12 500	31 juill. 2024	Sinotruk Hong Kong Ltd, swap sur rendement total	44 473	4 614
2 000	31 juill. 2024	Sitc International Holdings, swap sur rendement total	7 431	274
22 000	31 juill. 2024	Skyworth Group Ltd, swap sur rendement total	11 876	1 086
1 000	31 juill. 2024	Sunac Services Holdings Ltd, swap sur rendement total	317	(13)
8 200	31 juill. 2024	Sunny Optical Tech, swap sur rendement total	69 343	5 331
1 000	31 juill. 2024	Swire Pacific Ltd, cat. A, swap sur rendement total	12 093	149
1 000	31 juill. 2024	Swire Properties Ltd, swap sur rendement total	2 180	(240)
13 500	31 juill. 2024	Techtronic Industries Co Ltd, swap sur rendement total	213 370	(13 746)
30 000	31 juill. 2024	Theme Internationl Hldgs Ltd, swap sur rendement total	2 576	(409)
220 000	31 juill. 2024	Tongda Group Holdings Ltd, swap sur rendement total	3 355	192
100	31 juill. 2024	Vtech Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 024	38
12 000	31 juill. 2024	Wasion Holdings Ltd, swap sur rendement total	14 386	(978)
41 000	31 juill. 2024	Weichai Power Co Ltd, H, swap sur rendement total	107 356	6 592
84 000	31 juill. 2024	Xinyi Glass Holdings Ltd, swap sur rendement total	131 468	(11 322)
2 000	31 juill. 2024	Xinyi Solar Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 430	(334)
6 500	31 juill. 2024	Yue Yuen Industrial Hldg, swap sur rendement total	17 202	771
5 000	31 juill. 2024	Yuexiu Property Co Ltd, swap sur rendement total	4 469	(568)
4 000	31 juill. 2024	Zengame Technology Holding, swap sur rendement total	2 187	(267)
12 600	31 juill. 2024	Zhengzhou Coal Mining Mach, H, swap sur rendement total	25 624	(1 445)
				(97 421)
Rand sud Africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
4 055	31 juill. 2024	Aeci Ltd, swap sur rendement total	32 827	3 523
1 245	31 juill. 2024	Alexander Forbes Group Holdi, swap sur rendement total	689	88
1 755	31 juill. 2024	Allied Electronics Cor, actions, A, swap sur rendement total	1 724	21

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
1 918	31 juill. 2024	Barloworld Ltd, swap sur rendement total	12 045	(978)
629	31 juill. 2024	Datatec Ltd, swap sur rendement total	1 768	(5)
961	31 juill. 2024	Exxaro Resources Ltd, swap sur rendement total	12 819	(322)
155	31 juill. 2024	Hosken Cons Investments Ltd, swap sur rendement total	2 038	28
245	31 juill. 2024	Hudaco Industries Ltd, swap sur rendement total	3 112	58
6 261	31 juill. 2024	Jse Ltd, swap sur rendement total	51 023	7 479
6 631	31 juill. 2024	Kap Industrial Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 416	(60)
1 581	31 juill. 2024	Lewis Group Ltd, swap sur rendement total	6 694	1 089
22 729	31 juill. 2024	Merafe Resources Ltd, swap sur rendement total	2 521	99
1 980	31 juill. 2024	Metair Investments Ltd, swap sur rendement total	1 632	(18)
167	31 juill. 2024	Mr Price Group Ltd, swap sur rendement total	2 577	197
8 931	31 juill. 2024	Ppc Ltd, swap sur rendement total	2 155	(99)
5 127	31 juill. 2024	Raubex Group Ltd, swap sur rendement total	15 368	1 481
3 011	31 juill. 2024	Resilient Reit Ltd, swap sur rendement total	10 573	(262)
2 477	31 juill. 2024	Southern Sun Ltd, swap sur rendement total	984	(1)
4 261	31 juill. 2024	Stor-Age Property Reit Ltd, swap sur rendement total	4 422	(97)
841	31 juill. 2024	The Foschini Group Ltd, swap sur rendement total	8 036	1 610
				13 831
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
58	31 juill. 2024	Addlife Ab, B, swap sur rendement total	941	82
246	31 juill. 2024	Addtech Ab, actions, B, swap sur rendement total	8 372	468
33	31 juill. 2024	Afry Ab, swap sur rendement total	810	(1)
200	31 juill. 2024	Alimak Group Ab, swap sur rendement total	2 972	28
4 135	31 juill. 2024	Alleima Ab, swap sur rendement total	36 758	(1 556)
264	31 juill. 2024	Alligo Ab, B, swap sur rendement total	4 898	(28)
2 054	31 juill. 2024	Ambea Ab, swap sur rendement total	20 807	1 404
1 645	31 juill. 2024	Aq Group Ab, swap sur rendement total	30 926	490
108	31 juill. 2024	Arise Ab, swap sur rendement total	696	8
3 734	31 juill. 2024	Attendo Ab, swap sur rendement total	21 132	559
556	31 juill. 2024	Bergman & Beving Aktiebolag, swap sur rendement total	21 265	1 797
2 467	31 juill. 2024	Bonesupport Holding Ab, swap sur rendement total	83 834	2 515
69	31 juill. 2024	Boozt Ab, swap sur rendement total	1 129	(95)
218	31 juill. 2024	Camurus Ab, swap sur rendement total	16 901	479
807	31 juill. 2024	Clas Ohlson Ab, actions, B, swap sur rendement total	18 352	1 773
1 563	31 juill. 2024	Dustin Group Ab, swap sur rendement total	2 379	(558)
216	31 juill. 2024	Eastnine Ab, swap sur rendement total	1 232	57
388	31 juill. 2024	Fagerhult Ab, swap sur rendement total	3 449	(77)
3 720	31 juill. 2024	Hennes & Mauritz Ab, actions, B, swap sur rendement total	80 582	(8 882)
50	31 juill. 2024	Inwido Ab, swap sur rendement total	934	(15)
426	31 juill. 2024	Lindab International Ab, swap sur rendement total	12 484	(752)
258	31 juill. 2024	Modern Times Group, actions, B, swap sur rendement total	2 847	(254)
1 728	31 juill. 2024	Mycronic Ab, swap sur rendement total	91 229	(1 734)
899	31 juill. 2024	Nordic Paper Holding Ab, swap sur rendement total	5 657	(518)
344	31 juill. 2024	Proact It Group Ab, swap sur rendement total	6 889	483
1 597	31 juill. 2024	Rvrc Holding Ab, swap sur rendement total	9 430	(1 563)
13	31 juill. 2024	Sdiptech Ab, B, swap sur rendement total	543	(28)
897	31 juill. 2024	Smart Eye Ab, swap sur rendement total	11 984	(332)
453	31 juill. 2024	Tobii Dynavox Ab, swap sur rendement total	3 143	(365)
				(6 615)
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
12	31 juill. 2024	Allreal Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	2 810	11
65	31 juill. 2024	Apg Sga Sa, swap sur rendement total	19 449	(1 257)
478	31 juill. 2024	Ascom Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	5 568	(329)
146	31 juill. 2024	Banque Cantonale Vaudois, actions ord., swap sur rendement total	21 198	44
129	31 juill. 2024	Basilea Pharmaceutica, actions ord., swap sur rendement total	7 671	(922)
37	31 juill. 2024	Berner Kantonalbank Ag, actions ord., swap sur rendement total	13 128	(295)
51	31 juill. 2024	Burckhardt Compression Holdi, swap sur rendement total	45 820	(1 055)
18	31 juill. 2024	Burkhalter Holding Ag, swap sur rendement total	2 524	(14)
190	31 juill. 2024	Cembra Money Bank Ag, swap sur rendement total	22 191	969
21	31 juill. 2024	Docmorris Ag, droits, swap sur rendement total	–	–
32	31 juill. 2024	Dormakaba Holding Ag, swap sur rendement total	22 464	(1 130)
1	31 juill. 2024	Ems-Chemie Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 122	(9)
1	31 juill. 2024	Forbo Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	1 593	(84)
193	31 juill. 2024	Implenia Ag, actions ord., swap sur rendement total	9 449	(701)
5	31 juill. 2024	Intershop Holding Ag, swap sur rendement total	900	(15)
116	31 juill. 2024	Investis Holding Sa, swap sur rendement total	17 841	696
23	31 juill. 2024	Jungfraubahn Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	6 788	(49)
208	31 juill. 2024	Kardex Ag, actions ord., swap sur rendement total	72 215	(6 729)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
345	31 juill. 2024	Landis+Gyr Group Ag, swap sur rendement total	39 323	(934)
102	31 juill. 2024	Lastminute.Com Nv, swap sur rendement total	3 106	(73)
165	31 juill. 2024	Logitech International, actions ord., swap sur rendement total	21 839	(601)
118	31 juill. 2024	Meier Tobler Group Ag, swap sur rendement total	5 552	(375)
156	31 juill. 2024	Montana Aerospace Ag, swap sur rendement total	4 447	(209)
59	31 juill. 2024	Siegfried Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	83 823	2 974
2	31 juill. 2024	St Galler Kantonalbank A, actions ord., swap sur rendement total	1 317	(6)
370	31 juill. 2024	Sulzer Ag, actions ord., swap sur rendement total	69 977	720
48	31 juill. 2024	Thurgauer Kantonalbank, certificat, swap sur rendement total	8 881	(485)
13	31 juill. 2024	Tx Group Ag, swap sur rendement total	3 219	72
43	31 juill. 2024	Vz Holding Ag, swap sur rendement total	7 543	199
				(9 587)
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
541	31 juill. 2024	Perdoceo Education Corp, swap sur rendement total	15 857	(864)
870	31 juill. 2024	3M Co, swap sur rendement total	121 654	3 349
716	31 juill. 2024	A10 Networks Inc, swap sur rendement total	13 569	(1 244)
40	31 juill. 2024	Aaon Inc, swap sur rendement total	4 775	660
31 000	31 juill. 2024	Ability Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	70 875	(5 911)
1 842	31 juill. 2024	Able C&C, swap sur rendement total	17 484	(1 820)
315	31 juill. 2024	Abm Industries Inc, swap sur rendement total	21 797	1 219
6 183	31 juill. 2024	Acadia Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	137 483	9 403
1 649	31 juill. 2024	Acco Brands Corp, swap sur rendement total	10 605	(922)
360	31 juill. 2024	Accolade Inc, swap sur rendement total	1 764	(1 737)
391	31 juill. 2024	Aclaris Therapeutics Inc, swap sur rendement total	589	35
2 000	31 juill. 2024	Acter Group Corp Ltd, swap sur rendement total	22 272	2 532
176	31 juill. 2024	Actions Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	733	(6)
48	31 juill. 2024	Acuity Brands Inc, swap sur rendement total	15 858	(52)
35 800	31 juill. 2024	Adaro Minerals Indonesia Tbk, swap sur rendement total	3 944	(364)
1 581	31 juill. 2024	Adicet Bio Inc, swap sur rendement total	2 618	(532)
6 229	31 juill. 2024	Adma Biologics Inc, swap sur rendement total	95 292	12 431
506	31 juill. 2024	Adtalem Global Education Inc, swap sur rendement total	47 228	2 476
8 000	31 juill. 2024	Advancetek Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	20 922	623
220	31 juill. 2024	Aercap Holdings Nv, swap sur rendement total	28 057	(7)
2 194	31 juill. 2024	Aes Corp, swap sur rendement total	52 748	(8 707)
231	31 juill. 2024	Affirm Holdings Inc, swap sur rendement total	9 549	245
75	31 juill. 2024	Ag Mortgage Investment Trust, swap sur rendement total	701	(2)
1 053	31 juill. 2024	Agabang&Company, swap sur rendement total	4 862	(1 087)
526	31 juill. 2024	Agenus Inc, swap sur rendement total	12 056	719
2 547	31 juill. 2024	Akebia Therapeutics Inc, swap sur rendement total	3 555	(363)
343	31 juill. 2024	Al Rajhi Co For Co-Operative, swap sur rendement total	23 494	4 511
5	31 juill. 2024	Alamo Group Inc, swap sur rendement total	1 184	(119)
234	31 juill. 2024	Alarm.Com Holdings Inc, swap sur rendement total	20 345	(267)
101	31 juill. 2024	Albany Intl Corp, cat. A, swap sur rendement total	11 707	(456)
333	31 juill. 2024	Alcon Inc, swap sur rendement total	40 590	(213)
11 000	31 juill. 2024	Alcor Micro Corp, swap sur rendement total	73 313	(4 477)
4 733	31 juill. 2024	Alior Bank Sa, swap sur rendement total	164 677	6 722
2 559	31 juill. 2024	Alkermes Plc, swap sur rendement total	84 389	1 775
1 100	31 juill. 2024	Allianz Malaysia Bhd, swap sur rendement total	7 115	(38)
7 000	31 juill. 2024	Alltop Technology Co Ltd, swap sur rendement total	73 228	(28)
454	31 juill. 2024	Alnylam Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	150 959	57 948
100	31 juill. 2024	Alpha & Omega Semiconductor, swap sur rendement total	5 114	1 088
224	31 juill. 2024	Alphatec Holdings Inc, swap sur rendement total	3 203	194
33	31 juill. 2024	Altair Engineering Inc, A, swap sur rendement total	4 429	474
772	31 juill. 2024	Amazon.Com Inc, swap sur rendement total	204 143	12 660
914	31 juill. 2024	Ambarella Inc, swap sur rendement total	67 474	(5 631)
873	31 juill. 2024	American Airlines Group Inc, swap sur rendement total	13 534	(1 812)
4 520	31 juill. 2024	American Eagle Outfitters, swap sur rendement total	123 451	(12 916)
149	31 juill. 2024	American Public Education, swap sur rendement total	3 584	25
1 103	31 juill. 2024	American Software Inc, cat. A, swap sur rendement total	13 780	(1 160)
2 583	31 juill. 2024	American Superconductor Corp, swap sur rendement total	82 671	14 366
6	31 juill. 2024	American Woodmark Corp, swap sur rendement total	645	(62)
52	31 juill. 2024	Ametek Inc, swap sur rendement total	11 862	(239)
1 694	31 juill. 2024	Amicus Therapeutics Inc, swap sur rendement total	22 994	21
303	31 juill. 2024	Amn Healthcare Services Inc, swap sur rendement total	21 240	(2 033)
889	31 juill. 2024	Amneal Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	7 725	(433)
227	31 juill. 2024	Amphastar Pharmaceuticals In, swap sur rendement total	12 425	(769)
7 000	31 juill. 2024	Amtran Technology Co Ltd, swap sur rendement total	6 083	(29)
9 639	31 juill. 2024	Amylyx Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	25 060	2 287

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
233	31 juill. 2024	Anapass Inc, swap sur rendement total	6 207	1 250
2 784	31 juill. 2024	Angiodynamics Inc, swap sur rendement total	23 047	(962)
600	31 juill. 2024	Anhui Tongfeng Electronics, A, swap sur rendement total	590	4
51	31 juill. 2024	Anika Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 768	(29)
50	31 juill. 2024	Antarchile Sa, swap sur rendement total	589	(36)
3 282	31 juill. 2024	Antero Midstream Corp, swap sur rendement total	66 196	147
788	31 juill. 2024	Antero Resources Corp, swap sur rendement total	35 184	(3 188)
2 158	31 juill. 2024	Anywhere Real Estate Inc, swap sur rendement total	9 774	(2 265)
4 000	31 juill. 2024	Apaq Technology Co Ltd, swap sur rendement total	27 807	7 783
6 000	31 juill. 2024	Apcb Inc, swap sur rendement total	5 150	(272)
4	31 juill. 2024	Appfolio Inc, A, swap sur rendement total	1 339	84
71	31 juill. 2024	Appian Corp, swap sur rendement total	2 998	229
336	31 juill. 2024	Aps Holdings Corp, swap sur rendement total	2 578	403
2 155	31 juill. 2024	Ardmore Shipping Corp, swap sur rendement total	66 436	139
339	31 juill. 2024	Argan Inc, swap sur rendement total	33 937	1 051
90	31 juill. 2024	Aris Water Solutions Inc, A, swap sur rendement total	1 930	30
2 464	31 juill. 2024	Arlo Technologies Inc, swap sur rendement total	43 966	(4 112)
80	31 juill. 2024	Arq In, swap sur rendement total	664	(97)
122	31 juill. 2024	Arriyadh Development Company, swap sur rendement total	951	(17)
51	31 juill. 2024	Asgn Inc, swap sur rendement total	6 153	(61)
485	31 juill. 2024	Asia Paper Manufacturing Co, swap sur rendement total	4 054	147
7 000	31 juill. 2024	Asia Tech Image Inc, swap sur rendement total	21 821	422
3 600	31 juill. 2024	Astra Otoparts Tbk Pt, swap sur rendement total	569	17
2 000	31 juill. 2024	Asustek Computer Inc, swap sur rendement total	42 014	(1 382)
9	31 juill. 2024	Atkore International Group I, swap sur rendement total	1 662	(180)
463	31 juill. 2024	Atricure Inc, swap sur rendement total	14 426	101
25	31 juill. 2024	Audioeye Inc, swap sur rendement total	602	(218)
2 000	31 juill. 2024	Audix Corp, swap sur rendement total	6 403	193
37	31 juill. 2024	Aura Biosciences Inc, swap sur rendement total	383	9
4 000	31 juill. 2024	Aurora Corp, swap sur rendement total	12 773	187
502	31 juill. 2024	Avaco Co Ltd, swap sur rendement total	9 126	145
3 573	31 juill. 2024	Avepoint Inc, swap sur rendement total	50 945	6 667
116	31 juill. 2024	Avidity Biosciences Inc, swap sur rendement total	6 484	241
396	31 juill. 2024	Avidxchange Holdings Inc, swap sur rendement total	6 535	767
435	31 juill. 2024	Axcelis Technologies Inc, swap sur rendement total	84 636	17 390
431	31 juill. 2024	Axogen Inc, swap sur rendement total	4 270	227
1 206	31 juill. 2024	Axt Inc, swap sur rendement total	5 578	(718)
201	31 juill. 2024	Backblaze Inc, A, swap sur rendement total	1 694	7
244	31 juill. 2024	Badger Meter Inc, swap sur rendement total	62 218	(2 357)
12 700	31 juill. 2024	Bahvest Resources Bhd, swap sur rendement total	2 137	(53)
423	31 juill. 2024	Banco Latinoamericano Come, E, swap sur rendement total	17 173	(240)
24	31 juill. 2024	Bancolombia S.A., CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	1 102	(56)
319	31 juill. 2024	Bandwidth Inc, cat. A, swap sur rendement total	7 368	(1 447)
91 965	31 juill. 2024	Bank Al Habib Ltd, swap sur rendement total	50 711	5 085
6 378	31 juill. 2024	Bank Alfalah Ltd, swap sur rendement total	2 132	170
265	31 juill. 2024	Bank Handlowy W Warszawie Sa, swap sur rendement total	9 815	(112)
8 439	31 juill. 2024	Bank Millennium Sa, swap sur rendement total	26 909	539
13 700	31 juill. 2024	Bank Tabungan Negara Persero, swap sur rendement total	1 446	27
11 819	31 juill. 2024	Barito Pacific Tbk Pt, swap sur rendement total	977	(43)
17	31 juill. 2024	Beazer Homes Usa Inc, swap sur rendement total	639	(31)
52	31 juill. 2024	Beigene Ltd, CAAE, swap sur rendement total	10 152	(485)
600	31 juill. 2024	Beijing Beilu Pharmaceutic, A, swap sur rendement total	498	(88)
1 400	31 juill. 2024	Beijing Century Real Techn, A, swap sur rendement total	680	(65)
133	31 juill. 2024	Beijing Seeyon Internet So, A, swap sur rendement total	394	(53)
24	31 juill. 2024	Benefit Systems Sa, swap sur rendement total	23 660	(751)
1 024	31 juill. 2024	Beyond Inc, swap sur rendement total	18 328	(2 953)
600	31 juill. 2024	Bgrimm Technology Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 472	(126)
345	31 juill. 2024	Bhp Group Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	26 951	(2 107)
250	31 juill. 2024	Bigcommerce Holdings, série 1, swap sur rendement total	2 757	(72)
5	31 juill. 2024	Biglari Holdings Inc, B, swap sur rendement total	1 323	(40)
155	31 juill. 2024	Binggrae Co Ltd, swap sur rendement total	15 021	1 929
118	31 juill. 2024	Bioatla Inc, swap sur rendement total	221	(24)
1 645	31 juill. 2024	Biocryst Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	13 911	(738)
1 065	31 juill. 2024	Bj'S Wholesale Club Holdings, swap sur rendement total	128 009	(856)
835	31 juill. 2024	Black Diamond Therapeutics I, swap sur rendement total	5 324	(163)
221	31 juill. 2024	Blackbaud Inc, swap sur rendement total	23 034	(600)
89	31 juill. 2024	Blackline Inc, swap sur rendement total	5 900	74
70	31 juill. 2024	Blue Bird Corp, swap sur rendement total	5 158	(392)
22 500	31 juill. 2024	Blue Bird Tbk Pt, swap sur rendement total	2 959	11

