



GESTION
MONDIALE D'ACTIFS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2023

30 JUIN 2023

Table des matières

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	1
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	21
Fonds alternatif multistratégie CI	40
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	52
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	65
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	75
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	93
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	110
Notes des états financiers	123
Avis juridique	134

Le gestionnaire des Fonds, CI Investments Inc., nomme un auditeur indépendant pour qu'il réalise l'audit des états financiers annuels des Fonds. En vertu des lois canadiennes sur les valeurs mobilières (Règlement 81-106), si l'auditeur n'a pas effectué l'examen des états financiers semestriels, un avis accompagnant les états financiers doit en faire état.

L'auditeur indépendant des Fonds n'a pas effectué l'examen des présents états financiers semestriels en conformité avec les normes établies par Comptables professionnels agréés du Canada (CPA Canada).

Pour demander un autre format de ce document, veuillez communiquer avec nous à servicefrancais@ci.com ou au 1 800 792-9355.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	827 319	597 736
Placements donnés en garantie	249 324	102 377
Trésorerie	-	5 370
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	4 813	3 858
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	1 743	481
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	2 338
Dividendes à recevoir	4	4
Intérêts à recevoir	8 586	5 867
Montant à recevoir pour la vente de placements	5 263	50
Montant à recevoir pour la souscription de parts	6 153	2 107
	1 103 205	720 188
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	51 383	33 347
Découvert bancaire	161 279	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	475	417
Swaps, options sur swaps et options	956	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	99	47
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	191	176
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	7 655	2 050
Montant à payer pour le rachat de parts	4 127	816
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	18	29
Frais de rendement à payer	99	-
Frais d'administration à payer	3	6
Comptes créditeurs et charges à payer	75	62
	226 360	36 950
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	876 845	683 238

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	87 471	68 204	9,50	9,47	9 205 551
Série AH	875	652	9,55*	9,50*	69 175	50 728
Série F	380 902	299 418	9,50	9,47	40 106 510	31 621 248
Série FH	13 704	8 313	9,53*	9,49*	1 085 531	647 080
Série I	68 655	56 180	9,49	9,47	7 232 682	5 931 765
Série IH	8 817	8 715	9,53*	9,49*	698 340	678 219
Série P	2 607	1 876	9,47	9,46	275 166	198 227
Série PH	310	314	9,52*	9,47*	24 594	24 505
Série W	59 143	46 580	9,49	9,47	6 231 300	4 918 517
Série WH	845	619	9,53*	9,49*	66 871	48 213
Série Y*	11 207	12 069	10,17	10,14	1 102 358	1 190 703
Série YH*	3 391	3 608	9,40*	9,34*	272 360	285 139
Série FNB en \$ CA	215 962	161 640	19,18	19,13	11 260 000	8 450 000
Série FNB couverte en \$ US	22 956	15 050	19,25*	19,16*	900 000	580 000

*Auparavant Catégorie F et Catégorie F - Série USD 0818, respectivement.

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH, YH et FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	185	78
Intérêts aux fins des distributions	15 745	3 753
Distributions de revenu provenant des placements	-	142
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(140)	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(353)	(58)
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(307)	(225)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	22 613	(368)
Profit (perte) de change net réalisé sur les placements et les dérivés	-	(133)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(18 134)	(17 147)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	19 609	(13 958)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(550)	372
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	72	32
Rabais sur frais	1	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Variation du profit (de la perte) de change latent sur la trésorerie	-	331
Autres revenus	1	-
Total des autres revenus	(476)	735
Total des revenus	19 133	(13 223)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	2 994	1 315
Primes de rendement (note 5)	100	-
Frais d'administration (note 5)	586	240
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	22	57
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	86	46
Droits de garde et frais d'administration	-	-
Frais de transaction	-	-
Charge d'intérêts	1 211	-
Retenues d'impôts	18	25
Taxe de vente harmonisée	408	161
Autres frais	-	-
Total des charges	5 426	1 845
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 707	(15 068)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	1 056	(2 466)	0,13	(0,48)	8 083 252	5 085 928
Série AH	(7)	(18)	(0,11)	(0,36)	64 377	51 358
Série F	6 223	(7 390)	0,18	(0,49)	35 173 466	15 156 337
Série FH	(129)	(129)	(0,15)	(0,27)	853 630	468 220
Série I	1 568	(1 356)	0,24	(0,40)	6 567 797	3 407 809
Série IH	66	(143)	0,09	(0,22)	689 831	638 958
Série P	40	(98)	0,16	(0,52)	244 125	187 345
Série PH	2	3	0,09	0,64	24 576	3 880
Série W	1 258	(531)	0,23	(0,42)	5 547 805	1 252 621
Série WH	1	(15)	0,03	(0,61)	59 498	25 227
Série Y*	296	(1 554)	0,25	(0,40)	1 169 088	3 844 173
Série YH*	16	(98)	0,05	(0,35)	287 322	359 021
Série FNB en \$ CA	3 460	(1 098)	0,34	(0,86)	10 140 000	1 272 155
Série FNB couverte en \$ US	(143)	(175)	(0,19)	(0,57)	772 265	307 017