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
140	31 juill. 2024	Blueprint Medicines Corp, swap sur rendement total	20 647	277
59	31 juill. 2024	Bnk Financial Group Inc, swap sur rendement total	497	3
1 303	31 juill. 2024	Boeing Co/The, swap sur rendement total	324 517	6 644
8 600	31 juill. 2024	Bomesc Offshore Engineeri, A, swap sur rendement total	21 310	(2 650)
384	31 juill. 2024	Borgwarner Inc, swap sur rendement total	16 940	(180)
160	31 juill. 2024	Boston Beer Company Inc, A, swap sur rendement total	66 786	1 187
1 604	31 juill. 2024	Box Inc, cat. A, swap sur rendement total	58 031	(2 010)
100	31 juill. 2024	Braskem Sa, actions priv., A, swap sur rendement total	437	(55)
66	31 juill. 2024	Broadcom Inc, swap sur rendement total	144 997	1 687
12	31 juill. 2024	Burford Capital Ltd, swap sur rendement total	214	(24)
18	31 juill. 2024	Byline Bancorp Inc, swap sur rendement total	585	14
2 536	31 juill. 2024	Byucksan Corporation, swap sur rendement total	5 104	(17)
1 900	31 juill. 2024	C&A Modas Ltda, swap sur rendement total	4 343	(433)
3 800	31 juill. 2024	C&D Holsin Engineering Con, A, swap sur rendement total	5 953	(931)
502	31 juill. 2024	Cafe24 Corp, swap sur rendement total	20 158	8 050
20 300	31 juill. 2024	Cal-Comp Electronics Thailan, swap sur rendement total	2 965	159
46	31 juill. 2024	California Water Service Grp, swap sur rendement total	3 052	(98)
36	31 juill. 2024	Calix Inc, swap sur rendement total	1 745	(20)
1 336	31 juill. 2024	Cap Sa, swap sur rendement total	11 482	(870)
5 000	31 juill. 2024	Capital Futures Corp, swap sur rendement total	13 064	401
309	31 juill. 2024	Caredx Inc, swap sur rendement total	6 566	963
3 106	31 juill. 2024	Carmax Inc, swap sur rendement total	311 702	12 318
100	31 juill. 2024	Casey'S General Stores Inc, swap sur rendement total	52 211	1 290
115	31 juill. 2024	Castle Biosciences Inc, swap sur rendement total	3 426	(249)
15	31 juill. 2024	Caterpillar Inc, swap sur rendement total	6 837	(107)
424	31 juill. 2024	Cato Corp, cat. A, swap sur rendement total	3 214	(294)
290	31 juill. 2024	Cbre Group Inc, A, swap sur rendement total	35 361	294
1 451	31 juill. 2024	Ccc Sa, swap sur rendement total	60 671	(6 924)
5 512	31 juill. 2024	Cellebrite Di Ltd, swap sur rendement total	90 131	9 500
1 680	31 juill. 2024	Celsia Sa Esp, swap sur rendement total	2 275	(290)
5 188	31 juill. 2024	Cementos Argos Sa	14 270	(856)
630	31 juill. 2024	Central Garden And Pet Co, A, swap sur rendement total	28 474	(3 843)
93	31 juill. 2024	Central Pacific Financial Co, swap sur rendement total	2 698	108
3 000	31 juill. 2024	Chang Lan Electric Technol, A, swap sur rendement total	7 417	(329)
1 000	31 juill. 2024	Chang Wah Electromaterials, swap sur rendement total	1 996	(242)
7 200	31 juill. 2024	Changjiangrunfa Health Ind, A, swap sur rendement total	529	(767)
500	31 juill. 2024	Charoen Pokphand Foods Pub, swap sur rendement total	427	1
9 015	31 juill. 2024	Chegg Inc, swap sur rendement total	38 981	(8 203)
15 000	31 juill. 2024	Chen Full International Co, swap sur rendement total	28 568	2 002
2 966	31 juill. 2024	Chewy Inc, cat. A, swap sur rendement total	110 554	21 411
2 000	31 juill. 2024	Chien Kuo Construction Co, swap sur rendement total	1 957	(51)
4 114	31 juill. 2024	China Automotive Systems Inc, swap sur rendement total	19 984	(1 376)
707	31 juill. 2024	China Yuchai Intl Ltd, swap sur rendement total	8 804	636
22 000	31 juill. 2024	Chin-Poon Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	45 472	4 294
2 000	31 juill. 2024	Chipbond Technology Corp, swap sur rendement total	5 661	(79)
134	31 juill. 2024	Chipmos Technologies Inc, CAAÉ, swap sur rendement total	4 991	(12)
4 000	31 juill. 2024	Chong Hong Construction Co, swap sur rendement total	18 476	(2 067)
158	31 juill. 2024	Chong Kun Dang Pharma, swap sur rendement total	15 374	(983)
1 066	31 juill. 2024	Chromadex Corp, swap sur rendement total	3 982	(59)
4 300	31 juill. 2024	Cia De Saneamento Do Pa, parts, swap sur rendement total	29 003	(1 715)
12 200	31 juill. 2024	Cia Saneamento Minas Gerais, swap sur rendement total	64 940	593
26 456	31 juill. 2024	Cia Sud Americana De Vapores, swap sur rendement total	2 299	(55)
6 300	31 juill. 2024	Cielo Sa, swap sur rendement total	8 681	(551)
54	31 juill. 2024	Cimpress Plc, swap sur rendement total	6 474	281
698	31 juill. 2024	Cirrus Logic Inc, swap sur rendement total	121 929	11 914
1 100	31 juill. 2024	Citychamp Dartong Co Ltd, A, swap sur rendement total	362	(55)
5 542	31 juill. 2024	Clear Secure Inc, cat. A, swap sur rendement total	141 885	13 205
3 121	31 juill. 2024	Clearwater Analytics Hds, A, swap sur rendement total	79 092	(2 280)
1 322	31 juill. 2024	Clearwater Paper Corp, swap sur rendement total	87 680	(8 820)
252	31 juill. 2024	Clio Cosmetics Co Ltd, swap sur rendement total	9 606	(713)
448	31 juill. 2024	Clover Health Investments Co, swap sur rendement total	754	77
436	31 juill. 2024	Cno Financial Group Inc, swap sur rendement total	16 538	(644)
3 169	31 juill. 2024	Cnx Resources Corp, swap sur rendement total	105 372	(9 108)
5	31 juill. 2024	Coca-Cola Femsa Sab, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	587	(48)
1 852	31 juill. 2024	Cognyte Software Ltd, swap sur rendement total	19 361	(61)
207	31 juill. 2024	Cohu Inc, swap sur rendement total	9 376	209
737	31 juill. 2024	Coinbase Global Inc, cat. A, swap sur rendement total	224 113	(4 782)
29	31 juill. 2024	Comfort Systems Usa Inc, swap sur rendement total	12 068	(903)
37	31 juill. 2024	Commerce Bancshares Inc, swap sur rendement total	2 824	(5)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
9	31 juill. 2024	Community Bank System Inc, swap sur rendement total	587	25
6 000	31 juill. 2024	Compal Electronics, swap sur rendement total	8 782	(616)
1 471	31 juill. 2024	Compugen Ltd, swap sur rendement total	3 382	(1 014)
86	31 juill. 2024	Conagra Brands Inc, swap sur rendement total	3 344	(407)
468	31 juill. 2024	Concrete Pumping Holdings In, swap sur rendement total	3 849	(764)
200	31 juill. 2024	Consensus Cloud Solution, swap sur rendement total	4 702	(483)
61	31 juill. 2024	Construction Partners Inc, A, swap sur rendement total	4 608	(267)
2 922	31 juill. 2024	Corcept Therapeutics Inc, swap sur rendement total	129 905	8 151
82	31 juill. 2024	Costamare Inc, swap sur rendement total	1 844	39
302	31 juill. 2024	Costar Group Inc, swap sur rendement total	30 638	(1 795)
74	31 juill. 2024	Cpi Card Group Inc, swap sur rendement total	2 759	89
625	31 juill. 2024	Crane Nxt Co, swap sur rendement total	52 528	(1 489)
43	31 juill. 2024	Crawford & Company, cat. A, swap sur rendement total	508	(28)
95	31 juill. 2024	Crinetics Pharmaceuticals In, swap sur rendement total	5 822	3
7 900	31 juill. 2024	Cruzeiro Do Sul Educacional, swap sur rendement total	7 250	(1 049)
283	31 juill. 2024	Csg Systems Intl Inc, swap sur rendement total	15 943	(830)
1 600	31 juill. 2024	Csu Cardsystem S A Com Npv, swap sur rendement total	7 287	(417)
9	31 juill. 2024	Csw Industrials Inc, swap sur rendement total	3 267	114
6 000	31 juill. 2024	Ctci Corp, swap sur rendement total	13 414	1 173
1 805	31 juill. 2024	Cushman & Wakefield Plc, swap sur rendement total	25 687	(1 796)
47	31 juill. 2024	Cyberark Software Ltd/Israel, swap sur rendement total	17 584	2 751
52	31 juill. 2024	Cytek Biosciences Inc, swap sur rendement total	397	(5)
459	31 juill. 2024	Cytomx Therapeutics Inc, swap sur rendement total	766	(303)
970	31 juill. 2024	D.I Corporation, swap sur rendement total	25 646	4 614
41	31 juill. 2024	Daehwa Pharm Co Ltd, swap sur rendement total	395	5
1 171	31 juill. 2024	Dae-Il Corp, swap sur rendement total	6 751	680
1 073	31 juill. 2024	Daesang Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	12 041	2 068
2 900	31 juill. 2024	Dayang Enterprise Hldgs Bhd, swap sur rendement total	2 212	(20)
7 000	31 juill. 2024	Delpha Construction Co Ltd, swap sur rendement total	14 321	(377)
347	31 juill. 2024	Deluxe Corp, swap sur rendement total	10 664	(160)
4 102	31 juill. 2024	Dentsply Sirona Inc, swap sur rendement total	140 717	(6 190)
4 087	31 juill. 2024	Develia Sa, swap sur rendement total	8 489	(238)
6 100	31 juill. 2024	Dexco Sa, swap sur rendement total	10 281	(1 056)
600	31 juill. 2024	Dexxos Participacoes Sa - On, swap sur rendement total	1 539	(81)
131	31 juill. 2024	Dgb Financial Group Inc, swap sur rendement total	1 044	(25)
362	31 juill. 2024	Diamondback Energy Inc, swap sur rendement total	99 163	15
6	31 juill. 2024	Dillards Inc, cat. A, swap sur rendement total	3 618	(55)
3 226	31 juill. 2024	Dingdong Cayman Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	8 784	(313)
5 000	31 juill. 2024	Dingzing Advanced Materials, swap sur rendement total	42 689	2 943
197	31 juill. 2024	Dk Tech Co Ltd, swap sur rendement total	2 222	74
702	31 juill. 2024	Docusign Inc, swap sur rendement total	51 391	(1 103)
39	31 juill. 2024	Domo Inc, cat. B, swap sur rendement total	412	55
5	31 juill. 2024	Dong, A St Co Ltd, swap sur rendement total	313	13
2 172	31 juill. 2024	Dongkuk Industries Co Ltd, swap sur rendement total	16 105	1 756
1 424	31 juill. 2024	Dongwoon Anatech Co Ltd, swap sur rendement total	25 448	(1 715)
426	31 juill. 2024	Donnelley Financial Solution, swap sur rendement total	34 754	(767)
296	31 juill. 2024	Doordash Inc, A, swap sur rendement total	44 059	(1 036)
149	31 juill. 2024	Doosan Corp, swap sur rendement total	32 137	1 790
185	31 juill. 2024	Douglas Elliman Inc, swap sur rendement total	294	4
432	31 juill. 2024	Dr. Reddy'S Laboratories, CAAÉ, swap sur rendement total	45 038	2 423
4 232	31 juill. 2024	Dropbox Inc, cat. A, swap sur rendement total	130 121	227
921	31 juill. 2024	Dt Midstream Inc, swap sur rendement total	90 442	5 572
38	31 juill. 2024	Duk San Neolux Co Ltd, swap sur rendement total	1 524	(8)
26	31 juill. 2024	Dxp Enterprises Inc, swap sur rendement total	1 631	(143)
8 000	31 juill. 2024	Dynapack International Tech, swap sur rendement total	33 543	1 583
472	31 juill. 2024	Dynatrace Inc, swap sur rendement total	28 896	(738)
5 700	31 juill. 2024	Ecorodovias Infra E Log Sa, swap sur rendement total	9 478	(788)
1 000	31 juill. 2024	Ecove Environment Corp, swap sur rendement total	13 203	195
4 633	31 juill. 2024	Ecovyst Inc, swap sur rendement total	56 866	(2 160)
1 256	31 juill. 2024	Edgewell Personal Care Co, swap sur rendement total	69 330	2 686
175	31 juill. 2024	Editas Medicine Inc, swap sur rendement total	1 118	(134)
460	31 juill. 2024	Ehealth Inc, swap sur rendement total	2 851	(889)
650	31 juill. 2024	El Pollo Loco Holdings Inc, swap sur rendement total	10 059	438
7 000	31 juill. 2024	Elan Microelectronics Corp, swap sur rendement total	45 472	(2 794)
77 608	31 juill. 2024	Electrical Industries Co, swap sur rendement total	179 742	25 045
1 900	31 juill. 2024	Electricity Generating Pcl, swap sur rendement total	7 327	(41)
4 000	31 juill. 2024	Elion Energy Co Ltd, A, swap sur rendement total	286	(214)
1 783	31 juill. 2024	Embecta Corp, swap sur rendement total	30 497	95
865	31 juill. 2024	Embraer Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	30 537	(2 537)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
18	31 juill. 2024	Emcor Group Inc, swap sur rendement total	8 992	(340)
2 310	31 juill. 2024	Emergent Biosolutions Inc, swap sur rendement total	21 557	3 467
259	31 juill. 2024	Emerson Electric Co, swap sur rendement total	39 041	(687)
2 144	31 juill. 2024	Empresas Cmpc Sa, swap sur rendement total	5 518	(642)
1 920	31 juill. 2024	Enact Holdings Inc, swap sur rendement total	80 551	(441)
3 189	31 juill. 2024	Enea Sa, swap sur rendement total	11 546	118
1 113	31 juill. 2024	Energizer Holdings Inc, swap sur rendement total	44 989	1 230
72	31 juill. 2024	Enersys, swap sur rendement total	10 199	(465)
1 402	31 juill. 2024	Engie Energia Chile Sa, swap sur rendement total	1 715	(67)
144	31 juill. 2024	Ennis Inc, swap sur rendement total	4 313	154
8	31 juill. 2024	Enova International Inc, swap sur rendement total	681	4
68	31 juill. 2024	Enovis Corp, swap sur rendement total	4 206	(489)
260	31 juill. 2024	Entrada Therapeutics Inc, swap sur rendement total	5 070	(462)
156	31 juill. 2024	Enviri Corp, swap sur rendement total	1 842	(62)
2 747	31 juill. 2024	Enzychem Lifesciences Corp, swap sur rendement total	5 371	139
12	31 juill. 2024	Eo Technics Co Ltd, swap sur rendement total	2 229	34
111	31 juill. 2024	Erie Indemnity Company, cat. A, swap sur rendement total	55 044	(298)
1 139	31 juill. 2024	Esperion Therapeutics Inc, swap sur rendement total	3 460	(379)
100	31 juill. 2024	Essa Bancorp Inc, swap sur rendement total	2 407	42
665	31 juill. 2024	Estée Lauder Companies, cat. A, swap sur rendement total	96 819	(15 867)
100	31 juill. 2024	Eternit Sa, swap sur rendement total	149	(13)
450	31 juill. 2024	Etsy Inc, swap sur rendement total	36 317	(3 130)
1 800	31 juill. 2024	Eucatex Sa Industria, actions priv., swap sur rendement total	7 069	626
653	31 juill. 2024	Eugene Technology Co Ltd, swap sur rendement total	32 225	(713)
8 000	31 juill. 2024	Evergreen International Stor, swap sur rendement total	10 714	(639)
18 000	31 juill. 2024	Evergreen Steel Corp, swap sur rendement total	105 920	(2 175)
555	31 juill. 2024	Everquote Inc, cat. A, swap sur rendement total	15 842	(2 129)
2 161	31 juill. 2024	Exact Sciences Corp, swap sur rendement total	124 933	(9 723)
2 564	31 juill. 2024	Extreme Networks Inc, swap sur rendement total	47 189	7 919
1 655	31 juill. 2024	Eyepoint Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	19 702	(4 659)
76	31 juill. 2024	Fabrinet, swap sur rendement total	25 457	526
8	31 juill. 2024	Factset Research Systems Inc, swap sur rendement total	4 469	10
68	31 juill. 2024	Faro Technologies Inc, swap sur rendement total	1 489	(261)
744	31 juill. 2024	Fastenal Co, swap sur rendement total	63 974	(1 540)
20	31 juill. 2024	Ferguson Plc, swap sur rendement total	5 321	(181)
48	31 juill. 2024	Fine Semitech Corp, swap sur rendement total	1 834	175
23	31 juill. 2024	Five9 Inc, swap sur rendement total	1 388	(62)
137	31 juill. 2024	Fiverr International Ltd, swap sur rendement total	4 392	(341)
509	31 juill. 2024	Foot Locker Inc, swap sur rendement total	17 357	(1 861)
324	31 juill. 2024	Formfactor Inc, swap sur rendement total	26 836	2 560
5 000	31 juill. 2024	Formosa Advanced Tech Co Ltd, swap sur rendement total	8 183	18
123	31 juill. 2024	Four Corners Property Trust, swap sur rendement total	4 210	85
7 000	31 juill. 2024	Foxsemicon Integrated Tech, swap sur rendement total	94 429	7 259
3 159	31 juill. 2024	Franklin Resources Inc, swap sur rendement total	97 951	(2 386)
500	31 juill. 2024	Fras-Le Sa, swap sur rendement total	2 373	78
611	31 juill. 2024	Freshpet Inc, swap sur rendement total	108 178	(1 634)
527	31 juill. 2024	Frontdoor Inc, swap sur rendement total	24 367	(1 236)
909	31 juill. 2024	Frontline Ltd, swap sur rendement total	32 041	(3 209)
157	31 juill. 2024	Futurefuel Corp, swap sur rendement total	1 102	179
1 887	31 juill. 2024	G1 Therapeutics Inc, swap sur rendement total	5 887	(2 614)
163	31 juill. 2024	Gaeasoft, swap sur rendement total	1 847	200
74 100	31 juill. 2024	Gajah Tunggal Tbk Pt, swap sur rendement total	6 895	285
5 000	31 juill. 2024	Gem Services Inc/Tw, swap sur rendement total	14 173	26
71	31 juill. 2024	Genco Shipping & Trading Ltd, swap sur rendement total	2 070	(132)
2 000	31 juill. 2024	Generalplus Technology Inc, swap sur rendement total	5 501	(278)
35	31 juill. 2024	Genesco Inc, swap sur rendement total	1 238	85
19 100	31 juill. 2024	Gentera Sab De Cv, swap sur rendement total	32 381	(8 357)
476	31 juill. 2024	Getty Realty Corp, swap sur rendement total	17 658	(195)
5 200	31 juill. 2024	Giti Tire Corp, A, swap sur rendement total	13 668	(574)
692	31 juill. 2024	Gitlab Inc, cat. A, swap sur rendement total	47 080	5 051
308	31 juill. 2024	Glaukos Corp, swap sur rendement total	49 879	2 196
3 000	31 juill. 2024	Global Brands Manufacture, swap sur rendement total	9 402	(28)
2 000	31 juill. 2024	Global Mixed-Mode Technology, swap sur rendement total	25 773	(47)
1 454	31 juill. 2024	Globe Life Inc, swap sur rendement total	163 703	(1 508)
35	31 juill. 2024	Golden Ocean Group Ltd, swap sur rendement total	661	(31)
4 000	31 juill. 2024	Good Will Instrument Co Ltd, swap sur rendement total	7 390	258
958	31 juill. 2024	Goodrx Holdings Inc, cat. A, swap sur rendement total	10 225	(133)
120	31 juill. 2024	Graham Corp, swap sur rendement total	4 624	164
58	31 juill. 2024	Grail Inc, swap sur rendement total	1 220	1 220

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
543	31 juill. 2024	Graphic Packaging Holding Co, swap sur rendement total	19 549	(810)
410	31 juill. 2024	Great Lakes Dredge & Dock Co, swap sur rendement total	4 926	(225)
5 000	31 juill. 2024	Greatek Electronics Inc, swap sur rendement total	13 266	(71)
509	31 juill. 2024	Green Dot Corp, cat. A, swap sur rendement total	6 582	(347)
13	31 juill. 2024	Greif Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 032	(128)
2 220	31 juill. 2024	Grupo Herdez Sab, série *, swap sur rendement total	8 777	(445)
100	31 juill. 2024	Grupo Sbf Sa, swap sur rendement total	294	(11)
1 598	31 juill. 2024	Gs Global Corp, swap sur rendement total	6 417	2 668
4 286	31 juill. 2024	G-Treebnt Co Ltd, swap sur rendement total	29 905	(5 986)
3 700	31 juill. 2024	Guangdong Transtek Medical, A, swap sur rendement total	6 207	(138)
9 100	31 juill. 2024	Guangzhou Baiyun Electric, A, swap sur rendement total	14 341	(1 152)
600	31 juill. 2024	Guangzhou Tech-Long Packag, A, swap sur rendement total	862	(104)
564	31 juill. 2024	Guidewire Software Inc, swap sur rendement total	106 417	12 147
1 100	31 juill. 2024	Guizhou Chitianhua Co Ltd, A, swap sur rendement total	240	(95)
423	31 juill. 2024	Gulf Insurance Group, swap sur rendement total	4 983	699
31 070	31 juill. 2024	Habib Bank Ltd, swap sur rendement total	18 942	1 463
542	31 juill. 2024	Haemonetics Corp/Mass, swap sur rendement total	61 356	(1 585)
8	31 juill. 2024	Haesung Ds Co Ltd, swap sur rendement total	363	(2)
172	31 juill. 2024	Hain Celestial Group Inc, swap sur rendement total	1 626	(183)
1 100	31 juill. 2024	Hangzhou Cable Co Ltd, A, swap sur rendement total	907	(78)
332	31 juill. 2024	Hanil Cement Co Ltd/New, swap sur rendement total	4 422	(142)
569	31 juill. 2024	Hanmi Semiconductor Co Ltd, swap sur rendement total	97 444	6 255
6	31 juill. 2024	Hanssem Co Ltd, swap sur rendement total	365	20
99	31 juill. 2024	Hanwha General Insurance Co, swap sur rendement total	492	16
621	31 juill. 2024	Hanwha Life Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	1 852	124
509	31 juill. 2024	Hanyang Eng Co Ltd, swap sur rendement total	10 093	303
1 316	31 juill. 2024	Harim Co Ltd, swap sur rendement total	4 434	195
614	31 juill. 2024	Harley-Davidson Inc, swap sur rendement total	28 179	(2 104)
500	31 juill. 2024	Hartalega Holdings Bhd, swap sur rendement total	476	18
1 348	31 juill. 2024	Hasbro Inc, swap sur rendement total	107 905	(5 163)
103	31 juill. 2024	Hci Group Inc, swap sur rendement total	12 990	(578)
748	31 juill. 2024	Hdc Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	6 000	107
276	31 juill. 2024	Heico Corp, swap sur rendement total	84 450	368
217	31 juill. 2024	Helmerich & Payne, swap sur rendement total	10 731	146
1 920	31 juill. 2024	Herbalife Nutrition Ltd, swap sur rendement total	27 297	58
2 751	31 juill. 2024	Heritage Insurance Holdings, swap sur rendement total	26 651	(5 450)
60	31 juill. 2024	Hershey Co/The, swap sur rendement total	15 093	(1 208)
296	31 juill. 2024	Hess Midstream Lp, cat. A, swap sur rendement total	14 759	636
355	31 juill. 2024	Heungkuk Fire & Marine Insur, swap sur rendement total	1 438	84
58	31 juill. 2024	Hexcel Corp, swap sur rendement total	4 956	(514)
5 449	31 juill. 2024	Hims & Hers Health Inc, swap sur rendement total	150 539	4 664
56	31 juill. 2024	Hippo Holdings Inc, swap sur rendement total	1 317	(40)
6 000	31 juill. 2024	Hiyes International Co Ltd, swap sur rendement total	58 591	(2 914)
609	31 juill. 2024	Hj Magnolia Yongpyong Hotel	2 028	55
768	31 juill. 2024	Hni Corp, swap sur rendement total	47 311	(2 318)
5 000	31 juill. 2024	Ho Tung Chemical Corp, swap sur rendement total	2 101	8
43	31 juill. 2024	Honda Motor Co Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	1 897	(75)
922	31 juill. 2024	Honest Co Inc/The, swap sur rendement total	3 684	277
2 000	31 juill. 2024	Hong Pu Real Estate Develop, swap sur rendement total	2 826	(164)
13 600	31 juill. 2024	Hoteles City Express Sab De, swap sur rendement total	4 270	(344)
11 900	31 juill. 2024	Huanlejia Food Group Co Lt, A, swap sur rendement total	26 484	(2 598)
4 954	31 juill. 2024	Hub Power Company, swap sur rendement total	3 971	458
356	31 juill. 2024	Hutchmed China, CAAÉ, swap sur rendement total	8 340	(674)
531	31 juill. 2024	Huvis Corp, swap sur rendement total	1 794	(266)
304	31 juill. 2024	Hyundai Electric & Energy Sy, swap sur rendement total	93 668	2 730
1 397	31 juill. 2024	Hyundai Greenfood Co Ltd, swap sur rendement total	6 262	(52)
504	31 juill. 2024	Hyundai Livart Co Ltd, swap sur rendement total	4 619	(141)
12	31 juill. 2024	Hyundai Mipo Dockyard, swap sur rendement total	1 109	231
10	31 juill. 2024	Ichor Holdings Ltd, swap sur rendement total	527	6
131	31 juill. 2024	Idacorp Inc, swap sur rendement total	16 697	(479)
885	31 juill. 2024	Ideaya Biosciences Inc, swap sur rendement total	42 518	(1 995)
2 200	31 juill. 2024	Ife Elevators Co Ltd, A, swap sur rendement total	2 630	(140)
400	31 juill. 2024	Ijm Corp Bhd, swap sur rendement total	361	36
175	31 juill. 2024	Il Dong Pharmaceutical Co Lt, swap sur rendement total	2 261	(107)
334	31 juill. 2024	Illumina Inc, swap sur rendement total	47 705	196
328	31 juill. 2024	Immersion Corporation, swap sur rendement total	4 223	(278)
2 650	31 juill. 2024	Immunovant Inc, swap sur rendement total	95 730	3 240
701	31 juill. 2024	Inari Medical Inc, swap sur rendement total	46 186	(1 958)
2 582	31 juill. 2024	Incyte Corp, swap sur rendement total	214 175	8 896

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
79	31 juill. 2024	Ing Bank Slaski Sa, swap sur rendement total	8 164	(19)
42	31 juill. 2024	Ingevity Corp, swap sur rendement total	2 512	(306)
546	31 juill. 2024	Innovative Solutions & Supp, swap sur rendement total	4 483	(228)
82	31 juill. 2024	Inogen Inc, swap sur rendement total	912	(23)
294	31 juill. 2024	Inspire Medical Systems Inc, swap sur rendement total	53 839	(10 286)
29	31 juill. 2024	Installed Building Products, swap sur rendement total	8 176	(263)
330	31 juill. 2024	Intapp Inc, swap sur rendement total	16 559	310
5 564	31 juill. 2024	Intel Corp, swap sur rendement total	235 790	(211)
12	31 juill. 2024	Intercontinental Hotels, CAAÉ, swap sur rendement total	1 740	66
434	31 juill. 2024	Interflex Co Ltd, swap sur rendement total	6 829	105
12	31 juill. 2024	International Money Express, swap sur rendement total	342	(2)
343	31 juill. 2024	International Paper Co, swap sur rendement total	20 252	(1 790)
14 470	31 juill. 2024	International Steels Ltd, swap sur rendement total	6 014	(271)
1 310	31 juill. 2024	Intevac Inc, swap sur rendement total	6 919	28
1 524	31 juill. 2024	Inversiones La Construccion, swap sur rendement total	17 805	(1 566)
777	31 juill. 2024	Invesco Ltd, swap sur rendement total	15 906	(845)
2 600	31 juill. 2024	Inzone Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	1 924	(167)
2 100	31 juill. 2024	Iochpe-Maxion S.A., swap sur rendement total	6 044	146
879	31 juill. 2024	Ionis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	57 324	11 877
139	31 juill. 2024	Iradimed Corp, swap sur rendement total	8 357	235
1 993	31 juill. 2024	Iridium Communications Inc, swap sur rendement total	72 596	(9 195)
2 003	31 juill. 2024	Ironwood Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	17 870	618
4 900	31 juill. 2024	Irpc Pcl, swap sur rendement total	299	(47)
59	31 juill. 2024	Isc Co Ltd, swap sur rendement total	3 841	(309)
6 000	31 juill. 2024	I-Sheng Electric Wire & Cabl, swap sur rendement total	14 679	454
200	31 juill. 2024	Itron Inc, swap sur rendement total	27 082	(2 427)
716	31 juill. 2024	Ituran Location And Control, swap sur rendement total	24 523	(2 697)
8	31 juill. 2024	Jack Henry & Associates Inc, swap sur rendement total	1 817	10
68	31 juill. 2024	Jack In The Box Inc, swap sur rendement total	4 740	(439)
1 409	31 juill. 2024	James River Group Holdings L, swap sur rendement total	14 903	(216)
789	31 juill. 2024	Jamf Holding Corp, swap sur rendement total	17 814	583
64 100	31 juill. 2024	Japfa Comfeed Indones-Tbk Pt, swap sur rendement total	7 623	214
33 000	31 juill. 2024	Jaya Tiasa Holdings Bhd, swap sur rendement total	10 338	(342)
3 600	31 juill. 2024	Jiangsu Alcha Aluminum Gro, A, swap sur rendement total	1 837	(300)
1 600	31 juill. 2024	Jiangsu Holly Corp, A, swap sur rendement total	1 919	(216)
3 800	31 juill. 2024	Jiangsu Huachang Chemical, A, swap sur rendement total	5 309	(228)
1 600	31 juill. 2024	Jiangsu Lianhuan Pharmaceu, A, swap sur rendement total	2 443	(189)
47 400	31 juill. 2024	Jiangsu Zhongchao Holding, A, swap sur rendement total	17 404	(4 966)
1 000	31 juill. 2024	Jih Lin Technology Co Ltd, swap sur rendement total	2 902	(12)
3 900	31 juill. 2024	Jilin Sino-Microelectronic, A, swap sur rendement total	1 968	49
301	31 juill. 2024	Jm Smucker Co/The, swap sur rendement total	44 911	(1 639)
8	31 juill. 2024	John Bean Technologies Corp, swap sur rendement total	1 040	(10)
1 549	31 juill. 2024	Johnson & Johnson, swap sur rendement total	309 797	(2 272)
146	31 juill. 2024	Js Corp/Kr, swap sur rendement total	2 586	(281)
4 487	31 juill. 2024	Kandi Technologies Group Inc, swap sur rendement total	13 446	687
2 067	31 juill. 2024	Kar Auction Services Inc, swap sur rendement total	46 923	(1 986)
524	31 juill. 2024	Kc Tech Co Ltd/New, swap sur rendement total	23 619	4 144
685	31 juill. 2024	Kearny Financial Corp/Md, swap sur rendement total	5 765	430
300	31 juill. 2024	Keeson Technology Corp Ltd, A, swap sur rendement total	558	(147)
389 000	31 juill. 2024	K-Electric Ltd, swap sur rendement total	8 853	(624)
38	31 juill. 2024	Kennametal Inc, swap sur rendement total	1 224	(120)
3 000	31 juill. 2024	Kerry Tj Logistics Co Ltd, swap sur rendement total	5 454	61
10	31 juill. 2024	Keysight Technologies In, swap sur rendement total	1 871	–
1 230	31 juill. 2024	Kghm Polska Miedz Sa, swap sur rendement total	63 494	(1 057)
5 000	31 juill. 2024	Kindom Development Corp, swap sur rendement total	11 516	(686)
452	31 juill. 2024	Kiniksa Pharmaceuticals, A, swap sur rendement total	11 547	(268)
287	31 juill. 2024	Kiswire Ltd, swap sur rendement total	6 361	104
2 505	31 juill. 2024	Knowles Corp, swap sur rendement total	59 162	(1 109)
310	31 juill. 2024	Kohls Corp, swap sur rendement total	9 752	200
6 028	31 juill. 2024	Koninklijke Philips Nvr- Ny, swap sur rendement total	207 860	(16 335)
222	31 juill. 2024	Koppers Holdings Inc, swap sur rendement total	11 237	(853)
192	31 juill. 2024	Korea Circuit Co Ltd, swap sur rendement total	2 876	8
17	31 juill. 2024	Korea District Heating Corp, swap sur rendement total	830	69
370	31 juill. 2024	Korea Elec Power Corp, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	3 590	(80)
1 513	31 juill. 2024	Korean Reinsurance Co, swap sur rendement total	12 001	(116)
13 900	31 juill. 2024	Kossan Rubber Industries, swap sur rendement total	9 556	408
23 376	31 juill. 2024	Kot Addu Power Company Ltd, swap sur rendement total	3 804	33
300	31 juill. 2024	Ktk Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	373	(58)
816	31 juill. 2024	Kulicke & Soffa Industries, swap sur rendement total	55 148	3 889

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
2 000	31 juill. 2024	Kung Long Batteries Industri, swap sur rendement total	12 064	(319)
2 861	31 juill. 2024	Kyndryl Holdings Inc, swap sur rendement total	103 000	(1 475)
1 040	31 juill. 2024	Landsea Homes Corp, swap sur rendement total	13 078	(1 099)
105	31 juill. 2024	Larimar Therapeutics Inc, swap sur rendement total	1 042	(112)
3 510 003	31 juill. 2024	Latam Airlines Group Sa, swap sur rendement total	65 531	447
799	31 juill. 2024	Laureate Education Inc, A, swap sur rendement total	16 334	(853)
75	31 juill. 2024	Lear Corp, swap sur rendement total	11 721	(162)
4 062	31 juill. 2024	Leggett & Platt Inc, swap sur rendement total	63 975	(752)
23	31 juill. 2024	Lendingtree Inc, swap sur rendement total	1 309	(49)
23 100	31 juill. 2024	Leong Hup International Bhd, swap sur rendement total	4 154	231
2 000	31 juill. 2024	Lida Holdings Ltd, swap sur rendement total	2 409	(39)
1 496	31 juill. 2024	Lifemd Inc, swap sur rendement total	14 043	(2 886)
66	31 juill. 2024	Ligand Pharmaceuticals, swap sur rendement total	7 610	(98)
150	31 juill. 2024	Lindblad Expeditions Holding, swap sur rendement total	1 981	379
144	31 juill. 2024	Liveramp Holdings Inc, swap sur rendement total	6 096	(90)
131	31 juill. 2024	Lot Vacuum Co Ltd, swap sur rendement total	2 031	(228)
3 267	31 juill. 2024	Lotte Non-Life Insurance Co, swap sur rendement total	9 466	(659)
6	31 juill. 2024	Lpp Sa, swap sur rendement total	34 858	(1 411)
2 274	31 juill. 2024	Ls Cable & System Asia Ltd, swap sur rendement total	72 327	(15 548)
280	31 juill. 2024	Ls Corp, swap sur rendement total	40 048	(5 327)
449	31 juill. 2024	Ls Industrial Systems, swap sur rendement total	98 404	5 570
480	31 juill. 2024	Lsi Industries Inc, swap sur rendement total	9 504	(966)
765	31 juill. 2024	Lumen Technologies Inc, swap sur rendement total	1 151	(204)
794	31 juill. 2024	Lument Finance Trust Inc, swap sur rendement total	2 694	(38)
88	31 juill. 2024	Lumentum Holdings Inc, swap sur rendement total	6 132	869
126	31 juill. 2024	Luxfer Holdings Plc, swap sur rendement total	1 998	(134)
11 008	31 juill. 2024	Lyft Inc, A, swap sur rendement total	212 385	(23 858)
1 334	31 juill. 2024	Macrogenics Inc, swap sur rendement total	7 758	227
1 764	31 juill. 2024	Macy'S Inc, swap sur rendement total	46 764	(395)
142	31 juill. 2024	Madison Square Garden Sports, swap sur rendement total	36 555	33
232	31 juill. 2024	Madrigal Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	88 939	13 627
331	31 juill. 2024	Magnolia Oil & Gas Corp, A, swap sur rendement total	11 477	(320)
38	31 juill. 2024	Malibu Boats Inc, A, swap sur rendement total	1 822	(185)
3 310	31 juill. 2024	Mannkind Corp, swap sur rendement total	23 643	2 424
2 719	31 juill. 2024	Maravai Lifesciences Hldgs, A, swap sur rendement total	26 639	(5 677)
62 280	31 juill. 2024	Marcopolo Sa, actions priv., swap sur rendement total	96 788	(9 358)
27	31 juill. 2024	Marketaxess Holdings Inc, swap sur rendement total	7 409	22
400	31 juill. 2024	Marriott Vacations World, swap sur rendement total	47 794	(1 798)
1 844	31 juill. 2024	Marvell Technology Group Ltd, swap sur rendement total	176 374	2 591
127 839	31 juill. 2024	Masisa Sa, swap sur rendement total	3 448	(433)
115	31 juill. 2024	Matrix Service Co, swap sur rendement total	1 563	(343)
55	31 juill. 2024	Matthews Intl Corp, cat. A, swap sur rendement total	1 885	(249)
440	31 juill. 2024	Maxlinear Inc, swap sur rendement total	12 126	1 464
110	31 juill. 2024	Mbank Sa, swap sur rendement total	23 820	(160)
16 413	31 juill. 2024	Mcb Bank Ltd, swap sur rendement total	18 316	1 456
164	31 juill. 2024	Mccormick & Co, actions sans droit de vote, swap sur rendement total	15 920	350
145	31 juill. 2024	Medallion Financial Corp, swap sur rendement total	1 524	(131)
29 800	31 juill. 2024	Medco Energi Internasional T, swap sur rendement total	3 320	(184)
677	31 juill. 2024	Mednax Inc, swap sur rendement total	6 994	244
30	31 juill. 2024	Medpace Holdings Inc, swap sur rendement total	16 907	946
9	31 juill. 2024	Mercantile Bank Corp, swap sur rendement total	500	26
1 000	31 juill. 2024	Mercuries & Associates Holdi, swap sur rendement total	700	(78)
27	31 juill. 2024	Merit Medical Systems Inc, swap sur rendement total	3 175	166
67	31 juill. 2024	Meritz Financial Group Inc, swap sur rendement total	5 268	162
3 000	31 juill. 2024	Merry Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	17 463	1 729
72	31 juill. 2024	Meta Platforms Inc, cat. A, swap sur rendement total	49 676	2 042
78	31 juill. 2024	Methode Electronics Inc, swap sur rendement total	1 105	(127)
760	31 juill. 2024	Micron Technology Inc, swap sur rendement total	136 784	6 048
595	31 juill. 2024	Millat Tractors Ltd, swap sur rendement total	1 860	3
44	31 juill. 2024	Millerknoll Inc, swap sur rendement total	1 606	(61)
642	31 juill. 2024	Mimedx Group Inc, swap sur rendement total	6 088	(213)
5 000	31 juill. 2024	Min Aik Technology Co Ltd, swap sur rendement total	7 055	(5)
36	31 juill. 2024	Minerals Technologies Inc, swap sur rendement total	4 097	(193)
2 248	31 juill. 2024	Miniso Group Holding Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	58 660	(10 871)
103	31 juill. 2024	Mirae Asset Life Insurance, swap sur rendement total	560	26
83	31 juill. 2024	Mirum Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	3 883	894
56	31 juill. 2024	Montauk Renewables Inc, swap sur rendement total	437	16
149	31 juill. 2024	Morphic Holding Inc, swap sur rendement total	6 946	730
1 000	31 juill. 2024	Mpi Corp, swap sur rendement total	22 357	1 965

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
419	31 juill. 2024	Msc Industrial Direct Co, A, swap sur rendement total	45 471	(2 603)
1 543	31 juill. 2024	Murphy Oil Corp, swap sur rendement total	87 073	(937)
46 300	31 juill. 2024	Namyong Terminal Pcl, swap sur rendement total	6 245	(362)
8	31 juill. 2024	National Beverage Corp, swap sur rendement total	596	86
600	31 juill. 2024	National Fuel Gas Co, swap sur rendement total	44 913	(1 113)
14	31 juill. 2024	Natures Sunshine Prods Inc, swap sur rendement total	289	(6)
1 560	31 juill. 2024	Ncino Inc, swap sur rendement total	67 134	1 756
806	31 juill. 2024	Ncr Voyix Corp, swap sur rendement total	13 621	(971)
4 594	31 juill. 2024	Nektar Therapeutics, swap sur rendement total	7 795	(225)
41	31 juill. 2024	Nerdwallet Inc, cat. A, swap sur rendement total	819	36
150	31 juill. 2024	Netgear Inc, swap sur rendement total	3 140	295
1 159	31 juill. 2024	Netscout Systems Inc, swap sur rendement total	29 006	(2 923)
102	31 juill. 2024	Nevro Corp, swap sur rendement total	1 175	(167)
3 592	31 juill. 2024	Newell Brands Inc, swap sur rendement total	31 506	(6 589)
294	31 juill. 2024	Nexen Tire Corp, swap sur rendement total	2 273	(142)
2 000	31 juill. 2024	Nichidenbo Corp, swap sur rendement total	5 644	(125)
181	31 juill. 2024	Nl Industries, swap sur rendement total	1 493	(334)
634	31 juill. 2024	Nordstrom Inc, swap sur rendement total	18 409	(907)
208	31 juill. 2024	Northeast Community Bancorp, swap sur rendement total	5 072	198
1 000	31 juill. 2024	Nova Technology Corp, swap sur rendement total	8 414	(148)
1 816	31 juill. 2024	Novocure Ltd, swap sur rendement total	42 567	(12 547)
13	31 juill. 2024	Novo-Nordisk A/S, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	2 539	122
443	31 juill. 2024	Nu Skin Enterprises Inc, A, swap sur rendement total	6 389	(1 747)
3 883	31 juill. 2024	Nutanix Inc, A, swap sur rendement total	302 061	14 818
264	31 juill. 2024	Nuvalent Inc, A, swap sur rendement total	27 404	3 606
545	31 juill. 2024	Nuvation Bio Inc, swap sur rendement total	2 178	(143)
413	31 juill. 2024	Nxp Semiconductors Nv, swap sur rendement total	152 643	(1 853)
893	31 juill. 2024	Office Properties Income Tru, swap sur rendement total	2 493	(312)
1 549	31 juill. 2024	Okta Inc, swap sur rendement total	198 413	10 147
29	31 juill. 2024	Old Second Bancorp Inc, swap sur rendement total	588	12
2 602	31 juill. 2024	Olo Inc, cat. A, swap sur rendement total	15 737	(619)
539	31 juill. 2024	Omnicell Inc, swap sur rendement total	19 965	(4 142)
641	31 juill. 2024	Onespan Inc, swap sur rendement total	11 245	(350)
57	31 juill. 2024	Onespaworld Holdings Ltd, swap sur rendement total	1 199	(20)
511	31 juill. 2024	Option Care Health Inc, swap sur rendement total	19 369	(109)
2 345	31 juill. 2024	Optron-Tec Inc, swap sur rendement total	7 447	(1 105)
684	31 juill. 2024	Orasure Technologies Inc, swap sur rendement total	3 987	(457)
62	31 juill. 2024	Orion Group Holdings Inc, swap sur rendement total	807	(111)
6	31 juill. 2024	Osi Systems Inc, swap sur rendement total	1 129	(56)
114	31 juill. 2024	Owens-Illinois Inc, swap sur rendement total	1 736	(249)
66	31 juill. 2024	Paccar Inc, swap sur rendement total	9 297	(309)
4 000	31 juill. 2024	Pacific Hospital Supply Co, swap sur rendement total	15 506	15
1 153	31 juill. 2024	Pagerduty Inc, swap sur rendement total	36 177	6 128
2 500	31 juill. 2024	Pak Elektron Ltd, swap sur rendement total	304	(7)
138	31 juill. 2024	Paycor Hcm Inc, swap sur rendement total	2 398	53
54	31 juill. 2024	Paymentus Holdings Inc, A, swap sur rendement total	1 404	16
919	31 juill. 2024	Pbf Energy Inc, cat. A, swap sur rendement total	57 871	(583)
486	31 juill. 2024	Pdf Solutions Inc, swap sur rendement total	24 193	805
396	31 juill. 2024	Peabody Energy Corp, swap sur rendement total	11 986	(1 492)
9 300	31 juill. 2024	Pecca Group Bhd, swap sur rendement total	3 534	(427)
1 130	31 juill. 2024	Pegasystems Inc, swap sur rendement total	93 594	4 375
1 000	31 juill. 2024	Pegatron Corp, swap sur rendement total	4 577	94
27	31 juill. 2024	Pentair Plc, swap sur rendement total	2 833	(140)
2 386	31 juill. 2024	Petco Health And Wellness Co, swap sur rendement total	12 341	(330)
274	31 juill. 2024	Photronics Inc, swap sur rendement total	9 249	(871)
62	31 juill. 2024	Pilgrim'S Pride Corp, swap sur rendement total	3 265	210
1 620	31 juill. 2024	Pinnacle West Capital, swap sur rendement total	169 314	(6 186)
2 301	31 juill. 2024	Pinterest Inc, cat. A, swap sur rendement total	138 758	7 623
4 000	31 juill. 2024	Pixart Imaging Inc, swap sur rendement total	28 684	1 013
907	31 juill. 2024	Pixelworks Inc, swap sur rendement total	1 220	(113)
1 646	31 juill. 2024	Pmv Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	3 649	(466)
696	31 juill. 2024	Polaris Inc, swap sur rendement total	74 580	(5 335)
2 000	31 juill. 2024	Polytronics Technology Corp, swap sur rendement total	4 438	(220)
255	31 juill. 2024	Poongsan Corp, swap sur rendement total	16 044	399
67	31 juill. 2024	Poongsan Holdings Corp, swap sur rendement total	1 821	(75)
983	31 juill. 2024	Poseida Therapeutics Inc, swap sur rendement total	3 928	(112)
4 000	31 juill. 2024	Pou Chen, swap sur rendement total	6 091	(239)
354	31 juill. 2024	Powell Industries Inc, swap sur rendement total	69 462	(17 989)
217	31 juill. 2024	Power Integrations Inc, swap sur rendement total	20 842	(1 763)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
22 800	31 juill. 2024	Pp Persero Tbk Pt, swap sur rendement total	552	(98)
36	31 juill. 2024	Primoris Services Corp, swap sur rendement total	2 461	(247)
3 000	31 juill. 2024	Prince Housing & Development, swap sur rendement total	1 519	(23)
1 720	31 juill. 2024	Procore Technologies Inc, swap sur rendement total	156 065	(2 427)
4 500	31 juill. 2024	Profarma Distribuidora, swap sur rendement total	5 749	(456)
608	31 juill. 2024	Progress Software Corp, swap sur rendement total	45 142	2 837
9 000	31 juill. 2024	Promate Electronic Co Ltd, swap sur rendement total	36 066	(222)
509	31 juill. 2024	Protagonist Therapeutics Inc, swap sur rendement total	24 133	4 131
165	31 juill. 2024	Prothena Corp Plc, swap sur rendement total	4 660	(57)
700	31 juill. 2024	Ptc Therapeutics Inc, swap sur rendement total	29 291	(5 863)
535	31 juill. 2024	Puma Biotechnology Inc, swap sur rendement total	2 387	(443)
3 626	31 juill. 2024	Pure Storage Inc, cat. A, swap sur rendement total	318 587	18 663
5 200	31 juill. 2024	Qingdao Kingking Applied, A, swap sur rendement total	1 753	(450)
3 200	31 juill. 2024	Qingdao Topscomm Communica, A, swap sur rendement total	2 687	(230)
134	31 juill. 2024	Qualys Inc, swap sur rendement total	26 147	819
34	31 juill. 2024	Quicklogic Corp, swap sur rendement total	483	(122)
910	31 juill. 2024	Quinenco S.A., swap sur rendement total	4 082	(381)
2 972	31 juill. 2024	Qurate Retail Inc., série A, swap sur rendement total	2 562	(354)
2 000	31 juill. 2024	Radiant Opto-Electronics Cor, swap sur rendement total	16 831	206
502	31 juill. 2024	Radware Ltd, swap sur rendement total	12 529	(1 162)
5 500	31 juill. 2024	Randon Participacoes Sa, actions priv., swap sur rendement total	14 699	992
204	31 juill. 2024	Rapid7 Inc, swap sur rendement total	12 067	1 941
886	31 juill. 2024	Re/Max Holdings Inc, cat. A, swap sur rendement total	9 820	(31)
2 000	31 juill. 2024	Realtek Semiconductor Corp, swap sur rendement total	46 063	61
1 000	31 juill. 2024	Rechi Precision Co Ltd, swap sur rendement total	1 287	64
124	31 juill. 2024	Red Robin Gourmet Burgers, swap sur rendement total	1 284	(117)
655	31 juill. 2024	Redfin Corp, swap sur rendement total	5 387	(407)
62	31 juill. 2024	Regal Beloit Corp, swap sur rendement total	22 888	(2 134)
1 200	31 juill. 2024	Regional Container Line Pcl, swap sur rendement total	1 274	(69)
600	31 juill. 2024	Regional Sab De Cv, swap sur rendement total	6 123	(1 040)
3 640	31 juill. 2024	Remitly Global Inc, swap sur rendement total	60 367	(4 606)
44	31 juill. 2024	Rent-A-Center Inc, swap sur rendement total	1 871	(115)
86	31 juill. 2024	Ribbon Communications Inc, swap sur rendement total	387	18
97	31 juill. 2024	Rimini Street Inc, swap sur rendement total	407	65
649	31 juill. 2024	Ringcentral Inc, cat. A, swap sur rendement total	25 043	(5 358)
1 693	31 juill. 2024	Rio Tinto Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	152 735	(7 170)
2 062	31 juill. 2024	Riskified Ltd, A, swap sur rendement total	18 030	779
91	31 juill. 2024	Robert Half Intl Inc, swap sur rendement total	7 967	(92)
5 558	31 juill. 2024	Robinhood Markets Inc, A, swap sur rendement total	172 716	13 093
259	31 juill. 2024	Rogers Corp, swap sur rendement total	42 745	(537)
29 500	31 juill. 2024	Rojana Indus Park Pub Co Ltd, swap sur rendement total	6 705	(64)
3 576	31 juill. 2024	Roku Inc, swap sur rendement total	293 251	11 329
324	31 juill. 2024	Root Inc/Oh, cat. A, swap sur rendement total	22 881	269
1 637	31 juill. 2024	Rush Enterprises Inc, cat. A, swap sur rendement total	93 788	(7 618)
677	31 juill. 2024	Rush Street Interactive Inc, swap sur rendement total	8 884	556
1 502	31 juill. 2024	Ryanair Holdings Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	239 315	(11 431)
268	31 juill. 2024	S&T Dynamics Co Ltd, swap sur rendement total	5 980	886
429	31 juill. 2024	S&T Holdings Co Ltd, swap sur rendement total	9 168	(181)
569	31 juill. 2024	Sabre Corp, swap sur rendement total	2 079	(367)
245	31 juill. 2024	Safe Bulkers Inc, swap sur rendement total	1 951	38
41	31 juill. 2024	Samchully Co Ltd, swap sur rendement total	3 712	76
58	31 juill. 2024	Samhwa Paints Industrial Co, swap sur rendement total	457	(12)
159	31 juill. 2024	Sammok S-Form Co Ltd, swap sur rendement total	2 895	(166)
26	31 juill. 2024	Samyang Foods Co Ltd, swap sur rendement total	17 289	1 409
21 000	31 juill. 2024	San Far Property Ltd, swap sur rendement total	36 407	(3 655)
42	31 juill. 2024	Sanmina Corp, swap sur rendement total	3 807	(147)
714	31 juill. 2024	Sarepta Therapeutics Inc, swap sur rendement total	154 366	30 688
201	31 juill. 2024	Saudi Paper Manufacturing Co, swap sur rendement total	5 528	(376)
6 000	31 juill. 2024	Savior Lifetec Corp, swap sur rendement total	6 454	1 064
1 000	31 juill. 2024	Scientech Corp, swap sur rendement total	15 080	743
3 044	31 juill. 2024	Sea Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	297 483	15 145
1 053	31 juill. 2024	Seagate Technology, swap sur rendement total	149 808	14 881
452	31 juill. 2024	Sebang Co Ltd, swap sur rendement total	6 312	889
1 039	31 juill. 2024	Segyung Hitech Co Ltd, swap sur rendement total	11 835	(114)
20 954	31 juill. 2024	Sejong Telecom Inc, swap sur rendement total	12 350	(170)
1 777	31 juill. 2024	Selectquote Inc, swap sur rendement total	6 711	(904)
1 372	31 juill. 2024	Semrush Holdings Inc, A, swap sur rendement total	25 138	(3 790)
69	31 juill. 2024	Seneca Foods Corp, cat. A, swap sur rendement total	5 419	(207)
1 439	31 juill. 2024	Sensata Technologies Holding, swap sur rendement total	73 623	(7 147)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
959	31 juill. 2024	Sentinelone Inc, cat. A, swap sur rendement total	27 623	4 942
116	31 juill. 2024	Seronics Co Ltd, swap sur rendement total	1 998	(209)
214	31 juill. 2024	Service Properties Trust, swap sur rendement total	1 505	(76)
2 200	31 juill. 2024	Shandong Link Science And, A, swap sur rendement total	6 015	(314)
2 800	31 juill. 2024	Shandong Molong Petroleum, A, swap sur rendement total	743	(341)
7 300	31 juill. 2024	Shanghai Kaichuang Marine, A, swap sur rendement total	11 312	(1 189)
900	31 juill. 2024	Shanghai Yaohua Pilkington, A, swap sur rendement total	715	(101)
100	31 juill. 2024	Shanxi Antai Group Co Ltd, A, swap sur rendement total	30	(7)
405	31 juill. 2024	Shattuck Labs Inc, swap sur rendement total	2 139	(1 960)
11 000	31 juill. 2024	Shell Pakistan Ltd (Pbs), swap sur rendement total	7 251	212
7 500	31 juill. 2024	Shenyang Huitian Thermal, A, swap sur rendement total	4 349	(52)
84 800	31 juill. 2024	Shenyang Jinshan Energy Co, A, swap sur rendement total	43 270	(3 389)
211	31 juill. 2024	Shenzhen Kiwi Instruments, A, swap sur rendement total	1 195	27
200	31 juill. 2024	Shenzhen Sunxing Light All, A, swap sur rendement total	337	(64)
1 000	31 juill. 2024	Shih Wei Navigation Co Ltd, swap sur rendement total	892	(88)
960	31 juill. 2024	Shindaeyang Paper Co Ltd, swap sur rendement total	5 658	(208)
5 000	31 juill. 2024	Shinkong Insurance Co Ltd, swap sur rendement total	21 342	1 263
3 043	31 juill. 2024	Shinsung Tongsang Co Ltd, swap sur rendement total	6 896	1 281
314	31 juill. 2024	Ship Finance Intl Ltd, swap sur rendement total	5 964	(121)
21	31 juill. 2024	Shockwave Medical Inc, swap sur rendement total	9 619	85
259	31 juill. 2024	Siga Technologies Inc, swap sur rendement total	2 690	23
13 000	31 juill. 2024	Sigurd Microelectronics Corp, swap sur rendement total	43 540	(269)
852	31 juill. 2024	Silk Road Medical Inc, swap sur rendement total	31 524	6 085
107	31 juill. 2024	Silvercrest Asset Manageme, A, swap sur rendement total	2 283	33
163	31 juill. 2024	Similarweb Ltd, swap sur rendement total	1 733	9
1 000	31 juill. 2024	Sinmag Equipment Corp, swap sur rendement total	6 791	197
8 000	31 juill. 2024	Sinon Corp, swap sur rendement total	14 848	831
12 000	31 juill. 2024	Sinphar Pharmaceutical Co, swap sur rendement total	19 615	839
5 000	31 juill. 2024	Sirtec International Co Ltd, swap sur rendement total	8 141	(212)
3 600	31 juill. 2024	Sis Distribution Tha, swap sur rendement total	3 521	(236)
571	31 juill. 2024	Sk Hynix Inc, swap sur rendement total	134 222	27 131
51	31 juill. 2024	Sleep Number Corp, actions étrangères, swap sur rendement total	668	(392)
202	31 juill. 2024	Smartrent Inc, swap sur rendement total	661	6
1 370	31 juill. 2024	Smartsheet Inc, cat. A, swap sur rendement total	82 634	9 677
159	31 juill. 2024	Smith & Wesson Brands Inc, swap sur rendement total	3 120	(564)
10 450	31 juill. 2024	Smu Sa, swap sur rendement total	2 507	(311)
10 657	31 juill. 2024	Snap Inc, A, swap sur rendement total	242 215	22 325
2 590	31 juill. 2024	Sofi Technologies Inc, swap sur rendement total	23 426	(1 143)
4 597	31 juill. 2024	Solarwinds Corp, swap sur rendement total	75 798	2 658
5 698	31 juill. 2024	Sonda Sa, swap sur rendement total	3 442	(185)
6 000	31 juill. 2024	Sonix Technology Co Ltd, swap sur rendement total	13 009	(549)
2 989	31 juill. 2024	Sonos Inc, swap sur rendement total	60 368	(4 530)
1	31 juill. 2024	Soulbrain Co Ltd/New, swap sur rendement total	289	(31)
8 600	31 juill. 2024	Sp Setia Bhd, swap sur rendement total	3 442	(191)
25	31 juill. 2024	Spectrum Brands Holdings Inc, swap sur rendement total	2 940	(148)
25	31 juill. 2024	Spire Global Inc, swap sur rendement total	371	57
168	31 juill. 2024	Spok Holdings Inc, swap sur rendement total	3 405	(101)
605	31 juill. 2024	Sprout Social Inc, cat. A, swap sur rendement total	29 538	2 402
3 076	31 juill. 2024	Square Inc, A, swap sur rendement total	271 441	644
6 300	31 juill. 2024	Sri Trang Agro-Industry Pcl, swap sur rendement total	5 070	(287)
12	31 juill. 2024	Staar Surgical Co, swap sur rendement total	782	97
2 400	31 juill. 2024	Star Petroleum Refining Pcl, swap sur rendement total	729	(28)
3 000	31 juill. 2024	Stark Technology Inc, swap sur rendement total	15 773	(242)
3 295	31 juill. 2024	Starwood Property Trust Inc, swap sur rendement total	87 559	(304)
112	31 juill. 2024	Steelcase Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 986	(112)
23	31 juill. 2024	Stepstone Group Inc, cat. A, swap sur rendement total	1 444	79
159	31 juill. 2024	Sterling Infrastructure Inc, swap sur rendement total	25 747	(893)
131	31 juill. 2024	Steven Madden Ltd, swap sur rendement total	7 582	(418)
1 349	31 juill. 2024	Stitch Fix Inc, cat. A, swap sur rendement total	7 661	1 083
116	31 juill. 2024	Strategic Education Inc, swap sur rendement total	17 565	(531)
717	31 juill. 2024	Sturm Ruger & Co Inc, swap sur rendement total	40 863	(2 840)
63	31 juill. 2024	Sun Country Airlines Holding, swap sur rendement total	1 083	165
713	31 juill. 2024	Sun Kwang Co Ltd, swap sur rendement total	12 324	114
2 154	31 juill. 2024	Suncoke Energy Inc, swap sur rendement total	28 885	(2 331)
31 000	31 juill. 2024	Sunplus Technology Co Ltd, swap sur rendement total	47 337	(396)
3 000	31 juill. 2024	Sunrex Technology Corp, swap sur rendement total	7 605	(146)
1 200	31 juill. 2024	Supermax Corp Bhd, swap sur rendement total	305	(6)
36	31 juill. 2024	Supernus Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	1 318	(23)
35 400	31 juill. 2024	Surya Semesta Internusa Pt, swap sur rendement total	3 176	(366)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
300	31 juill. 2024	Suzhou Longjie Special Fib, A, swap sur rendement total	416	(45)
159	31 juill. 2024	Suzhou Mingzhi Technology, A, swap sur rendement total	402	(53)
5 000	31 juill. 2024	Swancor Holding Co Ltd, swap sur rendement total	29 106	2 023
380	31 juill. 2024	Sweetgreen Inc, cat. A, swap sur rendement total	15 672	(378)
20 800	31 juill. 2024	Syarikat Takaful Malaysia Ke, swap sur rendement total	22 504	(455)
1 300	31 juill. 2024	Syn Prop E Tech Sa, swap sur rendement total	2 911	(254)
2 000	31 juill. 2024	Syncmold Enterprise Corp, swap sur rendement total	9 111	(151)
10 000	31 juill. 2024	T3Ex Global Holdings Corp, swap sur rendement total	42 604	(4 447)
925	31 juill. 2024	Taboola.Com Ltd, swap sur rendement total	4 354	(740)
203	31 juill. 2024	Tae Kyung Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	1 122	(69)
1	31 juill. 2024	Taekwang Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	621	(20)
8 000	31 juill. 2024	Taiflex Scientific Co Ltd, swap sur rendement total	19 640	1 815
26 000	31 juill. 2024	Taiwan Fire & Marine Insuran, swap sur rendement total	31 202	408
1 000	31 juill. 2024	Taiwan Pcb Techvest Co Ltd, swap sur rendement total	1 658	2
3 000	31 juill. 2024	Taiwan Sakura Corp, swap sur rendement total	11 516	525
4 000	31 juill. 2024	Taiwan Shin Kong Security Co, swap sur rendement total	7 154	(18)
464	31 juill. 2024	Tandem Diabetes Care Inc, swap sur rendement total	25 581	(7 015)
9 466	31 juill. 2024	Tauron Polska Energia Sa, swap sur rendement total	12 743	(629)
9 463	31 juill. 2024	Teladoc Health Inc, swap sur rendement total	126 638	(19 446)
4 827	31 juill. 2024	Telephone And Data Systems, swap sur rendement total	136 922	3 226
1 143	31 juill. 2024	Telesat Corp, swap sur rendement total	14 233	(3 526)
162	31 juill. 2024	Telos Corporation, swap sur rendement total	891	(117)
770	31 juill. 2024	Tenable Holdings Inc, swap sur rendement total	45 917	1 267
10 000	31 juill. 2024	Test-Rite International Co, swap sur rendement total	8 936	193
297	31 juill. 2024	Tg Therapeutics Inc, swap sur rendement total	7 230	580
2 600	31 juill. 2024	Thai Oil Pcl, swap sur rendement total	5 134	112
300	31 juill. 2024	Thai Stanley Electric Pub Co, swap sur rendement total	2 414	(50)
2 450	31 juill. 2024	The National Agriculture Dev, swap sur rendement total	28 461	1 827
761	31 juill. 2024	Theravance Biopharma Inc, swap sur rendement total	8 830	(218)
90	31 juill. 2024	Third Coast Bancshares Inc, swap sur rendement total	2 619	13
5 200	31 juill. 2024	Timah Tbk Pt, swap sur rendement total	380	(14)
1 122	31 juill. 2024	Toast Inc, cat. A, swap sur rendement total	39 564	2 256
1 395	31 juill. 2024	Tongyang Life Insurance, swap sur rendement total	10 843	3 916
6 808	31 juill. 2024	Tonymoly Co Ltd, swap sur rendement total	80 050	5 462
1 300	31 juill. 2024	Top Glove Corp Bhd, swap sur rendement total	415	17
11	31 juill. 2024	Topbuild Corp, swap sur rendement total	5 799	(516)
1 000	31 juill. 2024	Topco Technologies Corp, swap sur rendement total	3 290	(49)
1 000	31 juill. 2024	Topkey Corp, swap sur rendement total	8 458	(102)
800	31 juill. 2024	Topscore Fashion Co Ltd, A, swap sur rendement total	354	(30)
13	31 juill. 2024	Toyota Motor Corp, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	3 646	4
2 000	31 juill. 2024	Transcend Information Inc, swap sur rendement total	9 702	(233)
24	31 juill. 2024	Transmedics Group Inc, swap sur rendement total	4 946	453
366	31 juill. 2024	Travere Therapeutics Inc, swap sur rendement total	4 117	388
1 111	31 juill. 2024	Tredegar Corp, swap sur rendement total	7 282	(1 038)
114	31 juill. 2024	Tri Pointe Homes Inc, swap sur rendement total	5 811	(495)
7 000	31 juill. 2024	Tripod Technology Corp, swap sur rendement total	64 518	1 735
117	31 juill. 2024	Triumph Group Inc, swap sur rendement total	2 467	192
269	31 juill. 2024	Tronox Holdings Plc, A, swap sur rendement total	5 775	(1 543)
2 000	31 juill. 2024	Tsann Kuen Enterprise Co Ltd, swap sur rendement total	2 999	(33)
11	31 juill. 2024	Tse Co Ltd, swap sur rendement total	657	40
4 000	31 juill. 2024	Tty Biopharm Co Ltd, swap sur rendement total	12 840	(282)
700	31 juill. 2024	Turtle Beach Corp, swap sur rendement total	13 735	(2 152)
245	31 juill. 2024	Tutor Perini Corp, swap sur rendement total	7 302	(123)
240	31 juill. 2024	Twin Disc Inc, swap sur rendement total	3 869	(802)
215	31 juill. 2024	Tyson Foods Inc, cat. A, swap sur rendement total	16 810	(75)
4 000	31 juill. 2024	Ubright Optronics Corp, swap sur rendement total	10 630	75
1 054	31 juill. 2024	Ugi Corp, swap sur rendement total	33 568	1 058
325	31 juill. 2024	Uju Electronics Co Ltd, swap sur rendement total	4 787	(443)
1 074	31 juill. 2024	Ultragenyx Pharmaceutical In, swap sur rendement total	60 401	966
23	31 juill. 2024	Unid Co Ltd, swap sur rendement total	2 320	(189)
8	31 juill. 2024	Unifirst Corp/Ma, swap sur rendement total	1 878	135
1 914	31 juill. 2024	United Bank Ltd, swap sur rendement total	2 411	304
907	31 juill. 2024	United Bankshares Inc, swap sur rendement total	40 720	297
174	31 juill. 2024	United Therapeutics Corp, swap sur rendement total	75 844	9 849
900	31 juill. 2024	United Tractors Tbk Pt, swap sur rendement total	1 650	(28)
26	31 juill. 2024	Universal Health Rlty Income, swap sur rendement total	1 392	46
1 058	31 juill. 2024	Universal Insurance Holdings, swap sur rendement total	27 159	(1 479)
8	31 juill. 2024	Universal Logistics Holdings, swap sur rendement total	445	(27)
6 000	31 juill. 2024	Universal Microwave Tech, swap sur rendement total	73 144	(121)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
14	31 juill. 2024	Universal Stainless & Alloy, swap sur rendement total	525	(107)
724	31 juill. 2024	Universal Technical Institut, swap sur rendement total	15 583	(134)
983	31 juill. 2024	Upstart Holdings Inc, swap sur rendement total	31 731	(1 718)
184	31 juill. 2024	Upwork Inc, swap sur rendement total	2 707	34
10	31 juill. 2024	Utah Medical Products Inc, swap sur rendement total	918	(20)
353	31 juill. 2024	Uwm Holdings Corp, swap sur rendement total	3 396	(178)
274	31 juill. 2024	V One Tech Co Ltd, swap sur rendement total	1 988	(255)
2 100	31 juill. 2024	V.S. Industry Berhad, swap sur rendement total	774	28
175	31 juill. 2024	Vaalco Energy Inc, swap sur rendement total	1 501	(32)
15 700	31 juill. 2024	Valid Solucoes Sa, swap sur rendement total	58 481	(6 599)
1 458	31 juill. 2024	Vanda Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	11 272	1 017
138	31 juill. 2024	Varonis Systems Inc, swap sur rendement total	9 058	921
105	31 juill. 2024	Vector Group Ltd, swap sur rendement total	1 519	(60)
892	31 juill. 2024	Veeco Instruments Inc, swap sur rendement total	57 013	7 199
79	31 juill. 2024	Veeva Systems Inc, cat. A, swap sur rendement total	19 783	95
2 000	31 juill. 2024	Ventec International Group C, swap sur rendement total	7 103	69
3 230	31 juill. 2024	Ventyx Biosciences Inc, swap sur rendement total	10 210	(10 944)
287	31 juill. 2024	Vera Bradley Inc, swap sur rendement total	2 458	(753)
310	31 juill. 2024	Veracyte Inc, swap sur rendement total	9 192	331
561	31 juill. 2024	Verint Systems Inc, swap sur rendement total	24 718	1 847
463	31 juill. 2024	Verra Mobility Corp, swap sur rendement total	17 232	291
374	31 juill. 2024	Vertiv Holdings Co, swap sur rendement total	44 303	(6 133)
7 507	31 juill. 2024	Vf Corp, swap sur rendement total	138 675	1 723
1 000	31 juill. 2024	Via Labs Inc, swap sur rendement total	8 352	(128)
394	31 juill. 2024	Viking Therapeutics Inc, swap sur rendement total	28 579	(3 636)
33	31 juill. 2024	Village Super Market, cat. A, swap sur rendement total	1 193	(185)
482	31 juill. 2024	Vimeo Inc, swap sur rendement total	2 460	(109)
194	31 juill. 2024	Viper Energy Partners Lp, swap sur rendement total	9 963	(274)
235	31 juill. 2024	Visa Inc, actions, cat. A, swap sur rendement total	84 400	(4 077)
297	31 juill. 2024	Vishay Precision Group, swap sur rendement total	12 371	(1 404)
397	31 juill. 2024	Vistra Corp, swap sur rendement total	46 707	(541)
1 498	31 juill. 2024	Vital Farms Inc, swap sur rendement total	95 869	10 157
800	31 juill. 2024	Vulcabras Azaleia Sa, swap sur rendement total	2 896	(198)
85	31 juill. 2024	Wabash National Corp, swap sur rendement total	2 540	(80)
4 000	31 juill. 2024	Wah Lee Industrial Corp, swap sur rendement total	23 960	2 890
532	31 juill. 2024	Warrior Met Coal Inc, swap sur rendement total	45 694	(4 538)
2 383	31 juill. 2024	Warsaw Stock Exchange, swap sur rendement total	39 289	1 620
112	31 juill. 2024	Waters Corp, swap sur rendement total	44 462	(2 835)
55	31 juill. 2024	Watsco Inc, swap sur rendement total	34 863	(868)
8	31 juill. 2024	Watts Water Technologies, A, swap sur rendement total	2 007	(104)
4 567	31 juill. 2024	Wave Life Sciences Ltd, swap sur rendement total	31 184	(7 596)
96	31 juill. 2024	Weave Communications Inc, swap sur rendement total	1 185	44
400	31 juill. 2024	Weichai Heavy Machinery Co, A, swap sur rendement total	602	(48)
12 000	31 juill. 2024	Weikeng Industrial Co Ltd, swap sur rendement total	18 602	(1 217)
516	31 juill. 2024	Western Digital Corp, swap sur rendement total	53 499	142
27 900	31 juill. 2024	Westports Holdings Bhd, swap sur rendement total	33 747	678
409	31 juill. 2024	Whirlpool Corp, swap sur rendement total	57 197	4 893
725	31 juill. 2024	Wiley (John) & Sons, cat. A, swap sur rendement total	40 377	3 526
192	31 juill. 2024	Willis Lease Finance Corp, swap sur rendement total	18 207	1 032
4 000	31 juill. 2024	Wisdom Marine Lines Co Ltd, swap sur rendement total	11 938	(1 204)
237	31 juill. 2024	Wisol Co Ltd, swap sur rendement total	1 892	(20)
1 027	31 juill. 2024	Wix.Com Ltd, swap sur rendement total	223 540	(3 753)
5 900	31 juill. 2024	Wiz Co, swap sur rendement total	8 628	(566)
1 770	31 juill. 2024	Wooree Bio Co Ltd, swap sur rendement total	5 181	41
48	31 juill. 2024	Workiva Inc, swap sur rendement total	4 794	(266)
151	31 juill. 2024	Worldex Industry & Trading C, swap sur rendement total	3 429	219
17 000	31 juill. 2024	Wpg Holdings Ltd, swap sur rendement total	64 395	2 424
26 000	31 juill. 2024	Wt Microelectronics Co Ltd, swap sur rendement total	135 996	8 988
500	31 juill. 2024	Wuxi Xuelang Environmental, A, swap sur rendement total	317	(66)
5 170	31 juill. 2024	Ww International Inc, swap sur rendement total	8 277	(3 510)
13 000	31 juill. 2024	Xinjiang Torch Gas Co Ltd, A, swap sur rendement total	32 947	(2 394)
219	31 juill. 2024	Xperi Holding Corp, swap sur rendement total	2 460	(169)
3 963	31 juill. 2024	X-Trade Brokers Dom Maklersk, swap sur rendement total	96 514	5 321
4 000	31 juill. 2024	Yang Ming Marine Transport, swap sur rendement total	12 587	495
1 100	31 juill. 2024	Yangmei Chemical Co Ltd, A, swap sur rendement total	354	(45)
49	31 juill. 2024	Yas Co Ltd/Korea, swap sur rendement total	527	(21)
287	31 juill. 2024	Yelp Inc, swap sur rendement total	14 511	(76)
532	31 juill. 2024	Yest Co Ltd, swap sur rendement total	10 168	829
1 658	31 juill. 2024	Yext Inc, swap sur rendement total	12 138	635

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
600	31 juill. 2024	Ylz Information Technology, A, swap sur rendement total	228	(24)
145	31 juill. 2024	Y-Mabs Therapeutics Inc, swap sur rendement total	2 397	(19)
3 000	31 juill. 2024	Youngtek Electronics Corp, swap sur rendement total	10 035	753
94 500	31 juill. 2024	Ytl Corp Bhd, swap sur rendement total	94 568	(4 353)
5 300	31 juill. 2024	Ytl Hospitality Reit, swap sur rendement total	1 860	(28)
89 700	31 juill. 2024	Ytl Power International Bhd, swap sur rendement total	125 410	(3 008)
7 000	31 juill. 2024	Yungshim Construction, swap sur rendement total	63 337	2 941
689	31 juill. 2024	Zai Lab Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	16 339	(523)
200	31 juill. 2024	Zamp Sa, swap sur rendement total	183	18
401	31 juill. 2024	Ze Pak Sa, swap sur rendement total	2 576	(107)
5 000	31 juill. 2024	Zenitron Corporation, swap sur rendement total	7 487	(169)
566	31 juill. 2024	Zentalis Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	3 168	(5 993)
643	31 juill. 2024	Zeta Global Holdings Corp, A, swap sur rendement total	15 529	1 103
104	31 juill. 2024	Zeus Co Ltd, swap sur rendement total	1 815	24
300	31 juill. 2024	Zhejiang Dibay Electric Co, A, swap sur rendement total	799	6
35 000	31 juill. 2024	Zhejiang Jasan Holding Gro, A, swap sur rendement total	65 572	(6 683)
7 300	31 juill. 2024	Zhejiang Tengen Electrics Co, swap sur rendement total	7 656	(987)
3 161	31 juill. 2024	Zillow Group Inc, C, swap sur rendement total	200 653	22 615
1 075	31 juill. 2024	Zim Integrated Shipping Serv, swap sur rendement total	32 612	1 231
11 700	31 juill. 2024	Zjmi Environmental Energy, A, swap sur rendement total	27 603	(3 462)
523	31 juill. 2024	Zscaler Inc, swap sur rendement total	137 540	15 262
387	31 juill. 2024	Zuora Inc, cat. A, swap sur rendement total	5 258	(134)
				131 468
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position acheteur		(274 157)
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	(156)	1
(555)	31 juill. 2024	Airtel Africa Plc, swap sur rendement total	(1 180)	(6)
(85)	31 juill. 2024	Auction Technology Group, swap sur rendement total	(737)	41
(884)	31 juill. 2024	Batm Advanced Communications, swap sur rendement total	(260)	15
(5 204)	31 juill. 2024	Bmo Commercial Property Trus, swap sur rendement total	(7 129)	(66)
(100)	31 juill. 2024	Boot (Henry) Plc, swap sur rendement total	(363)	(13)
(849)	31 juill. 2024	Crest Nicholson Holdings, swap sur rendement total	(3 527)	(38)
(1 685)	31 juill. 2024	Croda International Plc, swap sur rendement total	(115 068)	17 719
(10)	31 juill. 2024	Diversified Energy Co Plc, swap sur rendement total	(182)	22
(2 361)	31 juill. 2024	Energean Plc, swap sur rendement total	(40 267)	8 551
(44)	31 juill. 2024	Fevertree Drinks Plc, swap sur rendement total	(825)	(3)
(8)	31 juill. 2024	Flutter Entertainment Plc, swap sur rendement total	(2 002)	67
(437)	31 juill. 2024	Future Plc, swap sur rendement total	(7 929)	113
(67)	31 juill. 2024	Great Portland Estates, néant, swap sur rendement total	(130)	(130)
(111)	31 juill. 2024	Great Portland Estates Plc, swap sur rendement total	(659)	5
(6 745)	31 juill. 2024	Greatland Gold Plc, swap sur rendement total	(817)	129
(6 199)	31 juill. 2024	Haleon Plc, swap sur rendement total	(34 591)	409
(5 802)	31 juill. 2024	Itm Power Plc, swap sur rendement total	(4 657)	1 626
(65)	31 juill. 2024	James Fisher & Sons Plc, swap sur rendement total	(358)	(10)
(1 646)	31 juill. 2024	Jubilee Metals Group Plc, swap sur rendement total	(201)	25
(55)	31 juill. 2024	Keywords Studios Plc, swap sur rendement total	(2 200)	(74)
(287)	31 juill. 2024	M&G Plc, swap sur rendement total	(1 013)	(20)
(50)	31 juill. 2024	Mortgage Advice Bureau Holdi, swap sur rendement total	(707)	65
(4 296)	31 juill. 2024	Ocado Group Plc, swap sur rendement total	(21 468)	6 020
(3 439)	31 juill. 2024	Old Mutual Ltd, swap sur rendement total	(3 141)	(484)
(2 890)	31 juill. 2024	Oxford Nanopore Technologies, swap sur rendement total	(4 719)	524
(27 646)	31 juill. 2024	Phoenix Group Holdings Plc, swap sur rendement total	(249 382)	(11 106)
(100)	31 juill. 2024	Phoenix Spree Deutschland Lt, swap sur rendement total	(272)	5
(526)	31 juill. 2024	Primary Health Properties, swap sur rendement total	(835)	17
(693)	31 juill. 2024	Quilter Plc, swap sur rendement total	(1 440)	(23)
(2 526)	31 juill. 2024	Regional Reit Ltd, swap sur rendement total	(715)	274
(22 862)	31 juill. 2024	Rentokil Initial Plc, swap sur rendement total	(182 382)	(15 731)
(320)	31 juill. 2024	Rws Holdings Plc, swap sur rendement total	(1 053)	(86)
(274)	31 juill. 2024	S4 Capital Plc, swap sur rendement total	(200)	51
(112)	31 juill. 2024	Spirax-Sarco Engineering Plc, swap sur rendement total	(16 428)	822
(2 194)	31 juill. 2024	St James'S Place Plc, swap sur rendement total	(20 740)	(1 700)
(3 346)	31 juill. 2024	Tate & Lyle Plc, swap sur rendement total	(35 357)	4 739
(749)	31 juill. 2024	Wh Smith Plc, swap sur rendement total	(14 666)	286
(100)	31 juill. 2024	Workspace Group Plc, swap sur rendement total	(1 027)	(98)
(5 894)	31 juill. 2024	Wpp Plc, swap sur rendement total	(76 340)	7 193

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
				19 131
Euro – taux à court terme (€STR)				
(100)	31 juill. 2024	Abc Arbitrage, swap sur rendement total	(564)	53
(495)	31 juill. 2024	Adva Optical Networking Se, swap sur rendement total	(14 359)	231
(119)	31 juill. 2024	Alfen Nv, swap sur rendement total	(3 012)	3 316
(25)	31 juill. 2024	Altarea, swap sur rendement total	(3 105)	828
(597)	31 juill. 2024	Anora Group Oyj, swap sur rendement total	(3 979)	100
(43)	31 juill. 2024	Basic-Fit Nv, swap sur rendement total	(1 269)	154
(1 660)	31 juill. 2024	Cellnex Telecom Sa, swap sur rendement total	(73 934)	7 504
(98)	31 juill. 2024	Deutsche Wohnen Se, swap sur rendement total	(2 581)	(2)
(201)	31 juill. 2024	Forfarmers Nv, swap sur rendement total	(794)	15
(89)	31 juill. 2024	Heineken Nv, swap sur rendement total	(11 786)	239
(175)	31 juill. 2024	Hella Gmbh & Co Kgaa, swap sur rendement total	(21 943)	(72)
(672)	31 juill. 2024	Hellofresh Se, swap sur rendement total	(4 454)	941
(118)	31 juill. 2024	Immobel, swap sur rendement total	(4 292)	455
(205)	31 juill. 2024	Kws Saat Se & Co Kgaa, swap sur rendement total	(17 918)	1 069
(27)	31 juill. 2024	Lna Sante, swap sur rendement total	(940)	73
(324)	31 juill. 2024	Mercialys, swap sur rendement total	(4 908)	612
(289)	31 juill. 2024	Mtu Aero Engines Ag, swap sur rendement total	(101 210)	(4 153)
(34)	31 juill. 2024	Neoen Sa, swap sur rendement total	(1 878)	4
(100)	31 juill. 2024	Orange Belgium, swap sur rendement total	(2 191)	(6)
(487)	31 juill. 2024	Oriola Corp, B, swap sur rendement total	(646)	36
(21)	31 juill. 2024	Pne Ag, swap sur rendement total	(418)	40
(3 387)	31 juill. 2024	Porsche Automobil Hldg, actions priv., swap sur rendement total	(209 663)	41 214
(34)	31 juill. 2024	Prosus Nv, swap sur rendement total	(1 658)	13
(12)	31 juill. 2024	Qiagen N.V., swap sur rendement total	(678)	16
(191)	31 juill. 2024	Raisio Oyj, actions,V, swap sur rendement total	(534)	12
(7)	31 juill. 2024	Secunet Security Networks Ag, swap sur rendement total	(1 287)	180
(34)	31 juill. 2024	Stratec Se, swap sur rendement total	(2 274)	107
(408)	31 juill. 2024	Terveystalo Oyj, swap sur rendement total	(5 146)	188
(493)	31 juill. 2024	Verbio Vereinigte Bioenergi, swap sur rendement total	(12 609)	3 537
(267)	31 juill. 2024	Voltalia Sa, actions ord., swap sur rendement total	(3 387)	919
(25)	31 juill. 2024	Waga Energy Sa, swap sur rendement total	(587)	79
(14)	31 juill. 2024	Zeal Network Se, swap sur rendement total	(708)	19
				57 721
Dollar de Hong Kong – taux interbancaifre offert à Hong Kong (HIBOR) à 1 mois				
(22 000)	31 juill. 2024	Akeso Inc, swap sur rendement total	(145 556)	22 586
(46 000)	31 juill. 2024	Anhui Conch Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(158 311)	(2 812)
(2 400)	31 juill. 2024	Ascentage Pharma Group Inter, swap sur rendement total	(10 747)	(3 049)
(100)	31 juill. 2024	Asymchem Laboratories Tian, H, swap sur rendement total	(888)	58
(14 000)	31 juill. 2024	Beijing Capital Intl Airpo, H, swap sur rendement total	(6 330)	190
(16 000)	31 juill. 2024	Beijing Enterprises Water Gr, swap sur rendement total	(6 974)	22
(1 000)	31 juill. 2024	Beijing Tong Ren Tang Chines, swap sur rendement total	(1 579)	98
(3 000)	31 juill. 2024	Cathay Pacific Airways, swap sur rendement total	(4 201)	41
(7 000)	31 juill. 2024	China Conch Venture Holdings, swap sur rendement total	(8 931)	(1 450)
(73 002)	31 juill. 2024	China Feihe Ltd, swap sur rendement total	(46 188)	3 476
(1 000)	31 juill. 2024	China International Marine, H, swap sur rendement total	(1 234)	120
(36 000)	31 juill. 2024	China Modern Dairy Holdings, swap sur rendement total	(4 417)	385
(60 000)	31 juill. 2024	China National Building Ma, H, swap sur rendement total	(29 444)	2 302
(96 000)	31 juill. 2024	China Petroleum & Chemical, H, swap sur rendement total	(85 136)	(2 523)
(500)	31 juill. 2024	China Resources Medical Hold, swap sur rendement total	(315)	21
(1 500)	31 juill. 2024	China Resources Pharmaceutic, swap sur rendement total	(1 566)	(39)
(2 000)	31 juill. 2024	Citic Telecom International, swap sur rendement total	(918)	(18)
(2 000)	31 juill. 2024	Ck Asset Holdings Ltd, swap sur rendement total	(10 253)	593
(7 000)	31 juill. 2024	Cofco Joycome Foods Ltd, swap sur rendement total	(2 037)	313
(13 000)	31 juill. 2024	Flat Glass Group Co Ltd, H, swap sur rendement total	(27 133)	5 731
(1 000)	31 juill. 2024	Fosun International Ltd, swap sur rendement total	(743)	31
(14 000)	31 juill. 2024	Fu Shou Yuan International, swap sur rendement total	(11 974)	676
(37 800)	31 juill. 2024	Ganfeng Lithium Co Ltd, H, swap sur rendement total	(106 525)	32 143
(36 000)	31 juill. 2024	Haidilao International Holdi, swap sur rendement total	(93 784)	14 838
(26 000)	31 juill. 2024	Haitong Securities Co Ltd, H, swap sur rendement total	(17 031)	659
(1 500)	31 juill. 2024	Hangzhou Tigermed Consulti, H, swap sur rendement total	(7 417)	1 257
(2 000)	31 juill. 2024	Hansoh Pharmaceutical Group, swap sur rendement total	(5 770)	(124)
(1 000)	31 juill. 2024	Hengan Intl Group Co Ltd, swap sur rendement total	(4 171)	611
(90 500)	31 juill. 2024	Hk Electric Investments, titres agrafés, swap sur rendement total	(78 513)	(1 930)
(7 500)	31 juill. 2024	Hkbn Ltd, swap sur rendement total	(3 234)	156
(33 000)	31 juill. 2024	Hkt Trust And Hkt Ltd, titres agrafés, swap sur rendement total	(50 665)	1 253
(61 000)	31 juill. 2024	Hong Kong & China Gas, swap sur rendement total	(63 505)	1 587

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(1 100)	31 juill. 2024	Huaxin Cement Co Ltd, H, swap sur rendement total	(1 564)	(20)
(1 400)	31 juill. 2024	Hygeia Healthcare Holdings C, swap sur rendement total	(6 907)	1 084
(30 000)	31 juill. 2024	Jiumaojiu International Hold, swap sur rendement total	(22 083)	1 290
(400)	31 juill. 2024	Livzon Pharmaceutical Grou, H, swap sur rendement total	(1 802)	63
(4 500)	31 juill. 2024	Mtr Corp, swap sur rendement total	(20 143)	(729)
(2 800)	31 juill. 2024	Nongfu Spring Co Ltd, H, swap sur rendement total	(18 579)	1 897
(25 000)	31 juill. 2024	Pccw Ltd, swap sur rendement total	(17 132)	892
(2 000)	31 juill. 2024	Picc Property & Casualty, H, swap sur rendement total	(3 400)	159
(24 800)	31 juill. 2024	Sands China Ltd, swap sur rendement total	(70 761)	10 119
(23 750)	31 juill. 2024	Shandong Gold Mining Co Lt, H, swap sur rendement total	(65 313)	2 974
(200)	31 juill. 2024	Shanghai Junshi Bioscience, H, swap sur rendement total	(410)	24
(16 900)	31 juill. 2024	Shanghai Pharmaceuticals, H, swap sur rendement total	(34 773)	(298)
(30 000)	31 juill. 2024	Sino Land Co, swap sur rendement total	(42 326)	1 420
(34 000)	31 juill. 2024	Sinopharm Group Co, H, swap sur rendement total	(129 228)	(2 420)
(18 000)	31 juill. 2024	Travelsky Technology Ltd, H, swap sur rendement total	(29 440)	3 042
(14 000)	31 juill. 2024	Tsingtao Brewery Co Ltd, H, swap sur rendement total	(127 837)	8 020
(6 000)	31 juill. 2024	Vitasoy Intl Holdings Ltd, swap sur rendement total	(6 204)	796
(1 000)	31 juill. 2024	Wharf Holdings Ltd, swap sur rendement total	(3 847)	212
(351 000)	31 juill. 2024	Wheelock & Co Ltd, swap sur rendement total	(81 203)	381
(13 400)	31 juill. 2024	Wuxi Apptec Co Ltd, H, swap sur rendement total	(71 079)	9 117
(41 000)	31 juill. 2024	Wuxi Biologics Cayman Inc, swap sur rendement total	(82 924)	(241)
(800)	31 juill. 2024	Wynn Macau Ltd, swap sur rendement total	(897)	133
(1 000)	31 juill. 2024	Xiabuxiabu Catering Manageme, swap sur rendement total	(240)	72
(4 000)	31 juill. 2024	Zhaojin Mining Industry, H, swap sur rendement total	(9 184)	155
(1 000)	31 juill. 2024	Zhou Hei Ya International Ho, swap sur rendement total	(303)	11
				115 355
Rand sud-africain – taux interbancaire offert à Johannesburg (JIBAR) à 1 mois				
(281)	31 juill. 2024	Astral Foods Ltd, swap sur rendement total	(3 448)	(486)
(2 024)	31 juill. 2024	Dis-Chem Pharmacies Pty Ltd, swap sur rendement total	(5 105)	(334)
(812)	31 juill. 2024	Lighthouse Properties Plc, swap sur rendement total	(486)	(5)
(227)	31 juill. 2024	Shoprite Holdings Ltd, swap sur rendement total	(4 832)	(413)
				(1 238)
Couronne suédoise – taux interbancaire offert à Stockholm (STIBOR) à 1 mois				
(15)	31 juill. 2024	Atrium Ljungberg Ab, actions, B, swap sur rendement total	(398)	(8)
(659)	31 juill. 2024	Beijer Ref Ab, swap sur rendement total	(13 922)	592
(106)	31 juill. 2024	Bioarctic Ab, swap sur rendement total	(3 134)	166
(1 533)	31 juill. 2024	Cint Group Ab, swap sur rendement total	(1 950)	902
(27 619)	31 juill. 2024	Embracer Group Ab, swap sur rendement total	(83 113)	10 088
(322)	31 juill. 2024	Garo Ab, swap sur rendement total	(1 113)	211
(35)	31 juill. 2024	Getinge Ab, actions, B, swap sur rendement total	(814)	33
(8 795)	31 juill. 2024	Hexatronic Group Ab, swap sur rendement total	(57 842)	(6 364)
(20)	31 juill. 2024	Hms Networks Ab, swap sur rendement total	(1 086)	90
(53)	31 juill. 2024	Investment Ab Latour, actions, B, swap sur rendement total	(1 960)	45
(336)	31 juill. 2024	K-Fast Holding Ab, swap sur rendement total	(873)	23
(82)	31 juill. 2024	Lime Technologies Ab, swap sur rendement total	(3 708)	(91)
(185)	31 juill. 2024	Mips Ab, swap sur rendement total	(9 920)	332
(727)	31 juill. 2024	Pandox Ab, swap sur rendement total	(17 754)	101
(1 901)	31 juill. 2024	Powercell Sweden Ab, swap sur rendement total	(7 226)	2 704
(40 442)	31 juill. 2024	Sinch Ab, swap sur rendement total	(134 295)	(13 438)
(667)	31 juill. 2024	Vitrolife Ab, swap sur rendement total	(15 022)	911
(1 168)	31 juill. 2024	Wallenstam Ab, actions, B, swap sur rendement total	(7 599)	216
				(3 487)
Franc suisse – taux moyen du financement à un jour (SARON)				
(839)	31 juill. 2024	Avolta Ag, swap sur rendement total	(44 588)	2 155
(30)	31 juill. 2024	Barry Callebaut Ag, actions ord., swap sur rendement total	(66 880)	4 716
(4)	31 juill. 2024	Daetwyler Holding Ag, actions au porteur, swap sur rendement total	(1 028)	105
(35 762)	31 juill. 2024	Meyer Burger Technology Ag, swap sur rendement total	(583)	(35)
(82)	31 juill. 2024	Molecular Partners Ag, swap sur rendement total	(814)	(313)
(54)	31 juill. 2024	Polypeptide Group Ag, swap sur rendement total	(2 352)	395
(46)	31 juill. 2024	Softwareone Holding Ag, swap sur rendement total	(1 184)	22
(6)	31 juill. 2024	Straumann Holding Ag, actions ord., swap sur rendement total	(1 017)	33
				7 078
Dollar américain – taux de financement à un jour garanti (SOFR)				
(483)	31 juill. 2024	10X Genomics Inc, cat. A, swap sur rendement total	(12 855)	1 804
(18 500)	31 juill. 2024	3R Petroleum Oleo E Gas Sa, swap sur rendement total	(126 163)	9 844
(17 345)	31 juill. 2024	Abdul Mohsen Al, Hokair Touri, swap sur rendement total	(16 575)	(632)
(21)	31 juill. 2024	Acwa Power Co, swap sur rendement total	(2 713)	248
(4 000)	31 juill. 2024	Advanced Energy Solution Hol, swap sur rendement total	(106 468)	2 434

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(4 542)	31 juill. 2024	Advanced Petrochemicals Co, swap sur rendement total	(63 862)	2 058
(30)	31 juill. 2024	Al Moammar Information Syste, swap sur rendement total	(1 829)	(239)
(354)	31 juill. 2024	Albemarle Corp, swap sur rendement total	(46 463)	1 666
(16)	31 juill. 2024	Aldrees Petroleum And Transp, swap sur rendement total	(713)	(58)
(374)	31 juill. 2024	Allegiant Travel Co, swap sur rendement total	(25 706)	1 389
(365)	31 juill. 2024	Allegro Microsystems Inc, swap sur rendement total	(14 104)	464
(737)	31 juill. 2024	Allegro.Eu Sa, swap sur rendement total	(9 445)	275
(193)	31 juill. 2024	Alteogen Inc, swap sur rendement total	(53 808)	(18 241)
(1 177)	31 juill. 2024	Alupar Investimento Sa, parts, swap sur rendement total	(8 875)	89
(2 000)	31 juill. 2024	Ambipar Participacoes E Empr, swap sur rendement total	(6 314)	(2 087)
(749)	31 juill. 2024	Amc Entertainment Hlds, cat. A, swap sur rendement total	(5 104)	(650)
(63)	31 juill. 2024	Amc Networks Inc, A, swap sur rendement total	(833)	563
(84)	31 juill. 2024	Aon Plc, swap sur rendement total	(33 744)	(468)
(527)	31 juill. 2024	Applied Digital Corp, swap sur rendement total	(4 291)	(915)
(25)	31 juill. 2024	Applied Materials Inc, swap sur rendement total	(8 073)	(10)
(46)	31 juill. 2024	Applovin Corp, cat. A, swap sur rendement total	(5 238)	(215)
(55)	31 juill. 2024	Aptiv Plc, swap sur rendement total	(5 300)	353
(736)	31 juill. 2024	Arabian Internet & Communica, swap sur rendement total	(78 492)	(6 430)
(52)	31 juill. 2024	Argenx Se, CAAÉ, swap sur rendement total	(30 599)	(4 100)
(198)	31 juill. 2024	Armour Residential Reit Inc, swap sur rendement total	(5 251)	8
(321)	31 juill. 2024	Arvinas Inc, swap sur rendement total	(11 693)	1 739
(581)	31 juill. 2024	Ash-Sharqiyah Development Co, swap sur rendement total	(4 166)	280
(10)	31 juill. 2024	Aspen Aerogels Inc, swap sur rendement total	(326)	85
(232)	31 juill. 2024	Astrazeneca Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(24 758)	245
(18 500)	31 juill. 2024	Axiata Group Berhad, swap sur rendement total	(14 006)	1 099
(300)	31 juill. 2024	Banco Bradesco S.A., swap sur rendement total	(850)	50
(36 702)	31 juill. 2024	Becle Sab De Cv, swap sur rendement total	(90 729)	2 334
(25 200)	31 juill. 2024	Berjaya Food Bhd, swap sur rendement total	(3 947)	296
(2 415)	31 juill. 2024	Bloom Energy Corp, A, swap sur rendement total	(40 448)	10 568
(127)	31 juill. 2024	Brinker International Inc, swap sur rendement total	(12 580)	(222)
(1 000)	31 juill. 2024	British American Tobacco Bhd, swap sur rendement total	(2 408)	170
(199 100)	31 juill. 2024	Bts Group Holdings Pcl, swap sur rendement total	(33 233)	2 305
(414)	31 juill. 2024	Caesars Entertainment Inc, swap sur rendement total	(22 513)	(1 562)
(592)	31 juill. 2024	Canaan Inc, swap sur rendement total	(810)	12
(70)	31 juill. 2024	Canadian Solar Inc, swap sur rendement total	(1 413)	468
(40)	31 juill. 2024	Canoo Inc, swap sur rendement total	(117)	7
(156)	31 juill. 2024	Carvana Co, swap sur rendement total	(27 477)	(5 350)
(2 000)	31 juill. 2024	Cathay Financial Holding Co, swap sur rendement total	(4 978)	(226)
(4)	31 juill. 2024	Cavco Industries Inc, swap sur rendement total	(1 895)	(2)
(3 009)	31 juill. 2024	Cd Projekt Sa, swap sur rendement total	(142 132)	(5 412)
(74 000)	31 juill. 2024	Celcomdigi Bhd	(78 990)	621
(781)	31 juill. 2024	Celsius Holdings Inc, swap sur rendement total	(61 011)	17 290
(2 000)	31 juill. 2024	Center Laboratories Inc, swap sur rendement total	(4 589)	(545)
(1 000)	31 juill. 2024	Chailease Holding Co Ltd, swap sur rendement total	(6 475)	108
(1 292)	31 juill. 2024	Chargepoint Holdings Inc, swap sur rendement total	(2 670)	238
(45)	31 juill. 2024	Check Point Software Tech, swap sur rendement total	(10 160)	(770)
(2 000)	31 juill. 2024	Chroma Ate Inc, swap sur rendement total	(27 385)	(2 553)
(35)	31 juill. 2024	Chunbo Co Ltd, swap sur rendement total	(2 498)	52
(27 000)	31 juill. 2024	Chung Hung Steel Corp, swap sur rendement total	(24 487)	794
(1 020)	31 juill. 2024	Cisco Systems Inc, swap sur rendement total	(66 311)	(1 173)
(152)	31 juill. 2024	Citigroup Inc, swap sur rendement total	(13 199)	(329)
(385)	31 juill. 2024	Citius Pharmaceuticals Inc, swap sur rendement total	(308)	53
(3 000)	31 juill. 2024	Cleanaway Co Ltd, swap sur rendement total	(24 234)	130
(859)	31 juill. 2024	Cleveland-Cliffs Inc, swap sur rendement total	(18 090)	798
(260)	31 juill. 2024	Cloudflare Inc, cat. A, swap sur rendement total	(29 469)	(4 138)
(41)	31 juill. 2024	Cogent Communications Holdin, swap sur rendement total	(3 166)	(169)
(176)	31 juill. 2024	Comcast Corp, cat. A, swap sur rendement total	(9 431)	(276)
(402)	31 juill. 2024	Compass Inc, cat. A, swap sur rendement total	(1 980)	69
(29)	31 juill. 2024	Compass Minerals Internation, swap sur rendement total	(410)	101
(10 000)	31 juill. 2024	Corp Inmobiliaria Vesta Sab, swap sur rendement total	(40 912)	3 692
(158)	31 juill. 2024	Corteva Inc, swap sur rendement total	(11 662)	427
(18)	31 juill. 2024	Cs Wind Corp, swap sur rendement total	(886)	56
(225)	31 juill. 2024	Cts Corp, swap sur rendement total	(15 600)	760
(28 400)	31 juill. 2024	Cvc Brasil Operadora E Agenc, swap sur rendement total	(13 623)	745
(1 236)	31 juill. 2024	Cvs Health Corp, swap sur rendement total	(99 887)	2 398
(3 357)	31 juill. 2024	Cyfrowy Polsat Sa, swap sur rendement total	(13 831)	807
(1 000)	31 juill. 2024	Da-Li Development Co Ltd, swap sur rendement total	(2 501)	79
(181)	31 juill. 2024	Danimer Scientific, bons de souscription, swap sur rendement total	(6)	(6)
(542)	31 juill. 2024	Danimer Scientific Inc, swap sur rendement total	(447)	132

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(2 176)	31 juill. 2024	Dar Al Arkan Real Estate Dev, swap sur rendement total	(9 365)	159
(36)	31 juill. 2024	Dexcom Inc, swap sur rendement total	(5 585)	169
(25)	31 juill. 2024	Diageo Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(4 313)	346
(245)	31 juill. 2024	Digitalocean Holdings Inc, swap sur rendement total	(11 650)	811
(1 418)	31 juill. 2024	Dino Polska Sa, swap sur rendement total	(195 806)	(1 844)
(34)	31 juill. 2024	Dollar General Corp, swap sur rendement total	(6 152)	(155)
(208)	31 juill. 2024	Doosan Fuel Cell Co Ltd, swap sur rendement total	(4 373)	678
(3 735)	31 juill. 2024	Dutch Bros Inc, cat. A, swap sur rendement total	(211 587)	(29 381)
(279)	31 juill. 2024	D-Wave Quantum Inc, swap sur rendement total	(435)	69
(11 000)	31 juill. 2024	E Ink Holdings Inc, swap sur rendement total	(116 929)	(14 264)
(388)	31 juill. 2024	Ecopetrol Sa, CAAE parrainé, swap sur rendement total	(6 366)	148
(207)	31 juill. 2024	Ecopro Bm Co Ltd, swap sur rendement total	(37 651)	1 594
(290)	31 juill. 2024	Ecopro Co Ltd, swap sur rendement total	(25 971)	1 164
(49)	31 juill. 2024	Elevance Health Inc, swap sur rendement total	(36 331)	(389)
(189)	31 juill. 2024	Elm Co, swap sur rendement total	(59 090)	(2 525)
(50)	31 juill. 2024	Emaar Economic City, swap sur rendement total	(118)	4
(1 000)	31 juill. 2024	Ememory Technology Inc, swap sur rendement total	(108 408)	1 956
(1 114)	31 juill. 2024	Evgo Inc, swap sur rendement total	(3 735)	(573)
(2 100)	31 juill. 2024	Ez Tec Empreendimentos E Par, swap sur rendement total	(6 685)	423
(87)	31 juill. 2024	Fastly Inc, cat. A, swap sur rendement total	(877)	59
(1 332)	31 juill. 2024	Fate Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(5 978)	750
(6)	31 juill. 2024	Fawaz Abdulaziz Alhokair & C, swap sur rendement total	(18)	1
(1 000)	31 juill. 2024	Fdc International Hotels Cor, swap sur rendement total	(2 894)	103
(24)	31 juill. 2024	First Interstate Bancsys, A, swap sur rendement total	(912)	(44)
(8)	31 juill. 2024	Five Below, swap sur rendement total	(1 193)	109
(17 300)	31 juill. 2024	Fleury Sa, swap sur rendement total	(63 636)	20
(663)	31 juill. 2024	Fluence Energy Inc, swap sur rendement total	(15 731)	6 305
(1 000)	31 juill. 2024	Formosa Petrochemical Corp, swap sur rendement total	(2 733)	113
(24 000)	31 juill. 2024	Formosa Plastics Corp, swap sur rendement total	(58 212)	7 796
(892)	31 juill. 2024	Fulcrum Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(7 568)	2 050
(20)	31 juill. 2024	Galapagos Nv, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(678)	78
(395)	31 juill. 2024	Gamestop Corp, cat. A, swap sur rendement total	(13 345)	(790)
(221)	31 juill. 2024	Gap Inc/The, swap sur rendement total	(7 224)	1 564
(18 800)	31 juill. 2024	Genting Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(13 906)	632
(2 893)	31 juill. 2024	Geron Corp, swap sur rendement total	(16 785)	(1 708)
(3 006)	31 juill. 2024	Gevo Inc, swap sur rendement total	(2 292)	522
(2 000)	31 juill. 2024	Globalwafers Co Ltd, swap sur rendement total	(45 472)	(804)
(300)	31 juill. 2024	Gmexico Transportes Sab, swap sur rendement total	(822)	99
(12)	31 juill. 2024	Goosehead Insurance Inc, A, swap sur rendement total	(943)	100
(38)	31 juill. 2024	Grand Korea Leisure Co Ltd, swap sur rendement total	(481)	27
(149)	31 juill. 2024	Grifols Sa, CAAÉ, swap sur rendement total	(1 285)	181
(105)	31 juill. 2024	Gruma S.A.B., B, swap sur rendement total	(2 620)	129
(6 200)	31 juill. 2024	Grupo Bimbo Sab, série A, swap sur rendement total	(29 944)	2 126
(17 100)	31 juill. 2024	Grupo Televisa Sab, série Cpo, swap sur rendement total	(12 783)	2 612
(4 766)	31 juill. 2024	Grupo Televisa Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(18 065)	3 782
(195)	31 juill. 2024	Guardant Health Inc, swap sur rendement total	(7 706)	(398)
(37)	31 juill. 2024	Haleon Plc, CAAÉ, swap sur rendement total	(418)	8
(47 400)	31 juill. 2024	Hapvida Participacoes E Inve, swap sur rendement total	(44 430)	5 086
(471)	31 juill. 2024	Harmonic Inc, swap sur rendement total	(7 586)	301
(124)	31 juill. 2024	Herc Holdings Inc, swap sur rendement total	(22 616)	1 735
(1 000)	31 juill. 2024	Hiwin Technologies Corp, swap sur rendement total	(8 985)	419
(4 000)	31 juill. 2024	Hotai Motor Company Ltd, swap sur rendement total	(108 324)	(3 726)
(191)	31 juill. 2024	Hsbc Holdings Plc, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(11 369)	315
(28 000)	31 juill. 2024	Htc Corp, swap sur rendement total	(54 508)	(2 879)
(96)	31 juill. 2024	Hub Group Inc, cat. A, swap sur rendement total	(5 655)	35
(4)	31 juill. 2024	Hubspot Inc, swap sur rendement total	(3 228)	116
(10)	31 juill. 2024	Humana Inc, swap sur rendement total	(5 125)	(213)
(6)	31 juill. 2024	Humasis Co Ltd, swap sur rendement total	(10)	1
(1 711)	31 juill. 2024	Indie Semiconductor Inc, A, swap sur rendement total	(14 445)	1 059
(2 064)	31 juill. 2024	Infosys Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(53 535)	(4 760)
(1 118)	31 juill. 2024	Inmode Ltd, swap sur rendement total	(27 904)	824
(643)	31 juill. 2024	Innoviz Technologies Ltd, swap sur rendement total	(816)	111
(29)	31 juill. 2024	Inspired Entertainment Inc, swap sur rendement total	(363)	–
(352)	31 juill. 2024	Intellia Therapeutics Inc, swap sur rendement total	(10 780)	200
(16)	31 juill. 2024	Intellian Technologies Inc, swap sur rendement total	(937)	(3)
(9 500)	31 juill. 2024	Ioi Corp Bhd, swap sur rendement total	(10 196)	386
(3 320)	31 juill. 2024	Jastrzebska Spolka Weglowa S, swap sur rendement total	(33 407)	(456)
(8 500)	31 juill. 2024	Jaymart Pcl, swap sur rendement total	(4 117)	(152)
(2 845)	31 juill. 2024	Jetblue Airways Corp, swap sur rendement total	(23 708)	(1 520)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(626)	31 juill. 2024	Jinkosolar Holding Co, CAAÉ, swap sur rendement total	(17 748)	7 770
(611)	31 juill. 2024	Johnson Controls Internation, swap sur rendement total	(55 882)	4 128
(156)	31 juill. 2024	Joint Corp/The, swap sur rendement total	(3 001)	180
(36 500)	31 juill. 2024	Jwd Infologistics Pcl, swap sur rendement total	(16 999)	2 621
(468)	31 juill. 2024	Kangwon Land Inc, swap sur rendement total	(6 456)	467
(5 000)	31 juill. 2024	Kaori Heat Treatment Co Ltd, swap sur rendement total	(101 659)	4 101
(78)	31 juill. 2024	Kla Corp, swap sur rendement total	(88 001)	(5 313)
(353)	31 juill. 2024	Kopin Corp, swap sur rendement total	(406)	(17)
(615)	31 juill. 2024	Kornit Digital Ltd, swap sur rendement total	(12 320)	(270)
(576)	31 juill. 2024	Kt&G Corp, swap sur rendement total	(50 495)	(2 830)
(100)	31 juill. 2024	Kuala Lumpur Kepong Bhd, swap sur rendement total	(599)	23
(368)	31 juill. 2024	L&C Bio Co Ltd, swap sur rendement total	(8 998)	(2 104)
(2 000)	31 juill. 2024	Land Mark Optoelectronics, swap sur rendement total	(14 173)	(2 796)
(537)	31 juill. 2024	Legend Biotech Corp, CAAÉ, swap sur rendement total	(32 544)	(2 061)
(40)	31 juill. 2024	Lg Energy Solution, swap sur rendement total	(12 981)	143
(23 000)	31 juill. 2024	Lite-On Technology Corp, swap sur rendement total	(102 840)	1 669
(21)	31 juill. 2024	Lithia Motors Inc, cat. A, swap sur rendement total	(7 254)	48
(159)	31 juill. 2024	Live Nation Entertainment In, swap sur rendement total	(20 395)	(396)
(21)	31 juill. 2024	Lkq Corp, swap sur rendement total	(1 195)	(10)
(4 800)	31 juill. 2024	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(49 806)	3 403
(48)	31 juill. 2024	Localiza Rent A Car, swap sur rendement total	(106)	(106)
(700)	31 juill. 2024	Log Commercial Properties E, swap sur rendement total	(4 000)	(30)
(8 900)	31 juill. 2024	Lotte Chemical Titan Holding, swap sur rendement total	(3 150)	(348)
(3 000)	31 juill. 2024	Lotus Pharmaceutical Co Ltd, swap sur rendement total	(39 166)	(2 889)
(119)	31 juill. 2024	Lucid Group Inc, swap sur rendement total	(425)	37
(579)	31 juill. 2024	Luna Innovations Inc, swap sur rendement total	(2 535)	136
(67)	31 juill. 2024	Macerich Co/The, swap sur rendement total	(1 416)	(24)
(9 000)	31 juill. 2024	Macronix International, swap sur rendement total	(10 079)	257
(487)	31 juill. 2024	Maharah Human Resources Co, swap sur rendement total	(1 064)	(20)
(494)	31 juill. 2024	Marriott International, cat. A, swap sur rendement total	(163 428)	(5 613)
(48)	31 juill. 2024	Match Group Inc, swap sur rendement total	(1 995)	8
(5)	31 juill. 2024	Materion Corp, swap sur rendement total	(740)	41
(5)	31 juill. 2024	Matson Inc, swap sur rendement total	(896)	(15)
(39)	31 juill. 2024	Maxeon Solar Technologie, swap sur rendement total	(46)	44
(2 000)	31 juill. 2024	Merida Industry Co Ltd, swap sur rendement total	(18 265)	1 101
(314)	31 juill. 2024	Merus Nv, swap sur rendement total	(25 423)	(2 454)
(1)	31 juill. 2024	Methanol Chemicals Co, swap sur rendement total	(6)	–
(228)	31 juill. 2024	Mgm Resorts International, swap sur rendement total	(13 865)	(1 098)
(499)	31 juill. 2024	Middle East Healthcare Co, swap sur rendement total	(15 725)	(521)
(1 120)	31 juill. 2024	Mitsubishi Ufj Finl, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(16 746)	(682)
(44)	31 juill. 2024	Mks Instruments Inc, swap sur rendement total	(7 862)	(45)
(206)	31 juill. 2024	Mohawk Industries Inc, swap sur rendement total	(32 019)	2 014
(38)	31 juill. 2024	Mongodb Inc, swap sur rendement total	(12 997)	(320)
(9)	31 juill. 2024	Monolithic Power Systems Inc, swap sur rendement total	(10 135)	(1 032)
(1 564)	31 juill. 2024	Monster Beverage Corp, swap sur rendement total	(106 898)	(4)
(12 000)	31 juill. 2024	Mpm Corporeos Sa, swap sur rendement total	(2 996)	649
(39 000)	31 juill. 2024	Nan Ya Plastics Corp, swap sur rendement total	(81 104)	6 598
(21)	31 juill. 2024	National Vision Holdings Inc, swap sur rendement total	(376)	58
(3)	31 juill. 2024	Nayifat Finance Co, swap sur rendement total	(13)	1
(2 000)	31 juill. 2024	Neo Solar Power Corp, swap sur rendement total	(1 152)	(124)
(614)	31 juill. 2024	Neogen Corp, swap sur rendement total	(13 132)	(1 404)
(216)	31 juill. 2024	New Fortress Energy Inc, swap sur rendement total	(6 496)	477
(2 820)	31 juill. 2024	Nextdecade Corp, swap sur rendement total	(30 638)	(2 186)
(22)	31 juill. 2024	Nextera Energy Inc, swap sur rendement total	(2 132)	241
(187)	31 juill. 2024	Nice Ltd, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(44 004)	3 200
(95)	31 juill. 2024	Nikola Corp, swap sur rendement total	(1 065)	939
(537)	31 juill. 2024	Nuscale Power Corp, swap sur rendement total	(8 590)	(2 085)
(118)	31 juill. 2024	Occidental Petroleum Corp, swap sur rendement total	(10 213)	(46)
(1 051)	31 juill. 2024	Ocular Therapeutix Inc, swap sur rendement total	(9 837)	(1 606)
(22)	31 juill. 2024	On Semiconductor, swap sur rendement total	(2 064)	(18)
(5 000)	31 juill. 2024	Oneness Biotech Co Ltd, swap sur rendement total	(34 589)	(2 754)
(147)	31 juill. 2024	Oneok Inc, swap sur rendement total	(16 404)	(149)
(9 000)	31 juill. 2024	Optotech Corp, swap sur rendement total	(15 888)	(117)
(3 100)	31 juill. 2024	Orbia Advance Corp Sab De Cv, swap sur rendement total	(5 916)	1 027
(21)	31 juill. 2024	Oscar Health Inc, cat. A, swap sur rendement total	(455)	119
(321)	31 juill. 2024	Palantir Technologies Inc, A, swap sur rendement total	(11 126)	(1 062)
(20)	31 juill. 2024	Paycom Software Inc, swap sur rendement total	(3 915)	53
(944)	31 juill. 2024	Peloton Interactive Inc, A, swap sur rendement total	(4 366)	400
(120 600)	31 juill. 2024	Petronas Chemicals Group Bhd, swap sur rendement total	(220 735)	14 481

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(1 900)	31 juill. 2024	Petroreconcavo Sa, swap sur rendement total	(8 621)	1 700
(1 000)	31 juill. 2024	Phoenix Silicon Intl Corp, swap sur rendement total	(3 750)	(246)
(451)	31 juill. 2024	Physicians Realty Trust, swap sur rendement total	(12 096)	157
(3 686)	31 juill. 2024	Pko Bank Polski Sa, swap sur rendement total	(78 841)	(2 501)
(6 350)	31 juill. 2024	Plug Power Inc, swap sur rendement total	(20 245)	5 936
(13 911)	31 juill. 2024	Polski Koncern Naftowy Orlen, swap sur rendement total	(320 105)	(12 270)
(212)	31 juill. 2024	Posco Chemtech Co Ltd, swap sur rendement total	(54 470)	(1 836)
(293)	31 juill. 2024	Prudential Plc, CAAÉ, swap sur rendement total	(7 345)	381
(552)	31 juill. 2024	Public Service Enterprise Gp, swap sur rendement total	(55 668)	1 815
(181)	31 juill. 2024	Pubmatic Inc, cat. A, swap sur rendement total	(5 030)	415
(908)	31 juill. 2024	Purecycle Technologies Inc, swap sur rendement total	(7 355)	(129)
(2)	31 juill. 2024	Qassim Cement/The, swap sur rendement total	(41)	1
(195)	31 juill. 2024	Qualcomm Inc, swap sur rendement total	(53 147)	1 882
(24 000)	31 juill. 2024	Quanta Computer Inc, swap sur rendement total	(315 861)	(36 889)
(241)	31 juill. 2024	Red Rock Resorts Inc, cat. A, swap sur rendement total	(18 114)	(1 157)
(24)	31 juill. 2024	Rev Group Inc, swap sur rendement total	(819)	71
(427)	31 juill. 2024	Rivian Automotive Inc, A, swap sur rendement total	(7 841)	(1 419)
(2)	31 juill. 2024	Sadr Logistics Co, swap sur rendement total	(2)	–
(132)	31 juill. 2024	Sahara International Petroch, swap sur rendement total	(1 406)	55
(9)	31 juill. 2024	Samsara Inc, cat. A, swap sur rendement total	(415)	(4)
(785)	31 juill. 2024	Sanofi, CAAÉ, swap sur rendement total	(52 118)	642
(5)	31 juill. 2024	Saudi Airlines Catering Co, swap sur rendement total	(228)	(25)
(7 375)	31 juill. 2024	Saudi Arabian Mining Co, swap sur rendement total	(115 799)	8 972
(585)	31 juill. 2024	Saudi Research And Marketing, swap sur rendement total	(44 167)	(416)
(322)	31 juill. 2024	Saudi Vitrified Clay Pipe Co, swap sur rendement total	(5 056)	(68)
(415)	31 juill. 2024	Schrodinger Inc, swap sur rendement total	(10 983)	1 100
(284)	31 juill. 2024	Sempra Energy, swap sur rendement total	(29 799)	114
(560)	31 juill. 2024	Senseonics Holdings Inc, swap sur rendement total	(306)	25
(2 002)	31 juill. 2024	Shell Plc, CAAÉ, swap sur rendement total	(197 733)	(974)
(5 163)	31 juill. 2024	Sibanye-Stillwater Ltd, CAAÉ, swap sur rendement total	(30 732)	3 806
(113)	31 juill. 2024	Simulations Plus Inc, swap sur rendement total	(7 518)	(61)
(8 000)	31 juill. 2024	Sino, American Silicon Produc, swap sur rendement total	(73 397)	(2 275)
(158)	31 juill. 2024	Sitime Corp, swap sur rendement total	(26 891)	(643)
(44)	31 juill. 2024	Skillz Inc, swap sur rendement total	(432)	(18)
(8)	31 juill. 2024	Skyline Champion Corp, swap sur rendement total	(742)	6
(74)	31 juill. 2024	Skyworks Solutions Inc, swap sur rendement total	(10 792)	(57)
(8)	31 juill. 2024	Sl Green Realty Corp, swap sur rendement total	(623)	(29)
(265)	31 juill. 2024	Smart Global Holdings Inc, swap sur rendement total	(8 293)	(645)
(3 636)	31 juill. 2024	Soundhound Ai Inc, A, swap sur rendement total	(19 653)	4 747
(72)	31 juill. 2024	Sprinklr Inc, A, swap sur rendement total	(948)	(70)
(479)	31 juill. 2024	Starbucks Corp, swap sur rendement total	(51 026)	1 261
(1 060)	31 juill. 2024	Stem Inc, swap sur rendement total	(1 610)	250
(949)	31 juill. 2024	Surgery Partners Inc, swap sur rendement total	(30 893)	3 070
(808)	31 juill. 2024	Suzano Sa, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(11 355)	(1 055)
(47)	31 juill. 2024	Symbotic Inc, swap sur rendement total	(2 261)	194
(17)	31 juill. 2024	Synopsys Inc, swap sur rendement total	(13 842)	(592)
(6 000)	31 juill. 2024	Taishin Financial Holding, swap sur rendement total	(4 771)	(104)
(111 000)	31 juill. 2024	Taiwan Cement, swap sur rendement total	(160 132)	(5 078)
(4 000)	31 juill. 2024	Taiwan Cogeneration Corp, swap sur rendement total	(8 082)	(165)
(785)	31 juill. 2024	Takween Advanced Industries, swap sur rendement total	(3 441)	160
(1 565)	31 juill. 2024	Talos Energy Inc, swap sur rendement total	(26 019)	(1 051)
(43)	31 juill. 2024	Tapestry Inc, swap sur rendement total	(2 518)	(24)
(9)	31 juill. 2024	Td Synnex Corp, swap sur rendement total	(1 421)	170
(800)	31 juill. 2024	Telekom Malaysia Bhd, swap sur rendement total	(1 569)	(8)
(142)	31 juill. 2024	Terex Corp, swap sur rendement total	(10 656)	1 068
(141)	31 juill. 2024	Tesla Inc, swap sur rendement total	(38 178)	(2 287)
(1 005)	31 juill. 2024	Teva Pharmaceutical, CAAÉ parrainé, swap sur rendement total	(22 347)	1 089
(4)	31 juill. 2024	Theeb Rent A Car Co, swap sur rendement total	(99)	(6)
(146)	31 juill. 2024	Thor Industries Inc, swap sur rendement total	(18 669)	(465)
(48)	31 juill. 2024	Trinet Group Inc, swap sur rendement total	(6 568)	286
(1 000)	31 juill. 2024	Tsec Corp, swap sur rendement total	(1 221)	(53)
(15)	31 juill. 2024	Umm Al-Qura Cement Co, swap sur rendement total	(92)	(2)
(72)	31 juill. 2024	Unifin Financiera Sab De Cv, swap sur rendement total	(6)	1
(35 000)	31 juill. 2024	Unimicron Technology Corp, swap sur rendement total	(265 748)	4 335
(78)	31 juill. 2024	United International Transpo, swap sur rendement total	(2 503)	(311)
(34)	31 juill. 2024	Universal Health Services, B, swap sur rendement total	(8 604)	230
(42)	31 juill. 2024	Utz Brands Inc, swap sur rendement total	(961)	108
(23 400)	31 juill. 2024	Uwc Bhd, swap sur rendement total	(20 227)	1 614
(343)	31 juill. 2024	Valvoline Inc, swap sur rendement total	(20 276)	(1 084)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

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

Au 30 juin 2024

Nombre de contrats	Date d'échéance	Nom du titre	Valeur de marché $	Plus-value (moins-value) latente $
(32 700)	31 juill. 2024	Vamos Locacao De Caminhoes M, swap sur rendement total	(60 582)	8 833
(33)	31 juill. 2024	Viatris Inc, swap sur rendement total	(480)	–
(3 000)	31 juill. 2024	Waffer Technology Corp, swap sur rendement total	(11 680)	(866)
(46 000)	31 juill. 2024	Walsin Lihwa Corp, swap sur rendement total	(71 018)	855
(726)	31 juill. 2024	Warner Bros Discovery Inc, swap sur rendement total	(7 391)	(144)
(14)	31 juill. 2024	Willis Towers Watson Plc, swap sur rendement total	(5 039)	(78)
(62)	31 juill. 2024	Winnebago Industries, swap sur rendement total	(4 598)	(79)
(25 000)	31 juill. 2024	Yulon Motor Company, swap sur rendement total	(70 444)	4 067
				(7 767)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps d'actions, montant net – position vendeur		186 793
		Total de la plus-value latente des swaps sur rendement total		1 515 071
		Total de la moins-value latente des swaps sur rendement total		(1 602 435)
		Plus-value (moins-value) latente des swaps sur rendement total, montant net		**(87 364)**

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2024 et 2023 (non audité)

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

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

Le Fonds d'actions mondiales longues/courtes CC&L (auparavant, Fonds alternatif d'actions canadiennes CC&L) (le « Fonds ») est une fiducie de fonds commun de placement à capital variable établie en vertu des lois de l'Ontario et est régi par une déclaration de fiducie datée du 1er 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 30 juin 2024

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position acheteur	2 529 392 $	– $	– $	2 529 392 $
Actions américaines – position acheteur	1 547 483	357	–	1 547 840
Actions étrangères – position acheteur	18 700 798	463	–	18 701 261
Contrats de change à terme	–	268 224	–	268 224
Contrats de swap	–	1 515 071	–	1 515 071
	22 777 673 $	1 784 115 $	– $	24 561 788 $

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	1 016 911 $	1 645 $	– $	1 018 556 $
Actions américaines – position vendeur	12 737 267	–	–	12 737 267
Actions étrangères – position vendeur	14 277 412	1 655	–	14 279 067
Contrats de change à terme	–	14 213	–	14 213
Contrats de swap	–	1 602 435	–	1 602 435
	28 031 590 $	1 619 948 $	– $	29 651 538 $

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 $

Il n'y a eu aucun transfert important d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

2024	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
Série A	**44 592**	**12 152**	**–**	**–**	**56 744**
Série F	**159 079**	**1 465 922**	**–**	**(60 780)**	**1 564 221**
Série I	**1 017 111**	**1 822**	**–**	**(641)**	**1 018 292**
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

Imposition du Fonds (note 7)

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

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2023).

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

Frais de gestion

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

Rémunération au rendement

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

Parts détenues par des parties liées

Connor, Clark & Lunn Financial Group Investments Inc. (« CCLFGII ») et Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), sociétés liées au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détiennent des parts du Fonds. Au 30 juin 2024, CCLFGII détenait 975 715 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 12 377 729 $ (975 715 parts de série I, dont la juste valeur totale était de 10 773 063 $ au 31 décembre 2023). Au 30 juin 2024, 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 81 725 $, de 85 749 $ et de 93 625 $ (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 $ au 31 décembre 2023).

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

Le Fonds a payé 55 616 $ (19 681 $ en 2023) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Les paiements indirects effectués pour la période se sont élevés à 9 481 $ (4 039 $ en 2023).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 significative.

Au 30 juin 2024

Devise	Actifs (passifs) monétaires ($)	Contrats dérivés de change ($)	Exposition nette ($)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net ($)
Dollar australien	(14 576)	(605 884)	(620 460)	(1,9)	(31 023)
Réal brésilien	(1 170)	–	(1 170)	–	(59)
Livre sterling	38 075	612 325	650 400	2,0	32 520
Peso chilien	(44)	–	(44)	–	(2)
Renminbi chinois	229	–	229	–	11
Couronne danoise	221 631	–	221 631	0,7	11 082
Euro	(275 406)	(376 898)	(652 304)	(2,0)	(32 615)
Dollar de Hong Kong	1 965	–	1 965	–	98
Forint hongrois	12 404	–	12 404	–	620
Roupie indonésienne	448	–	448	–	22
Nouveau shekel israélien	77 186	(643 276)	(566 090)	(1,7)	(28 305)
Yen japonais	51 126	(2 827 515)	(2 776 389)	(8,5)	(138 819)
Ringgit malaisien	284	–	284	–	14
Peso mexicain	5 845	204 143	209 988	0,6	10 499
Dollar néo-zélandais	(1 163)	(156 755)	(157 918)	(0,5)	(7 896)
Couronne norvégienne	126 194	(944 447)	(818 253)	(2,5)	(40 913)
Peso philippin	127	–	127	–	6
Zloty polonais	791	–	791	–	40
Dollar de Singapour	12 717	(1 067 217)	(1 054 500)	(3,2)	(52 725)
Rand sud-africain	31 491	–	31 491	0,1	1 575
Won sud-coréen	(1 417)	(611 104)	(612 521)	(1,9)	(30 626)
Couronne suédoise	54 683	–	54 683	0,2	2 734
Franc suisse	44 181	–	44 181	0,1	2 209
Baht thaïlandais	(2 871)	–	(2 871)	–	(144)
Lire turque	1 371	–	1 371	–	69
Dollar américain	36 655 759	(23 501 353)	13 154 406	40,3	657 720
Total	37 039 860	(29 917 981)	7 121 879	21,8	356 092

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

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le risque de taux d'intérêt était négligeable, l'exposition du Fonds aux placements portant intérêt à long terme n'étant pas importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 526 000$ (219 000 $ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être significative.

Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 5,5 % (9,6 % au 31 décembre 2023) 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 périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2024 ($)	**2023 ($)**
Revenus bruts tirés du prêt de titres	472	2 305
Charges liées au prêt de titres	(94)	(459)
Revenus nets tirés du prêt de titres	378	1 846
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	(7)	(45)
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	371	1 801

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 19,9 % (19,9 % en 2023) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

	2024 (en milliers de $)	**2023 (en milliers de $)**
Titres prêtés	84	125
Garanties reçues	88	131
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier et emprunt (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 62,3 % à 128,2 % (de 63,2 % à 141,5 % en 2023) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2024, l'exposition totale du Fonds correspondait à 120,4 % (123,8 % au 31 décembre 2023) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions, de positions vendeur sur contrats de swap d'actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 1 559 167 $ (de néant à 6 661 984 $ en 2023) avec un taux d'intérêt moyen de 5,80 % (5,43 % en 2023). Au 30 juin 2024, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,0 % (0,0 % au 31 décembre 2023) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	30 juin 2024 (non audité)	31 décembre 2023 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	**41 655 $**	36 586 $
Placements à court terme	**6 379 907**	1 395 867
Placements	**47 495 621**	50 537 522
Plus-value latente des contrats de change à terme	**21 005**	111 191
Plus-value latente des contrats à terme normalisés	**208 308**	487 170
Plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit	**7 455**	544
Marge de variation quotidienne	**1 225 901**	1 362 651
Intérêts à recevoir	**556 141**	442 801
Autres créances	**184**	50
Souscriptions à recevoir	**130 381**	231 912
	56 066 558	54 606 294
Passif		
Passif courant		
Placements vendus à découvert	**26 721 591**	25 888 103
Moins-value latente des contrats de change à terme	**51 969**	244 182
Moins-value latente des contrats à terme sur obligations	**65 531**	92 887
Moins-value latente des contrats à terme normalisés	**284 978**	903 028
Intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	**391 734**	333 237
Montant à payer au courtier	**250 000**	–
Frais d'emprunt de titres à payer	**9 124**	6 903
Charges à payer	**57 549**	49 934
Frais de gestion à payer	**529**	574
	27 833 005	27 518 848
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	**28 233 553 $**	27 087 446 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États de la situation financière aux

	2024	2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**268 467 $**	266 718 $
Série F	**636 634 $**	925 166 $
Série I	**27 328 452 $**	25 895 562 $
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	**33 685**	33 497
Série F	**76 035**	111 213
Série I	**3 096 973**	2 961 119
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**7,97 $**	7,96 $
Série F	**8,37 $**	8,32 $
Série I	**8,82 $**	8,75 $

Approuvé par le gestionnaire

« Michael Freund »

Administrateur

« Tim Elliott »

Administrateur

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	**16 948 $**	(1 768) $
Variation du gain (perte) de change latent	**(18 995)**	440
Revenus tirés du prêt de titres (note 12)	**1 763**	484
Gain (perte) net sur placements		
Intérêts aux fins des distributions	**1 237 483**	1 025 997
Charges d'intérêts sur les titres vendus à découvert	**(686 298)**	(496 106)
Gain (perte) net réalisé sur les placements	**1 063 620**	(529 248)
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	**(347 941)**	(115 587)
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de change à terme	**100 108**	311 021
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme sur obligations	**123 187**	–
Gain (perte) net réalisé sur les contrats à terme normalisés	**(111 581)**	223 914
Gain (perte) net réalisé sur les contrats de swap	**(11 136)**	(20 307)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	**(1 279 087)**	332 549
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	**259 753**	(71 497)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change à terme	**102 027**	(52 833)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme sur obligations	**27 356**	–
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats à terme normalisés	**339 188**	23 314
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de swap	**6 911**	13 888
Gain (perte) net total sur placements	**823 590**	645 105
Total des revenus (pertes) nets	**823 306**	644 261
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	**15 753**	8 006
Honoraires des dépositaires	**31 187**	27 754
Frais de dépôt	**20 709**	12 276
Honoraires du comité d'examen indépendant	**1 975**	2 232
Charges d'intérêts	**5 520**	173
Frais de gestion	**4 153**	5 042
Honoraires de professionnels	**17 423**	–
Coût d'emprunt de titres	**52 799**	32 651
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	**5 286**	7 002
Coûts de transaction (note 9)	**13 817**	6 260
Total des charges d'exploitation	**168 622**	101 396
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**654 684 $**	542 865 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

États du résultat global (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**4 276 $**	189 $
Série F	**17 272 $**	31 749 $
Série I	**633 136 $**	510 927 $
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	**33 575**	17 675
Série F	**90 311**	191 203
Série I	**3 000 336**	2 992 346
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**0,13 $**	0,01 $
Série F	**0,19 $**	0,17 $
Série I	**0,21 $**	0,17 $

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 (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2024	Série A 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**266 718 $**	105 001 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**4 276**	189
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**–**	114 375
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	**1 503**	1 213
Rachat de parts rachetables	**–**	(10 449)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**1 503**	105 139
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	**(4 030)**	(2 313)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	**(4 030)**	(2 313)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**1 749**	103 015
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**268 467 $**	208 016 $

	Série F 2024	Série F 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**925 166 $**	1 630 088 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**17 272**	31 749
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**–**	23 515
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	**9 523**	13 363
Rachat de parts rachetables	**(304 264)**	(502 812)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**(294 741)**	(465 934)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	**(11 063)**	(23 600)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	**(11 063)**	(23 600)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**(288 532)**	(457 785)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**636 634 $**	1 172 303 $

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 (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2024	Série I 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**25 895 562 $**	25 295 220 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**633 136**	510 927
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**834 272**	251 210
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	**396 972**	388 891
Rachat de parts rachetables	**(34 518)**	(30 676)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**1 196 726**	609 425
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	**(396 972)**	(388 891)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	**(396 972)**	(388 891)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**1 432 890**	731 461
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**27 328 452 $**	26 026 681 $

	Total 2024	Total 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**27 087 446 $**	27 030 309 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**654 684**	542 865
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**834 272**	389 100
Réinvestissements de distributions aux porteurs de parts rachetables	**407 998**	403 467
Rachat de parts rachetables	**(338 782)**	(543 937)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**903 488**	248 630
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenus de placement nets	**(412 065)**	(414 804)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	**(412 065)**	(414 804)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**1 146 107**	376 691
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**28 233 553 $**	27 407 000 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**654 684 $**	542 865 $
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	**18 995**	(440)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	**(1 063 620)**	529 248
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	**347 941**	115 587
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	**1 279 087**	(332 549)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	**(259 753)**	71 497
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de change à terme	**(102 027)**	52 833
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme sur obligations	**(27 356)**	–
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats à terme normalisés	**(339 188)**	(23 314)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des contrats de swap	**(6 911)**	(13 888)
Achat de placements	**(263 158 740)**	(185 949 248)
Produit des placements vendus	**261 996 434**	185 598 762
(Augmentation) diminution de la marge de variation quotidienne	**136 750**	149 375
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	**(113 340)**	72 474
(Augmentation) diminution des autres créances	**(134)**	(16 805)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	**2 221**	(9 001)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les titres vendus à découvert	**58 497**	(16 660)
Augmentation (diminution) des charges à payer	**7 615**	(41 896)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	**(45)**	(43)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	**(568 890)**	728 797
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables	**935 803**	347 306
Rachat de parts rachetables	**(338 782)**	(543 937)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des réinvestissements	**(4 067)**	(11 337)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	**592 954**	(207 968)
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	**24 064**	520 829
Variation du gain (perte) de change latent	**(18 995)**	440
Trésorerie, à l'ouverture de la période	**36 586**	39 867
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	**–**	(526 167)
	41 655	34 969
Trésorerie, à la clôture de la période	**41 655 $**	343 238 $
Dette bancaire, à la clôture de la période	**– $**	(308 269) $
	41 655 $	34 969 $
Intérêts reçus*	**1 124 143 $**	1 098 471 $
Intérêts payés*	**(633 321)**	(512 939)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	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 2023 : 5,15 %)							
Bons du Trésor du Canada	4,943	18 juill. 2024	CAD	575 000	572 942	573 531	
Bons du Trésor du Canada	4,806	1er août 2024	CAD	210 000	208 517	209 089	
Bons du Trésor du Canada	4,738	15 août 2024	CAD	55 000	54 356	54 666	
Bons du Trésor du Canada*	4,738	15 août 2024	CAD	750 000	743 363	745 443	
Bons du Trésor du Canada	4,691	29 août 2024	CAD	2 160 000	2 136 142	2 143 092	
Bons du Trésor du Canada	4,691	29 août 2024	CAD	815 000	806 119	808 620	
Bons du Trésor du Canada	4,670	12 sept. 2024	CAD	150 000	148 271	148 564	
Bons du Trésor du Canada	4,670	12 sept. 2024	CAD	750 000	741 001	742 818	
Bons du Trésor du Canada	4,646	26 sept. 2024	CAD	950 000	939 117	939 254	
Bons du Trésor du Canada	4,646	26 sept. 2024	CAD	15 000	14 818	14 830	
					6 364 646	6 379 907	22,60
Total des placements à court terme – position acheteur					6 364 646	6 379 907	22,60
Obligations – position acheteur							
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2023 : 82,37 %)							
Fiducie du Canada pour l'habitation n°1	4,250	15 mars 2034	CAD	501 000	511 416	514 618	
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1er mars 2027	CAD	688 000	645 619	645 633	
Obligations du gouvernement du Canada	3,000	1er juin 2034	CAD	9 000	8 714	8 625	
Obligations du gouvernement du Canada	1,750	1er déc. 2053	CAD	135 000	94 770	93 690	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1er déc. 2055	CAD	1 439 000	1 276 426	1 260 986	
Obligations du gouvernement du Canada	2,750	1er déc. 2064	CAD	115 000	130 694	100 716	
					2 667 639	2 624 268	9,29
Obligations provinciales et municipales canadiennes (31 décembre 2023 : 7,30 %)							
Province d'Ontario	3,650	2 juin 2033	CAD	3 521 000	3 372 808	3 392 434	
Province de Québec	4,400	1er déc. 2055	CAD	1 759 000	1 757 365	1 777 090	
					5 130 173	5 169 524	18,31
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2023 : 27,61 %)							
407 International Inc.	5,750	14 fév. 2036	CAD	6 000	6 402	6 348	
Algonquin Power & Utilities Corp.	5,250	18 janv. 2082	CAD	387 000	334 676	350 479	
Algonquin Power Co.	4,090	17 fév. 2027	CAD	526 000	512 489	514 866	
Algonquin Power Co.	4,600	29 janv. 2029	CAD	356 000	349 600	351 047	
Algonquin Power Co.	2,850	15 juill. 2031	CAD	152 000	131 987	132 890	
Alimentation Couche-Tard Inc.	4,603	25 janv. 2029	CAD	29 000	29 197	29 030	
ARC Resources Ltd.	2,354	10 mars 2026	CAD	175 000	163 542	168 223	
ARC Resources Ltd.	3,465	10 mars 2031	CAD	138 000	127 607	126 521	
AtkinsRéalis Group Inc.	5,700	26 mars 2029	CAD	943 000	943 000	955 055	
Banque de Montréal	3,650	1er avril 2027	CAD	480 000	457 885	469 157	
Banque de Montréal	4,976	3 juill. 2034	CAD	250 000	250 000	249 250	
La Banque de Nouvelle-Écosse	3,934	3 mai 2032	CAD	786 000	754 389	766 111	
Brookfield Infrastructure Finance ULC	5,616	14 nov. 2027	CAD	37 000	37 929	38 064	
Brookfield Infrastructure Finance ULC	3,410	9 oct. 2029	CAD	216 000	201 141	202 355	
Brookfield Infrastructure Finance ULC	5,710	27 juill. 2030	CAD	155 000	162 390	161 084	
Brookfield Renewable Partners ULC	4,250	15 janv. 2029	CAD	39 000	38 432	38 364	
Brookfield Renewable Partners ULC	3,330	13 août 2050	CAD	128 000	92 317	90 924	
Bruce Power LP	4,700	21 déc. 2027	CAD	92 000	91 673	92 499	
CAE inc.	5,541	12 juin 2028	CAD	26 000	26 227	26 447	
Corporation Cameco	4,940	24 mai 2031	CAD	127 000	126 840	127 815	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	5,050	7 octobre 2027	CAD	34 000	34 374	34 477	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	4,200	7 avril 2032	CAD	2 000 000	1 939 220	1 963 548	
Banque Canadienne Impériale de Commerce	5,300	16 janv. 2034	CAD	81 000	81 669	81 955	
Capital Power Corp.	4,986	23 janv. 2026	CAD	155 000	151 767	154 785	
Capital Power Corp.	5,378	25 janv. 2027	CAD	216 000	217 013	218 495	
Capital Power Corp.	3,147	1er oct. 2032	CAD	150 000	126 945	128 116	
Capital Power Corp.	8,125	5 juin 2054	CAD	216 000	216 000	220 405	
CES Energy Solutions Corp.	6,875	24 mai 2029	CAD	96 000	96 000	96 840	
Fiducie de placement immobilier	5,030	28 fév. 2031	CAD	79 000	78 997	79 402	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance		Valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Cineplex Inc.	7,625	31 mars 2029	CAD	572 000	572 000	583 440	
Coastal Gaslink Pipeline LP	4,673	30 juin 2027	CAD	92 000	91 997	92 690	
Coastal Gaslink Pipeline LP	4,691	30 sept. 2029	CAD	52 000	51 998	52 485	
Coastal Gaslink Pipeline LP	4,907	30 juin 2031	CAD	89 000	88 997	90 189	
Coastal Gaslink Pipeline LP	5,606	30 mars 2047	CAD	5 000	5 000	5 258	
Cogeco Communications inc.	6,125	27 fév. 2029	CAD	605 000	605 000	612 310	
Fiducie de placement immobilier industriel Dream	2,057	17 juin 2027	CAD	73 000	63 366	67 279	
Société en commandite Sommet Industriel Dream	2,250	12 janv. 2027	CAD	23 000	20 451	21 543	
Société en commandite Sommet Industriel Dream	2,440	14 juill. 2028	CAD	66 000	59 040	60 055	
Emera Inc.	6,750	15 juin 2076	USD	293 000	382 124	399 399	
Enbridge Inc.	5,375	27 sept. 2077	CAD	108 000	101 248	105 187	
Enbridge Inc.	5,000	19 janv. 2082	CAD	45 000	38 728	40 378	
First Capital Realty Inc.	5,572	1er mars 2031	CAD	190 000	190 000	192 836	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	3,604	6 mai 2026	CAD	8 000	7 810	7 796	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	3,456	22 janv. 2027	CAD	108 000	102 614	104 027	
Le Fonds de placement immobilier First Capital	5,455	12 juin 2032	CAD	75 000	75 000	74 960	
Compagnie Crédit Ford du Canada	5,242	23 mai 2028	CAD	144 000	144 000	144 751	
Compagnie Crédit Ford du Canada	5,441	9 fév. 2029	CAD	232 000	231 590	234 654	
Compagnie Crédit Ford du Canada	5,668	20 fév. 2030	CAD	130 000	131 468	132 611	
Financière General Motors du Canada Ltée	5,100	14 juill. 2028	CAD	189 000	188 620	190 782	
Fonds de placement immobilier H&R	2,906	2 juin 2026	CAD	43 000	40 826	41 208	
Fonds de placement immobilier H&R	5,457	28 fév. 2029	CAD	105 000	105 000	105 841	
Inter Pipeline Ltd.	4,232	1er juin 2027	CAD	346 000	328 723	338 434	
Inter Pipeline Ltd.	5,760	17 fév. 2028	CAD	137 000	140 666	139 949	
Inter Pipeline Ltd.	5,710	29 mai 2030	CAD	817 000	824 490	830 463	
Inter Pipeline Ltd.	3,983	25 nov. 2031	CAD	29 000	26 458	26 202	
Inter Pipeline Ltd.	6,590	9 fév. 2034	CAD	312 000	327 036	326 579	
Keyera Corp.	6,875	13 juin 2079	CAD	14 000	13 195	14 020	
Keyera Corp.	5,950	10 mars 2081	CAD	103 000	89 739	97 476	
Mattr Corp.	7,250	2 avril 2031	CAD	470 000	470 000	479 792	
Banque Nationale du Canada	5,219	14 juin 2028	CAD	143 000	142 672	146 276	
Banque Nationale du Canada	5,023	1er fév 2029	CAD	209 000	212 573	212 535	
Banque Nationale du Canada	5,426	16 août 2032	CAD	486 000	481 297	492 634	
Nova Scotia Power Inc.	4,951	15 nov. 2032	CAD	344 000	345 256	342 549	
Nova Scotia Power Inc.	6,950	25 août 2033	CAD	25 000	28 744	27 934	
Nova Scotia Power Inc.	4,150	6 mars 2042	CAD	18 000	14 331	15 581	
Nova Scotia Power Inc.	3,307	25 avril 2050	CAD	57 000	41 365	41 185	
Corporation Parkland	4,375	26 mars 2029	CAD	427 000	395 930	399 507	
Pembina Pipeline Corp.	4,800	25 janv. 2081	CAD	290 000	241 710	260 557	
Primaris REIT	5,934	29 mars 2028	CAD	14 000	13 774	14 318	
Fonds de placement immobilier RioCan	5,962	1er oct. 2029	CAD	210 000	209 929	217 059	
Fonds de placement immobilier RioCan	5,470	1er mars 2030	CAD	35 000	34 999	35 320	
Banque Royale du Canada	5,235	2 nov. 2026	CAD	160 000	160 021	162 309	
Banque Royale du Canada	5,096	3 avril 2034	CAD	744 000	739 786	748 288	
Secure Energy Services Inc.	6,750	22 mars 2029	CAD	628 000	628 000	635 458	
SmartCentres REIT	3,192	11 juin 2027	CAD	19 000	18 120	18 038	
SmartCentres REIT	5,354	29 mai 2028	CAD	65 000	65 759	65 395	
SmartCentres REIT	3,526	20 déc. 2029	CAD	33 000	30 590	30 306	
SmartCentres REIT	3,648	11 déc. 2030	CAD	122 000	109 298	110 519	
Financière Sun Life Inc.	2,580	10 mai 2032	CAD	89 000	83 219	84 047	
La Banque Toronto-Dominion	5,491	8 sept. 2028	CAD	61 000	62 543	63 116	
Tourmaline Oil Corp.	4,856	30 mai 2027	CAD	442 000	444 372	446 281	
TransCanada Trust	4,650	18 mai 2077	CAD	68 000	68 081	65 180	
Veren Inc.	4,968	21 juin 2029	CAD	355 000	355 020	353 431	
Vidéotron ltée	3,625	15 juin 2028	CAD	1 647 000	1 551 518	1 578 735	
Vidéotron ltée	4,650	15 juill. 2029	CAD	13 000	12 993	12 897	
Vidéotron ltée	4,500	15 janv. 2030	CAD	16 000	15 818	15 693	
					19 804 610	20 082 294	71,13

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance		Valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Obligations de sociétés américaines (31 décembre 2023 : 64,83 %)							
Albertsons Cos Inc.	3,500	15 mars 2029	USD	717 000	851 051	883 328	
Albertsons Cos Inc.	4,875	15 fév. 2030	USD	160 000	207 352	207 056	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	3,250	1er sept. 2028	USD	547 000	634 973	658 471	
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	4,000	1er sept. 2029	USD	55 000	58 924	63 772	
Arko Corp.	5,125	15 nov. 2029	USD	175 000	204 115	208 654	
Avis Budget Car Rental LLC	4,750	1er avril 2028	USD	70 000	86 013	87 987	
Avis Budget Car Rental LLC	8,000	15 fév. 2031	USD	530 000	703 963	718 923	
Cable One Inc.	4,000	15 nov. 2030	USD	861 000	937 735	880 286	
CCO Holdings LLC	4,750	1er mars 2030	USD	192 000	227 324	227 719	
CCO Holdings LLC	4,250	1er fév. 2031	USD	178 000	196 697	199 044	
Charter Communications Operating LLC	5,050	30 mars 2029	USD	9 000	11 368	11 848	
Cinemark USA Inc.	5,250	15 juill. 2028	USD	1 071 000	1 291 695	1 402 326	
CSC Holdings LLC	11,250	15 mai 2028	USD	2 000	2 470	2 387	
EUSHI Finance Inc.	7,625	15 déc. 2054	USD	234 000	322 323	322 225	
Ford Motor Co.	3,250	12 fév. 2032	USD	262 000	279 054	296 466	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,250	30 avril 2031	USD	101 000	120 127	126 935	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,250	15 juill. 2031	USD	67 000	79 645	83 551	
Goodyear Tire & Rubber Co.	5,625	30 avril 2033	USD	181 000	219 608	224 052	
Gray Escrow II Inc.	5,375	15 nov. 2031	USD	287 000	260 726	222 943	
Gray Television Inc.	10,500	15 juill. 2029	USD	246 000	336 959	338 754	
Gray Television Inc.	4,750	15 oct. 2030	USD	125 000	129 105	102 795	
Hertz Corp.	5,000	1er déc. 2029	USD	1 000	1 068	842	
iHeartCommunications Inc.	5,250	15 août 2027	USD	151 000	148 893	109 910	
Meritage Homes Corp.	3,875	15 avril 2029	USD	102 000	126 103	128 617	
Nexstar Media Inc.	5,625	15 juill. 2027	USD	634 000	821 673	824 820	
Nexstar Media Inc.	4,750	1er nov. 2028	USD	247 000	280 642	300 802	
NextEra Energy Capital Holdings Inc.	4,890	30 avril 2031	CAD	412 000	412 404	414 208	
Owens-Brockway Glass Container Inc.	7,250	15 mai 2031	USD	471 000	639 500	644 177	
Premier Entertainment Sub LLC	5,625	1er sept. 2029	USD	67 000	65 907	66 003	
Scripps Escrow Inc.	5,875	15 juill. 2027	USD	581 000	645 899	481 175	
Sinclair Television Group Inc.	5,500	1er mars 2030	USD	177 000	167 199	147 525	
Sinclair Television Group Inc.	4,125	1er déc. 2030	USD	181 000	173 195	166 171	
Station Casinos LLC	4,500	15 fév. 2028	USD	466 000	559 438	600 592	
TEGNA Inc.	4,625	15 mars 2028	USD	119 000	146 385	147 332	
TEGNA Inc.	5,000	15 sept. 2029	USD	293 000	352 077	354 425	
Tenet Healthcare Corp.	6,125	15 juin 2030	USD	153 000	195 890	208 205	
United Rentals North America Inc.	3,875	15 fév. 2031	USD	701 000	810 779	856 633	
Bons/obligations du Trésor des États-Unis	4,000	15 fév. 2034	USD	278 000	362 191	369 315	
Bons/obligations du Trésor des États-Unis	4,250	15 fév. 2054	USD	1 961 000	2 582 140	2 555 656	
Verizon Communications Inc.	2,550	21 mars 2031	USD	157 000	190 670	182 576	
VMware LLC	1,800	15 août 2028	USD	469 000	566 895	562 287	
					16 410 175	16 390 793	58,04
Obligations étrangères (31 décembre 2023 : 4,46 %)							
Électricité de France SA	5,379	17 mai 2034	CAD	178 000	178 973	178 435	
Électricité de France SA	5,777	17 mai 2054	CAD	123 000	123 726	125 033	
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.	5,750	20 janv. 2026	USD	893 000	1 125 533	1 163 885	
NCL Corp. Ltd.	7,750	15 fév. 2029	USD	759 000	1 061 943	1 080 507	
NCL Finance Ltd.	6,125	15 mars 2028	USD	213 000	283 594	288 052	
NXP BV / NXP Funding LLC	3,400	1er mai 2030	USD	126 000	149 567	156 269	
Trivium Packaging Finance BV	8,500	15 août 2027	USD	174 000	237 143	236 561	
					3 160 479	3 228 742	11,44
Total des obligations – position acheteur					47 173 076	47 495 621	168,21
Obligations – position vendeur							
Obligations fédérales canadiennes (31 décembre 2023 : -9,63 %)							
Obligations du gouvernement du Canada	1,000	1er juin 2027	CAD	(19 000)	(17 681)	(17 647)	
Obligations du gouvernement du Canada	3,250	1er sept. 2028	CAD	(505 000)	(501 884)	(499 377)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance		Valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Obligations du gouvernement du Canada	4,000	1er mars 2029	CAD	(331 000)	(339 446)	(337 871)	
Obligations du gouvernement du Canada	2,250	1er juin 2029	CAD	(89 000)	(84 777)	(84 394)	
Obligations du gouvernement du Canada	3,500	1er sept. 2029	CAD	(51 000)	(51 005)	(51 008)	
Obligations du gouvernement du Canada	1,250	1er juin 2030	CAD	(61 000)	(54 229)	(53 849)	
Obligations du gouvernement du Canada	0,500	1er déc. 2030	CAD	(209 000)	(174 515)	(173 695)	
					(1 223 537)	(1 217 841)	(4,31)
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2023 : -9,31 %)							
407 International Inc.	2,840	7 mars 2050	CAD	(91 000)	(65 183)	(64 151)	
Aéroports de Montréal	3,441	26 avril 2051	CAD	(49 000)	(39 111)	(39 178)	
Air Canada	3,875	15 août 2026	USD	(11 000)	(14 005)	(14 334)	
Allied Properties REIT	3,113	8 avril 2027	CAD	(3 000)	(2 730)	(2 754)	
AltaGas Ltd.	5,597	14 mars 2054	CAD	(175 000)	(172 330)	(172 226)	
Bell Canada	5,150	9 fév. 2053	CAD	(163 000)	(154 713)	(156 108)	
Autorité aéroportuaire de Calgary	3,554	7 oct. 2053	CAD	(548 000)	(448 239)	(441 580)	
CU Inc.	5,088	20 sept. 2053	CAD	(98 000)	(101 014)	(101 142)	
CU Inc.	4,211	29 oct. 2055	CAD	(127 000)	(113 891)	(113 568)	
Enbridge Gas Inc.	4,950	22 nov. 2050	CAD	(37 000)	(39 003)	(37 047)	
Enbridge Inc.	4,100	21 sept. 2051	CAD	(44 000)	(35 209)	(35 468)	
Enbridge Inc.	5,760	26 mai 2053	CAD	(187 000)	(191 937)	(194 500)	
EPCOR Utilities Inc.	4,725	2 sept. 2052	CAD	(436 000)	(425 791)	(427 804)	
FortisBC Energy Inc.	4,670	28 nov. 2052	CAD	(155 000)	(150 533)	(150 967)	
Great-West Lifeco Inc.	2,981	8 juill. 2050	CAD	(230 000)	(201 512)	(166 212)	
Hydro One Inc.	4,460	27 janv. 2053	CAD	(53 000)	(51 017)	(49 962)	
Intact Corporation financière	3,765	20 mai 2053	CAD	(432 000)	(330 821)	(360 375)	
Inter Pipeline Ltd.	5,091	27 nov. 2051	CAD	(379 000)	(305 974)	(326 238)	
Les Compagnies Loblaw ltée	5,336	13 sept. 2052	CAD	(350 000)	(366 536)	(359 542)	
Ontario Power Generation Inc.	3,651	13 sept. 2050	CAD	(462 000)	(470 598)	(369 180)	
Pembina Pipeline Corp.	5,670	12 janv. 2054	CAD	(220 000)	(220 620)	(221 987)	
Rogers Communications Inc.	5,250	15 avril 2052	CAD	(132 000)	(125 418)	(127 217)	
Financière Sun Life inc.	5,120	15 mai 2036	CAD	(13 000)	(12 969)	(13 123)	
Toronto Hydro Corp.	4,950	13 oct. 2052	CAD	(232 000)	(238 132)	(238 307)	
TransCanada PipeLines Ltd.	5,920	12 mai 2052	CAD	(148 000)	(145 834)	(158 390)	
Vidéotron ltée	3,125	15 janv. 2031	CAD	(174 000)	(157 120)	(156 233)	
					(4 580 240)	(4 497 593)	(15,93)
Obligations américaines (31 décembre 2023 : -76,63 %)							
Allegiant Travel Co.	7,250	15 août 2027	USD	(156 000)	(204 533)	(203 378)	
Allison Transmission Inc.	5,875	1er juin 2029	USD	(338 000)	(429 318)	(456 513)	
American Airlines Inc.	5,750	20 avril 2029	USD	(233 000)	(308 838)	(310 472)	
American Axle & Manufacturing Inc.	5,000	1er oct. 2029	USD	(171 000)	(213 951)	(214 808)	
Asbury Automotive Group Inc.	4,625	15 nov. 2029	USD	(706 000)	(819 854)	(893 998)	
Asbury Automotive Group Inc.	5,000	15 fév. 2032	USD	(124 000)	(150 919)	(153 833)	
AT&T Inc.	5,400	15 fév. 2034	USD	(450 000)	(614 059)	(616 038)	
AT&T Inc.	3,500	15 sept. 2053	USD	(338 000)	(318 198)	(314 208)	
Ball Corp.	6,875	15 mars 2028	USD	(26 000)	(36 500)	(36 551)	
Centene Corp.	2,500	1er mars 2031	USD	(5 000)	(5 134)	(5 620)	
Charter Communications Operating LLC	2,300	1er fév. 2032	USD	(30 000)	(29 852)	(31 676)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	5,125	15 août 2027	USD	(339 000)	(411 200)	(443 433)	
Clear Channel Outdoor Holdings Inc.	7,875	1er avril 2030	USD	(323 000)	(439 601)	(445 224)	
CNX Resources Corp.	7,375	15 janv. 2031	USD	(438 000)	(583 392)	(613 531)	
Conagra Brands Inc.	5,400	1er nov. 2048	USD	(22 000)	(32 573)	(27 752)	
Consolidated Communications Inc.	6,500	1er oct. 2028	USD	(121 000)	(142 843)	(141 911)	
DaVita Inc.	4,625	1er juin 2030	USD	(85 000)	(102 765)	(105 198)	
DaVita Inc.	3,750	15 fév. 2031	USD	(201 000)	(227 458)	(234 875)	
Encompass Health Corp.	4,750	1er fév. 2030	USD	(534 000)	(668 781)	(684 207)	
Frontier Communications Holdings LLC	5,875	15 oct. 2027	USD	(47 000)	(61 672)	(62 851)	
Frontier Communications Holdings LLC	5,000	1er mai 2028	USD	(600 000)	(760 865)	(774 308)	
General Motors Co.	5,400	1er avril 2048	USD	(237 000)	(278 928)	(290 404)	
Gray Television Inc.	7,000	15 mai 2027	USD	(33 000)	(40 678)	(41 616)	
Griffon Corp.	5,750	1er mars 2028	USD	(1 008 000)	(1 255 314)	(1 332 097)	
HCA Inc.	5,900	1er juin 2053	USD	(557 000)	(719 808)	(742 816)	

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance		Valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
HP Inc.	6,000	15 sept. 2041	USD	(116 000)	(155 189)	(162 316)	
KB Home	4,000	15 juin 2031	USD	(2 000)	(2 181)	(2 421)	
Lithia Motors Inc.	4,375	15 janv. 2031	USD	(417 000)	(501 590)	(508 624)	
M/I Homes Inc.	4,950	1er fév. 2028	USD	(14 000)	(17 927)	(18 491)	
M/I Homes Inc.	3,950	15 fév. 2030	USD	(134 000)	(158 417)	(163 663)	
Molina Healthcare Inc.	3,875	15 mai 2032	USD	(295 000)	(330 339)	(350 145)	
Outfront Media Capital LLC	4,250	15 janv. 2029	USD	(488 000)	(598 155)	(609 577)	
Outfront Media Capital LLC	4,625	15 mars 2030	USD	(183 000)	(219 901)	(225 850)	
Outfront Media Capital LLC	7,375	15 fév. 2031	USD	(527 000)	(735 959)	(751 357)	
Performance Food Group Inc.	4,250	1er août 2029	USD	(548 000)	(660 399)	(683 141)	
Sonic Automotive Inc.	4,625	15 nov. 2029	USD	(608 000)	(706 522)	(751 818)	
Sonic Automotive Inc.	4,875	15 nov. 2031	USD	(77 000)	(84 820)	(92 846)	
Stagwell Global LLC	5,625	15 août 2029	USD	(484 000)	(612 918)	(612 236)	
Sysco Corp.	4,450	15 mars 2048	USD	(58 000)	(63 893)	(66 047)	
Sysco Corp.	3,150	14 déc. 2051	USD	(366 000)	(320 616)	(328 099)	
Taylor Morrison Communities Inc.	5,125	1er août 2030	USD	(58 000)	(71 550)	(76 093)	
T-Mobile USA Inc.	5,050	15 juill. 2033	USD	(345 000)	(454 338)	(462 030)	
T-Mobile USA Inc.	5,750	15 janv. 2054	USD	(31 000)	(42 842)	(42 249)	
T-Mobile USA Inc.	5,500	15 janv. 2055	USD	(696 000)	(925 777)	(919 042)	
United Airlines Inc.	4,625	15 avril 2029	USD	(442 000)	(559 377)	(563 757)	
United States Treasury Note/Bond	4,375	15 mai 2034	USD	(177 000)	(244 178)	(242 292)	
US Foods Inc.	4,750	15 fév. 2029	USD	(1 223 000)	(1 521 899)	(1 588 673)	
US Foods Inc.	4,625	1er juin 2030	USD	(275 000)	(348 085)	(349 837)	
US Foods Inc.	7,250	15 janv. 2032	USD	(456 000)	(624 217)	(648 326)	
Verizon Communications Inc.	5,050	9 mai 2033	USD	(589 000)	(790 284)	(794 874)	
Verizon Communications Inc.	3,550	22 mars 2051	USD	(300 000)	(296 533)	(295 639)	
Warnermedia Holdings Inc.	5,141	15 mars 2052	USD	(162 000)	(174 863)	(172 707)	
					(20 079 803)	(20 659 468)	(73,17)
Obligations étrangères (31 décembre 2023 : néant)							
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.	5,750	20 janv. 2026	USD	(266 000)	(346 387)	(346 689)	(1,23)
Total des obligations – position vendeur					(26 229 967)	(26 721 591)	(94,64)
Total des placements					27 307 755	27 153 937	96,17
Total de la plus-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)						21 005	0,07
Total de la moins-value latente des contrats de change à terme (Annexe 1)						(51 969)	(0,18)
Total de la moins-value latente des contrats à terme sur obligations (Annexe 2)						(65 531)	(0,23)
Total de la plus-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 3)						208 308	0,74
Total de la moins-value latente des contrats à terme normalisés (Annexe 3)						(284 978)	(1,01)
Total de la plus-value latente des swaps sur défaillance de crédit (Annexe 4)						7 455	0,03
Autres actifs, moins les passifs						1 245 326	4,41
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables						28 233 553	100,00

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

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

Au 30 juin 2024

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	(78 000)	CAD	106 806	13 sept. 2024	269
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(161 000)	CAD	220 491	13 sept. 2024	587
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(51 000)	CAD	69 677	13 sept. 2024	20
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(50 440)	USD	37 000	13 sept. 2024	94
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(65 000)	CAD	88 908	13 sept. 2024	129
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(59 226)	CAD	80 908	13 sept. 2024	16
Banque Royale du Canada	USD	(2 307 976)	CAD	3 171 782	13 sept. 2024	19 300
Banque Royale du Canada	USD	(101 000)	CAD	138 544	13 sept. 2024	590
						21 005
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(79 420)	USD	58 000	13 sept. 2024	(200)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(63 142)	USD	46 000	13 sept. 2024	(311)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(13 569)	USD	9 889	13 sept. 2024	(62)
La Banque de Nouvelle-Écosse	CAD	(84 885)	USD	62 000	13 sept. 2024	(202)
La Banque de Nouvelle-Écosse	USD	(102 000)	CAD	139 052	13 sept. 2024	(260)
Banque Royale du Canada	CAD	(6 068 253)	USD	4 415 619	13 sept. 2024	(36 925)
Banque Royale du Canada	CAD	(2 273 945)	USD	1 654 656	13 sept. 2024	(13 837)
Banque Royale du Canada	CAD	(166 805)	USD	122 000	13 sept. 2024	(172)
						(51 969)
						(30 964)

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

Contrats à terme sur obligations (Annexe 2) (non audité)

Au 30 juin 2024

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	1er déc. 2053	Obligations	BMO	19 juil. 2024	(2 000 000)	66,20	(1 385 631)	(65 531)
								(1 385 631)	(65 531)
								(1 385 631)	**(65 531)**

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

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Contrats à terme normalisés (Annexe 3) (non audité)

Au 30 juin 2024

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, MTL	18 sept. 2024	409	42 282 420	122 896
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 10 ans, CBOT	19 sept. 2024	21	3 160 440	37 287
Contrats à terme normalisés sur bons du Trésor américain à 5 ans, CBOT	30 sept. 2024	26	3 791 741	25 299
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 10 ans, MTL	18 sept. 2024	12	1 440 840	11 640
Contrats à terme normalisés sur obligations, CBOT Ultra	19 sept. 2024	6	1 029 085	11 186
			51 704 526	208 308
Contrats à terme normalisés sur obligations du gouvernement du Canada à 5 ans	18 sept. 2024	(366)	(40 582 080)	(284 978)
			(40 582 080)	(284 978)
			11 122 446	**(76 670)**

Swaps sur défaillance de crédit (Annexe 4) (non audité)

Au 30 juin 2024

Description	Date d'entrée en vigueur	Date d'expiration	Notionel	Juste valeur $	Plus-value (moins-value) latente $
CDX-NAHYS42V1-5Y BP 5 %	11 juin 2024	20 juin 2029	229 000 USD	(19 999)	4 597
CDX-NAHYS42V1-5Y BP 5 %	14 mai 2024	20 juin 2029	14 000 USD	(1 223)	201
CDX-NAHYS42V1-5Y BP 5 %	31 mai 2024	20 juin 2029	147 000 USD	(12 838)	2 657
				(34 060)	7 455
				(34 060)	**7 455**

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds alternatif de revenu CC&L

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds
30 juin 2024 et 2023 (non audité)

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

Entité publiante et objectif de placement (note 1)

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

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

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 30 juin 2024

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– $	6 379 907 $	– $	6 379 907 $
Obligations – position acheteur	–	47 495 621	–	47 495 621
Contrats de change à terme	–	21 005	–	21 005
Contrats à terme normalisés	208 308	–	–	208 308
Swaps sur défaillance de crédit	7 455	–	–	7 455
	215 763 $	53 896 533 $	– $	54 112 296 $

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations – position vendeur	– $	26 721 591 $	– $	26 721 591 $
Contrats de change à terme	–	51 969	–	51 969
Contrats à terme sur obligations	–	65 531	–	65 531
Contrats à terme normalisés	284 978	–	–	284 978
	284 978 $	26 839 091 $	– $	27 124 069 $

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 $

Il n'y a eu aucun transfert d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

2024	Solde à l'ouverture de la période	Parts rachetables émises	Parts rachetables réinvesties	Parts rachetables rachetées	Solde à la clôture de la période
Série A	**33 497**	**–**	**188**	**–**	**33 685**
Série F	**111 213**	**–**	**1 135**	**(36 313)**	**76 035**
Série I	**2 961 119**	**94 804**	**44 952**	**(3 902)**	**3 096 973**
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

Imposition du Fonds (note 7)

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

Au cours de la période, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2023).

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. La rémunération au rendement est fondée sur le rendement d'une série du Fonds par rapport au rendement minimal du Fonds et correspond à 15 % de l'excédent du rendement du Fonds sur son rendement minimal. Elle s'applique aux parts des séries A et F. Les porteurs de parts de série I peuvent négocier une rémunération au rendement qui sera versée directement au gestionnaire.

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

Parts détenues par des parties liées

Groupe financier Connor, Clark & Lunn Ltée (« GFCC&L »), société liée au gestionnaire du fait d'une propriété commune, détient des parts du Fonds. Au 30 juin 2024, GFCC&L détenait 6 720 parts de série A, 6 785 parts de série F et 2 395 512 parts de série I, dont la juste valeur totale était respectivement de 53 561 $, de 56 809 $ et de 21 138 477 $ (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 $ au 31 décembre 2023).

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

Le Fonds a payé 13 817 $ (6 260 $ en 2023) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant la période (néant en 2023).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 significative.

Au 30 juin 2024

Devise	Actifs (passifs) monétaires ($)	Contrats dérivés de change ($)	Exposition nette ($)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net ($)
Dollar américain	(1 142 137)	4 761 789	3 619 652	12,8	180 983
Total	(1 142 137)	4 761 789	3 619 652	12,8	180 983

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

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était directement exposé au risque de taux d'intérêt du fait de ses placements dans des titres à revenu fixe, des instruments de créance à court terme et des instruments dérivés de taux d'intérêt. Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et excluent la trésorerie et les actions privilégiées, le cas échéant.

Au 30 juin 2024

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total $	% de l'actif net
Moins de 1 an	6 379 907	22,6
De 1 à 3 ans	4 211 609	14,9
De 3 à 5 ans	7 545 724	26,7
Plus de 5 ans	9 016 697	32,0
Total	27 153 937	96,2

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

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 223 000 $ (738 000 $ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être significative.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'autre risque de prix était négligeable, le Fonds n'ayant eu aucune exposition importante à des placements soumis aux fluctuations du marché.

Risque de crédit

Les tableaux ci-dessous présentent l'exposition du Fonds au risque de crédit au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et le gain latent sur les instruments dérivés en cours avec des contreparties.

Au 30 juin 2024

Notations des créances et des contreparties	Total $	% de l'actif net
AAA	11 949 036	42,3
AA	1 778 205	6,3
A	5 194 450	18,4
BBB	15 231 279	54,0
BB	12 654 142	44,8
B	6 720 698	23,8
CCC	368 723	1,3
Total	53 896 533	190,9

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

Prêt de titres (note 12)

Pour les périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, les revenus tirés du prêt de titres ont été les suivants :

	2024 $	2023 $
Revenus bruts tirés du prêt de titres	2 204	605
Charges liées au prêt de titres	(441)	(121)
Revenus nets tirés du prêt de titres	1 763	484
Retenues d'impôt sur les revenus tirés du prêt de titres	–	–
Revenus nets tirés du prêt de titres reçus par le Fonds	1 763	484

Les charges liées au prêt de titres ont représenté 20,0 % (20,0 % en 2023) des revenus bruts tirés du prêt de titres, et ont été payées en totalité au dépositaire du Fonds.

Le tableau qui suit présente un aperçu des titres prêtés et des garanties détenues au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

	2024 (en milliers de $)	2023 (en milliers de $)
Titres prêtés	3 134	6 323
Garanties reçues	3 291	6 639
Garanties, en pourcentage des titres prêtés	105 %	105 %

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 238,8 % à 301,4 % (de 111,3 % à 263,9 % en 2023) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2024, l'exposition totale du Fonds correspondait à 243,3% (251,2 % au 31 décembre 2023) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur titres à revenu fixe, de positions vendeur sur placements à court terme, de contrats à terme sur obligations et d'emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 6 233 466 $ (de néant à 11 856 996 $ en 2023), avec un taux d'intérêt moyen de 8,86 % (9,11 % en 2023). Au 30 juin 2024, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,0% (0,0 % au 31 décembre 2023) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds de rendement absolu PCJ II

États de la situation financière aux

	30 juin 2024 (non audité)	31 décembre 2023 (audité)
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	**282 347 $**	**–** $
Placements à court terme	**46 963 613**	60 218 952
Placements	**46 841 530**	47 535 593
Montant à recevoir du courtier	**668 836**	205 611
Dividendes à recevoir	**225 604**	140 756
Intérêts à recevoir	**22 195**	22 379
Autres créances	**27 737**	31 959
Souscriptions à recevoir	**9 030**	42 337
	95 040 892	108 197 587
Passif		
Passif courant		
Dette bancaire	**441 879**	8 523 552
Placements vendus à découvert	**42 933 974**	42 380 508
Dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**257 033**	146 032
Montant à payer au courtier	–	79 033
Frais d'emprunt de titres à payer	**10 357**	12 760
Charges à payer	**56 929**	52 266
Frais de gestion à payer	**36 346**	44 755
Rachats à payer	**199 658**	**–**
	43 936 176	51 238 906
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	**51 104 716 $**	56 958 681 $
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**693 777 $**	1 266 403 $
Série F	**45 685 755 $**	51 240 865 $
Série I	**4 725 184 $**	4 451 413 $
Parts rachetables en circulation (note 6)		
Série A	**69 456**	133 223
Série F	**4 423 723**	5 239 467
Série I	**440 000**	440 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**9,99 $**	9,51 $
Série F	**10,33 $**	9,78 $
Série I	**10,74 $**	10,12 $

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 (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Revenus		
Gain (perte) de change réalisé	**(96 864) $**	47 688 $
Variation du gain (perte) de change latent	**(187 493)**	6 565
Autres revenus (pertes)	**54 009**	444
Gain (perte) net sur placements		
Dividendes	**582 927**	358 497
Charges de dividendes sur les titres vendus à découvert	**(657 886)**	(573 379)
Intérêts aux fins des distributions	**1 597 236**	1 274 316
Gain (perte) net réalisé sur les placements	**5 692 173**	1 493 609
Gain (perte) net réalisé sur les placements vendus à découvert	**(3 213 513)**	(1 701 981)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements	**(912 919)**	833 902
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements vendus à découvert	**892 852**	(935 923)
Gain (perte) net total sur placements	**3 980 870**	749 041
Total des revenus (pertes) nets	**3 750 522**	803 738
Charges (note 8)		
Honoraires de l'auditeur	**15 167**	7 486
Honoraires des dépositaires	**8 783**	11 996
Frais de dépôt	**20 443**	8 285
Honoraires de FundSERV	**2 580**	75
Honoraires du comité d'examen indépendant	**1 975**	2 232
Charges d'intérêts	**226 109**	111 370
Frais de gestion	**260 701**	282 128
Honoraires de professionnels	**17 423**	3 111
Coût d'emprunt de titres	**70 760**	43 742
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	**23 623**	28 555
Coûts de transaction (note 9)	**85 656**	73 162
Total des charges d'exploitation	**733 220**	572 142
Retenues d'impôts (note 7)	**(21 120)**	(8 786)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**2 996 182 $**	222 810 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie		
Série A	**57 326 $**	(2 382) $
Série F	**2 665 085 $**	187 504 $
Série I	**273 771 $**	37 688 $
Nombre moyen pondéré de parts en circulation		
Série A	**91 947**	200 829
Série F	**4 632 946**	5 250 768
Série I	**440 000**	440 000
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part		
Série A	**0,62 $**	(0,01) $
Série F	**0,58 $**	0,04 $
Série I	**0,62 $**	0,09 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

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

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série A 2024	Série A 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**1 266 403 $**	1 948 885 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**57 326**	(2 382)
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**25 908**	9 398
Rachat de parts rachetables	**(655 860)**	(170 236)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**(629 952)**	(160 838)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**(572 626)**	(163 220)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**693 777 $**	1 785 665 $

	Série F 2024	Série F 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**51 240 865 $**	46 400 923 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**2 665 085**	187 504
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**5 189 563**	9 670 263
Rachat de parts rachetables	**(13 409 758)**	(4 232 873)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**(8 220 195)**	5 437 390
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**(5 555 110)**	5 624 894
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**45 685 755 $**	52 025 817 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

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

Pour les semestres clos les 30 juin

	Série I 2024	Série I 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**4 451 413 $**	4 234 115 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**273 771**	37 688
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**273 771**	37 688
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**4 725 184 $**	4 271 803 $

	Total 2024	Total 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à l'ouverture de la période	**56 958 681 $**	52 583 923 $
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**2 996 182**	222 810
Opérations sur les parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	**5 215 471**	9 679 661
Rachat de parts rachetables	**(14 065 618)**	(4 403 109)
Augmentation (diminution) nette liée aux opérations sur les parts rachetables	**(8 850 147)**	5 276 552
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables durant la période	**(5 853 965)**	5 499 362
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, à la clôture de la période	**51 104 716 $**	58 083 285 $

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les semestres clos les 30 juin

	2024	2023
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	**2 996 182 $**	222 810 $
Ajustements visant le rapprochement avec les flux de trésorerie d'exploitation :		
Variation du (gain) perte de change latent	**187 493**	(6 565)
(Gain) perte net réalisé sur les placements	**(5 692 173)**	(1 493 609)
(Gain) perte net réalisé sur les placements vendus à découvert	**3 213 513**	1 701 981
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements	**912 919**	(833 902)
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente des placements vendus à découvert	**(892 852)**	935 923
Achat de placements	**(229 742 213)**	(253 899 925)
Produit de la vente de placements	**246 161 416**	247 604 020
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	**(84 848)**	(44 985)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	**184**	30 790
(Augmentation) diminution des autres créances	**4 222**	(35 009)
Augmentation (diminution) des frais d'emprunt de titres à payer	**(2 403)**	(9 511)
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les titres vendus à découvert	**111 001**	(16 815)
Augmentation (diminution) des charges à payer	**4 663**	(39 817)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	**(8 409)**	3 172
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	**17 168 695**	(5 881 442)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Produit de l'émission de parts rachetables**	**5 211 775**	9 507 082
Rachat de parts rachetables**	**(13 828 957)**	(4 410 712)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	**(8 617 182)**	5 096 370
Augmentation (diminution) de la trésorerie (dette bancaire)		
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie (dette bancaire)	**8 551 513**	(785 072)
Variation du gain (perte) de change latent	**(187 493)**	6 565
Trésorerie, à l'ouverture de la période	**–**	596 221
Dette bancaire, à l'ouverture de la période	**(8 523 552)**	(2 162 647)
	(159 532)	(2 344 933)
Trésorerie, à la clôture de la période	**282 347 $**	69 865 $
Dette bancaire, à la clôture de la période	**(441 879) $**	(2 414 798) $
	(159 532) $	(2 344 933) $
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	**476 959 $**	304 726 $
Dividendes payés*	**(546 885)**	(590 194)
Intérêts reçus*	**1 597 420**	1 305 106
Intérêts payés*	**(226 109)**	(111 370)

* Inclus dans les activités d'exploitation.

** Déduction faite d'échanges hors trésorerie de 37 003 $ (néant en 2023).

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	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 2023 : 105,72 %)							
Bons du Trésor du Canada	9,427	4 juill. 2024	CAD	1 150 000	1 137 278	1 149 118	
Bons du Trésor du Canada	4,943	18 juill. 2024	CAD	3 550 000	3 510 307	3 540 930	
Bons du Trésor du Canada	4,806	1er août 2024	CAD	5 300 000	5 240 493	5 277 016	
Bons du Trésor du Canada	4,738	15 août 2024	CAD	12 950 000	12 807 737	12 871 324	
Bons du Trésor du Canada	4,691	29 août 2024	CAD	4 800 000	4 750 508	4 762 426	
Bons du Trésor du Canada	4,670	12 sept. 2024	CAD	19 550 000	19 344 789	19 362 799	
					46 791 112	46 963 613	91,90
Total des placements à court terme – position acheteur					46 791 112	46 963 613	91,90
Obligations – position acheteur							
Obligations de sociétés canadiennes (31 décembre 2023 : 1,27 %)							
Chorus Aviation Inc.	6,000	30 juin 2026		748 000	770 023	724 588	1,42
Total des obligations – position acheteur					770 023	724 588	1,42
Actions canadiennes – position acheteur							
Énergie (31 décembre 2023 : 5,88 %)							
Cenovus Energy Inc.				30 250	691 375	813 423	
Enerflex Ltd.				86 970	685 007	641 839	
Pason Systems Inc.				40 120	559 939	739 412	
Suncor Énergie Inc.				17 500	930 325	912 625	
Corporation TC Énergie, NYSE				16 790	857 316	870 734	
TerraVest Industries Inc.				2 930	218 956	211 810	
					3 942 918	4 189 843	8,20
Matières premières (31 décembre 2023 : 2,43 %)							
Alamos Gold Inc., NYSE				23 580	410 854	505 924	
CCL Industries Inc., cat. B				5 250	374 928	377 685	
Dundee Precious Metals Inc.				25 710	289 889	275 354	
					1 075 671	1 158 963	2,27
Industries (31 décembre 2023 : 15,24 %)							
ADENTRA Inc.				10 260	393 007	382 390	
AtkinsRealis Group Inc.				47 120	2 301 638	2 790 441	
Black Diamond Group Ltd.				77 410	512 046	627 021	
Canadien Pacifique Kansas City Limitée, NYSE				10 270	1 096 636	1 106 385	
Chorus Aviation Inc.				101 850	232 069	246 477	
GFL Environmental Inc., NYSE				6 830	353 975	363 832	
Hammond Power Solutions Inc.				2 450	262 299	273 151	
Héroux-Devtek Inc.				25 500	593 126	634 950	
Parkit Enterprise Inc.				265 952	318 013	135 636	
RB Global Inc., NYSE				20 013	1 955 202	2 091 094	
TFI International Inc.				1 110	201 388	220 490	
					8 219 399	8 871 867	17,30
Bien de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 1,33 %)							
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.				6 280	287 415	325 869	0,64
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : néant)							
Empire Co., Ltd.				7 840	267 400	274 165	
George Weston ltée				1 340	241 876	263 699	
					509 276	537 864	1,05
Soins de santé (31 décembre 2023 : 4,66 %)							
Chartwell Résidences pour retraités				298 892	3 435 541	3 840 762	7,52

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Services financiers (31 décembre 2023 : 3,08 %)						
Fairfax Financial Holdings Ltd.			1 190	1 684 517	1 852 033	
Société Financière Manuvie, NYSE			17 220	625 416	627 244	
Banque Nationale du Canada			6 980	783 854	755 027	
Banque Nationale du Canada, TSE			1 310	144 367	142 148	
Westaim Corp.			18 110	74 792	73 346	
				3 312 946	3 449 798	6,75
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : 3,19 %)						
Copperleaf Technologies Inc.			18 370	119 772	217 685	
Coveo Solutions Inc.			60 720	571 241	473 009	
Descartes Systems Group Inc.			2 730	364 516	361 862	
TECSYS Inc.			11 070	318 650	387 339	
				1 374 179	1 439 895	2,82
Services de communication (31 décembre 2023 : 6,83 %)						
Rogers Communications Inc			30 354	1 794 606	1 535 912	3,01
Services publics (31 décembre 2023 : néant)						
Algonquin Power & Utilities Corp., NYSE			15 900	125 019	127 494	0,25
Immobilier (31 décembre 2023 : 8,30 %)						
Boardwalk REIT			10 610	723 747	747 793	
Colliers International Group Inc., TSE			6 860	1 042 410	1 048 002	
DREAM Unlimited Corp.			20 140	467 372	395 751	
InterRent REIT			130 340	1 663 386	1 552 349	
				3 896 915	3 743 895	7,33
Total des actions canadiennes – position acheteur				27 973 885	29 222 162	57,14
Actions canadiennes – position vendeur						
Énergie (31 décembre 2023 : -4,12 %)						
Baytex Energy Corp.			(55 790)	(282 529)	(264 445)	
Enbridge Inc.			(17 420)	(868 711)	(847 831)	
Compagnie Pétrolière Impériale Ltée			(7 970)	(659 239)	(743 442)	
Parex Resources Inc.			(16 930)	(399 588)	(371 106)	
Precision Drilling Corp.			(2 970)	(254 440)	(285 714)	
Total Energy Services Inc.			(19 530)	(190 347)	(188 660)	
Trican Well Service Ltd.			(50 410)	(211 227)	(242 976)	
				(2 866 081)	(2 944 174)	(5,76)
Matières premières (31 décembre 2023 : -0,40 %)						
Eldorado Gold Corp.			(7 230)	(103 108)	(146 118)	
Stella-Jones Inc.			(3 470)	(274 722)	(309 767)	
				(377 830)	(455 885)	(0,89)
Industries (31 décembre 2023 : -5,96 %)						
Groupe Aecon Inc.			(7 430)	(121 494)	(126 161)	
ATS Corp.			(2 260)	(103 630)	(100 050)	
CAE inc.			(4 480)	(123 368)	(113 837)	
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada			(6 270)	(1 010 435)	(1 013 608)	
Stantec Inc.			(4 660)	(504 499)	(533 710)	
Industries Toromont Ltée			(4 330)	(528 508)	(524 493)	
WSP Global Inc.			(3 450)	(717 165)	(734 954)	
				(3 109 099)	(3 146 813)	(6,16)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -2,69 %)						
Boston Pizza Royalties Income Fund			(5 100)	(84 158)	(81 549)	
BRP Inc.			(2 750)	(259 552)	(241 038)	
Canada Goose Holdings Inc.			(4 310)	(73 701)	(76 244)	
La Société Canadian Tire Ltée			(3 430)	(480 123)	(465 588)	
Sleep Country Canada Holdings Inc.			(19 740)	(513 989)	(514 819)	
				(1 411 523)	(1 379 238)	(2,70)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -4,10 %)						
Metro inc.			(6 840)	(471 255)	(518 404)	(1,01)
Services financiers (31 décembre 2023 : -2,95 %)						
Brookfield Corp.			(5 160)	(297 494)	(293 604)	
Corporation Fiera Capital			(19 520)	(142 114)	(153 037)	
Société financière IGM Inc.			(4 200)	(146 407)	(158 634)	
Intact Corporation financière			(860)	(197 301)	(196 089)	
Société financière Sun Life Inc.			(8 610)	(574 442)	(577 559)	
				(1 357 758)	(1 378 923)	(2,70)
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : -0,98 %)						
Services de communication (31 décembre 2023 : -7,25 %)						
BCE Inc.			(23 050)	(1 253 287)	(1 021 346)	
Cogeco Communications inc.			(13 040)	(770 312)	(672 734)	
TELUS Corp.			(56 940)	(1 365 528)	(1 179 227)	
				(3 389 127)	(2 873 307)	(5,62)
Services publics (31 décembre 2023 : -0,26 %)						
Immobilier (31 décembre 2023 : -2,89 %)						
Allied Properties REIT			(10 140)	(239 012)	(155 243)	
Groupe Altus limitée			(2 870)	(125 658)	(144 992)	
Automotive Properties REIT			(1 270)	(16 821)	(12 395)	
CT REIT			(32 110)	(474 613)	(423 210)	
FPI Granite			(2 980)	(202 389)	(202 014)	
FPI RioCan			(50 310)	(975 540)	(845 711)	
SmartCentres REIT			(33 040)	(829 969)	(726 550)	
StorageVault Canada Inc.			(30 510)	(155 754)	(142 177)	
				(3 019 756)	(2 652 292)	(5,19)
Total des actions canadiennes – position vendeur				(16 002 429)	(15 349 036)	(30,03)
Actions américaines – position acheteur						
Industries (31 décembre 2023 : 15,11 %)						
Beacon Roofing Supply Inc.			4 340	574 045	537 445	
General Electric Co.			3 020	589 075	656 928	
Parker-Hannifin Corp.			870	568 738	602 147	
Quanta Services Inc.			1 470	516 651	511 094	
Uber Technologies Inc.			13 179	1 118 209	1 310 669	
Union Pacific Corp.			780	228 090	241 489	
United Rentals Inc.			1 410	821 957	1 247 779	
XPO Inc.			5 170	671 364	750 941	
				5 088 129	5 858 492	11,46
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : 1,96 %)						
Amazon.com Inc.			3 430	768 512	907 004	
Carvana Co.			2 600	458 109	457 947	
				1 226 621	1 364 951	2,67
Services financiers (31 décembre 2023 : 2,23 %)						
Apollo Global Management Inc.			1 740	259 603	281 115	
Progressive Corp.			990	238 212	281 377	
Wells Fargo & Co.			8 770	649 398	712 703	
				1 147 213	1 275 195	2,50
Technologies de l'information (31 décembre 2023 : néant)						
Microsoft Corp.			870	535 679	532 076	1,04
Total des actions américaines – position acheteur				7 997 642	9 030 714	17,67

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Actions américaines – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2023 : -3,18 %)						
Louisiana-Pacific Corp.			(3 030)	(352 330)	(341 347)	
Martin Marietta Materials Inc.			(2 300)	(1 736 523)	(1 705 149)	
Vulcan Materials Co.			(5 130)	(1 730 044)	(1 745 636)	
				(3 818 897)	(3 792 132)	(7,42)
Industries (31 décembre 2023 : -9,19 %)						
Alaska Air Group Inc.			(1 750)	(93 124)	(96 742)	
Allegiant Travel Co.			(1 400)	(125 249)	(96 225)	
American Airlines Group Inc.			(7 010)	(125 923)	(108 678)	
Caterpillar Inc.			(560)	(191 327)	(255 246)	
CH Robinson Worldwide Inc.			(3 170)	(351 888)	(382 234)	
Copart Inc.			(3 580)	(221 314)	(265 312)	
CSX Corp.			(3 810)	(177 375)	(174 388)	
Deere & Co.			(740)	(377 229)	(378 328)	
Delta Air Lines Inc.			(2 630)	(168 909)	(170 725)	
Expeditors International of Washington Inc.			(2 120)	(332 771)	(362 002)	
Graco Inc.			(4 570)	(519 470)	(495 764)	
Kennametal Inc.			(12 858)	(427 252)	(414 167)	
Landstar System Inc.			(480)	(119 153)	(121 167)	
Old Dominion Freight Line Inc.			(1 840)	(419 544)	(444 635)	
Oshkosh Corp.			(3 100)	(369 981)	(458 970)	
Saia Inc.			(360)	(234 512)	(233 637)	
Southwest Airlines Co.			(2 630)	(99 784)	(102 960)	
United Airlines Holdings Inc.			(2 630)	(149 581)	(175 115)	
Werner Enterprises Inc.			(2 350)	(136 960)	(115 215)	
				(4 641 346)	(4 851 510)	(9,49)
Biens de consommation discrétionnaire (31 décembre 2023 : -6,00 %)						
BJ's Restaurants Inc.			(2 610)	(90 621)	(123 927)	
Booking Holdings Inc.			(20)	(85 960)	(108 414)	
Brunswick Corp.			(1 000)	(110 205)	(99 574)	
Cracker Barrel Old Country Store Inc.			(3 940)	(278 280)	(227 296)	
Darden Restaurants Inc.			(870)	(176 359)	(180 140)	
Home Depot Inc.			(1 130)	(508 419)	(532 274)	
Leggett & Platt Inc.			(6 530)	(211 047)	(102 398)	
OneWater Marine Inc.			(5 616)	(205 224)	(211 865)	
Polaris Inc.			(1 780)	(220 823)	(190 736)	
Tesla Inc.			(820)	(212 422)	(222 030)	
Thor Industries Inc.			(640)	(86 520)	(81 838)	
				(2 185 880)	(2 080 492)	(4,07)
Biens de consommation de base (31 décembre 2023 : -1,82 %)						
Brown-Forman Corp., cat. B			(2 250)	(169 376)	(132 972)	
Hershey Co.			(1 370)	(372 197)	(344 614)	
J M Smucker Co.			(2 560)	(444 534)	(381 963)	
PepsiCo Inc.			(2 060)	(467 974)	(464 903)	
				(1 454 081)	(1 324 452)	(2,59)
Services financiers (31 décembre 2023 : -3,66 %)						
Markel Group Inc.			(140)	(282 375)	(301 846)	
SEI Investments Co.			(2 610)	(193 115)	(231 033)	
T Rowe Price Group Inc.			(1 560)	(229 688)	(246 143)	
				(705 178)	(779 022)	(1,52)
Immobilier (31 décembre 2023 : néant)						
CBRE Group Inc.			(1 740)	(217 414)	(212 164)	
Jones Lang LaSalle Inc.			(1 490)	(375 132)	(418 532)	
				(592 546)	(630 696)	(1,23)
Total des actions américaines – position vendeur				(13 397 928)	(13 458 304)	(26,32)

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Inventaire du portefeuille (non audité)

Au 30 juin 2024

	Taux d'intérêt nominal/ rendement %	Date d'échéance	Nombre d'actions/ valeur nominale	Coût moyen $	Juste valeur $	Pourcentage de l'actif net %
Actions étrangères – position acheteur						
Matières premières (31 décembre 2023 : 6,65 %)						
CRH PLC			33 460	3 097 266	3 432 945	6,72
Industries (31 décembre 2023 : 3,76 %)						
AerCap Holdings NV			3 450	406 171	439 978	
Brookfield Business Partners LP, NYSE			88 063	2 355 283	2 271 435	
				2 761 454	2 711 413	5,31
Services publics (31 décembre 2023 : 1,52 %)						
Brookfield Infrastructure Partners LP, NYSE			45 801	1 764 718	1 719 708	3,37
Total des actions étrangères – position acheteur				7 623 438	7 864 066	15,40
Actions étrangères – position vendeur						
Matières premières (31 décembre 2023 : -1,62 %)						
Immobilier (31 décembre 2023 : néant)						
Cushman & Wakefield PLC			(24 340)	(318 106)	(346 377)	(0,68)
Total des actions étrangères – position vendeur				(318 106)	(346 377)	(0,68)
Fonds négociés en bourse – position vendeur (31 décembre 2023 : -17,32 %)						
BMO S&P 500 Index ETF			(9 840)	(615 233)	(802 846)	
Industrial Select Sector SPDR Fund			(19 989)	(3 072 395)	(3 333 370)	
Invesco QQQ Trust Series 1			(380)	(218 446)	(249 123)	
iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF			(88 380)	(2 912 173)	(3 080 043)	
iShares MSCI USA Momentum Factor ETF			(2 437)	(557 494)	(649 724)	
iShares Russell 2000 ETF			(1 710)	(418 577)	(474 736)	
SPDR Bloomberg High Yield Bond ETF			(5 530)	(740 412)	(713 336)	
SPDR Dow Jones Industrial Average ETF Trust			(1 570)	(784 078)	(840 265)	
SPDR S&P 500 ETF Trust			(4 180)	(2 821 541)	(3 112 765)	
SPDR S&P Regional Banking ETF			(7 800)	(517 188)	(524 049)	
Total des fonds négociés en bourse – position vendeur				(12 657 537)	(13 780 257)	(26,96)
Commissions de courtage intégrées (note 3)				(33 033)		
Total du portefeuille de placements				48 747 067	50 871 169	99,54
Autres actifs, moins les passifs					233 547	0,46
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables					51 104 716	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds de rendement absolu PCJ II

Notes annexes – Renseignements propres au Fonds

30 juin 2024 et 2023 (non audité)

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

Renseignements généraux (note 1)

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

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

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

Juste valeur des instruments financiers (note 5)

Classement des placements selon la hiérarchie des justes valeurs

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

Au 30 juin 2024

Actifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Placements à court terme – position acheteur	– $	46 963 613 $	– $	46 963 613 $
Obligations – position acheteur	–	724 588	–	724 588
Actions canadiennes – position acheteur	29 222 162	–	–	29 222 162
Actions américaines – position acheteur	9 030 714	–	–	9 030 714
Actions étrangères – position acheteur	7 864 066	–	–	7 864 066
	46 116 942 $	47 688 201 $	– $	93 805 143 $

Passifs à la juste valeur	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions canadiennes – position vendeur	15 349 036 $	– $	– $	15 349 036 $
Actions américaines – position vendeur	13 458 304	–	–	13 458 304
Actions étrangères – position vendeur	346 377	–	–	346 377
Fonds négociés en bourse – position vendeur	13 780 257	–	–	13 780 257
	42 933 974 $	– $	– $	42 933 974 $

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 $

Il n'y a eu aucun transfert d'actifs ou de passifs financiers entre les niveaux 1, 2 et 3 pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023. Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes.

Parts rachetables du Fonds (note 6)

Pour la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023, les changements aux parts en circulation ont été les suivants :

2024	**Solde à l'ouverture de la période**	**Parts rachetables émises**	**Parts rachetables réinvesties**	**Parts rachetables rachetées**	**Solde à la clôture de la période**
Série A	**133 223**	**2 736**	**–**	**(66 503)**	**69 456**
Série F	**5 239 467**	**507 992**	**–**	**(1 323 736)**	**4 423 723**
Série I	**440 000**	**–**	**–**	**–**	**440 000**
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

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 $ au 31 décembre 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 $ au 31 décembre 2022).

Au cours de la période considérée, le taux de retenues d'impôt s'est situé entre 0 % et 35 % (entre 0 % et 35 % en 2023).

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 30 juin 2024, 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 49 945 $, 51 639 $ et 4 725 336 $ (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 $, 48 899 $ et 4 451 413 $ au 31 décembre 2023).

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

Le Fonds a payé 85 656 $ (73 162 $ en 2023) en commissions de courtage et autres coûts de transaction relativement à des opérations de portefeuille durant la période. Aucun paiement indirect n'a été effectué durant la période (aucun en 2023).

Gestion des risques financiers (note 10)

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds aux devises au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 significative.

Au 30 juin 2024

Devise	Actifs (passifs) monétaires ($)	% de l'actif net	Incidence sur l'actif net ($)
Dollar américain	(143 232)	(0,3)	(7 162)
	(143 232)	(0,3)	(7 162)

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)

Risque lié aux taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était directement exposé au risque lié aux taux d'intérêt du fait de ses placements dans des titres à revenu fixe et des instruments de créance à court terme. Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque lié aux taux d'intérêt au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance et excluent la trésorerie et les actions privilégiées.

Au 30 juin 2024

Instruments de créance regroupés par date d'échéance	Total $	% de l'actif net
Moins de 1 an	46 963 613	91,9
De 1 à 3 ans	724 588	1,4
Total	47 688 201	93,3

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

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 59 000 $ (53 000 $ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être significative.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2024, environ 6,2 % (7,8 % au 31 décembre 2023) 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 318 000 $ (443 000 $ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et cette différence peut être significative.

Risque de crédit

Les tableaux ci-dessous présentent l'exposition du Fonds au risque de crédit au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023. Les montants présentés sont fondés sur la valeur comptable des instruments de créance.

Au 30 juin 2024

Notations des créances et des contreparties	Total $	% de l'actif net
AAA	46 963 613	91,9
Non notées	724 588	1,4
Total	47 688 201	93,3

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

Placements dans des entités structurées (note 11)

Au 30 juin 2024, 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 13 780 257 $, respectivement (néant et 9 866 092 $, respectivement, au 31 décembre 2023). 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-value) latente des placements ».

Effet de levier (note 13)

Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, l'exposition totale du Fonds à l'effet de levier a varié de 79,9 % à 117,5 % (de 59,1 % à 91,2 % en 2023) de sa valeur liquidative. L'exposition totale du Fonds à l'effet de levier se situe dans la cible établie dans le prospectus simplifié. Au 30 juin 2024, l'exposition totale du Fonds correspondait à 89,4% (89,4 % au 31 décembre 2023) de sa valeur liquidative. L'effet de levier provenait principalement de positions vendeur sur actions et des emprunts en trésorerie.

Les emprunts en trésorerie sont une composante de l'effet de levier du Fonds. Ces emprunts en trésorerie sont remboursables à vue. Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds avait des emprunts en trésorerie variant de néant à 13 722 744 $ (de néant à 10 283 034 $ en 2023), avec un taux d'intérêt moyen de 5,57 % (5,17 % en 2023). Au 30 juin 2024, les emprunts en trésorerie correspondaient à 0,9 % (15,0 % au 31 décembre 2023) de la valeur liquidative du Fonds.

Fonds Connor, Clark & Lunn Inc.
Fonds communs de placement alternatifs

Notes annexes

30 juin 2024 et 2023 (non audité)

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

1 Renseignements généraux

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

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

Fiducie RBC Services aux investisseurs en est le fiduciaire.

Le gestionnaire a approuvé la publication des états financiers le 26 août 2024.

2 Mode de présentation

a) Déclaration de conformité :

Les états financiers ont été préparés conformément aux normes IFRS de comptabilité, notamment la norme comptable internationale IAS 34, *Information financière intermédiaire*. Les états financiers ont été établis selon la méthode du coût historique, sauf en ce qui a trait à la réévaluation à la juste valeur par le biais du résultat net des actifs et des passifs financiers (y compris les instruments dérivés).

b) Monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation :

Les 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.

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.

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.

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

4 Estimations et jugements comptables critiques

La préparation d'états financiers conformes aux 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.

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.

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 rachetable » du tableau des flux de trésorerie. Conformément à leurs politiques de gestion des risques énoncées à la note 10 et à leurs objectifs, les Fonds visent à investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant une liquidité suffisante pour les rachats. La liquidité est maintenue par la cession de titres négociables au besoin.

7 Imposition des Fonds

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

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

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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.

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.

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.

Risque de crédit

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

Les Fonds évaluent le risque de crédit et les pertes de crédit attendues à l'aide des mesures suivantes : la probabilité de défaillance, l'exposition en cas de défaillance et la perte en cas de défaillance. Pour établir les pertes de crédit attendues, le gestionnaire se fonde à la fois sur des analyses historiques et sur des informations prospectives. Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, 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 30 juin 2024, à l'exception des parts rachetables, qui sont remboursables à vue, des positions vendeur sur obligations et de certains dérivés. Au 31 décembre 2023, tous les passifs financiers des Fonds venaient à échéance dans les trois mois suivant la date des états financiers.

Risque de concentration

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

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

L'inventaire du portefeuille des Fonds respectifs décrit en détail l'exposition des Fonds au risque de concentration au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

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.

Au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos les 31 décembre 2023, 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.