*Auparavant Catégorie F et Catégorie F - Série USD 0818, respectivement.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	68 204	28 908	652	491	299 418	53 291
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 056	(2 466)	(7)	(18)	6 223	(7 390)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(947)	(253)	(10)	(3)	(5 509)	(1 203)
Profits nets réalisés	-	(197)	-	(3)	-	(926)
Remboursement de capital	(178)	(56)	(2)	-	(1 102)	(263)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 125)	(506)	(12)	(6)	(6 611)	(2 392)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	36 499	42 677	258	324	146 355	204 039
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 068	472	11	6	5 141	1 752
Rachat de parts rachetables	(18 231)	(16 087)	(27)	(56)	(69 624)	(29 921)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	19 336	27 062	242	274	81 872	175 870
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	19 267	24 090	223	250	81 484	166 088
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	87 471	52 998	875	741	380 902	219 379

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 313	5 228	56 180	17 019	8 715	7 960
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(129)	(129)	1 568	(1 356)	66	(143)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(189)	(44)	(1 318)	(370)	(185)	(83)
Profits nets réalisés	-	(35)	-	(288)	-	(65)
Remboursement de capital	(38)	(9)	(271)	(78)	(38)	(18)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(227)	(88)	(1 589)	(736)	(223)	(166)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	8 178	2 991	20 718	40 171	80	115
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	214	87	1 293	736	220	166
Rachat de parts rachetables	(2 645)	(2 737)	(9 515)	(9 921)	(41)	(17)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5 747	341	12 496	30 986	259	264
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 391	124	12 475	28 894	102	(45)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 704	5 352	68 655	45 913	8 817	7 915

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 876	206	314	13	46 580	6 021
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	40	(98)	2	3	1 258	(531)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(48)	(20)	(6)	(1)	(1 075)	(130)
Profits nets réalisés	-	(20)	-	-	-	(103)
Remboursement de capital	(10)	-	(1)	-	(228)	(27)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(58)	(40)	(7)	(1)	(1 303)	(260)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 360	3 862	-	283	22 316	16 523
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	55	39	1	-	1 303	260
Rachat de parts rachetables	(666)	(1 534)	-	-	(11 011)	(1 359)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	749	2 367	1	283	12 608	15 424
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	731	2 229	(4)	285	12 563	14 633
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 607	2 435	310	298	59 143	20 654

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Série Y ^a		Série YH ^a	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	619	147	12 069	46 348	3 608	4 438
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	(15)	296	(1 554)	16	(98)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(16)	(8)	(208)	(326)	(62)	(37)
Profits nets réalisés	-	-	-	(253)	-	(29)
Remboursement de capital	(4)	-	(43)	(71)	(14)	(8)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(20)	(8)	(251)	(650)	(76)	(74)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	252	833	699	2 620	-	395
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	19	8	251	650	76	74
Rachat de parts rachetables	(26)	(284)	(1 857)	(14 008)	(233)	(414)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	245	557	(907)	(10 738)	(157)	55
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	226	534	(862)	(12 942)	(217)	(117)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	845	681	11 207	33 406	3 391	4 321

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	161 640	16 769	15 050	6 568	683 238	193 407
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 460	(1 098)	(143)	(175)	13 707	(15 068)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(3 295)	(140)	(334)	(44)	(13 202)	(2 662)
Profits nets réalisés	-	(108)	-	(35)	-	(2 062)
Remboursement de capital	(678)	(29)	(69)	(11)	(2 676)	(570)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 973)	(277)	(403)	(90)	(15 878)	(5 294)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	74 165	22 984	17 965	6 006	328 845	343 823
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	9 651	4 250
Rachat de parts rachetables	(19 330)	(9 408)	(9 513)	(5 966)	(142 718)	(91 712)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	54 835	13 576	8 452	40	195 778	256 361
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	54 322	12 201	7 906	(225)	193 607	235 999
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	215 962	28 970	22 956	6 343	876 845	429 406

^aAuparavant Catégorie F et Catégorie F - Série USD 0818, respectivement.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 707	(15 068)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(22 613)	368
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(74)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	22	57
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	18 134	17 147
Variation du profit (de la perte) de change latent sur la trésorerie	-	(249)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés and sales of short positions	1 772 736	1 209 476
Achat de placements et de dérivés and buy to cover short positions	(2 126 298)	(1 519 395)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	2 338	(1 423)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	1
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(2 720)	(1 985)
(Augmentation) diminution des autres actifs	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(10)	5
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	1
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	100	-
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	52	62
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	15	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	13	4
Amortissement des produits d'intérêts	(24)	(6)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(345 886)	(311 124)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(6 228)	(1 043)
Produit de l'émission de parts rachetables	324 798	343 201
Montant versé au rachat de parts rachetables	(139 407)	(88 580)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	179 163	253 578
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	74	249
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(166 723)	(57 546)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 370	104 189
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	(161 279)	46 892

Tableaux des flux de trésorerie (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	168	198
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	13 001	1 760
Dividendes payés*	(301)	(58)
Intérêts payés*	(1 503)	(163)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR					
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES					
USD	27 675 000	Obligation du Trésor américain, 2,38 %, 31 mars 2029	34 328 430	33 467 380	
USD	6 625 000	Obligation du Trésor américain, 2,63 %, 31 juillet 2029	8 378 770	8 106 234	
USD	95 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 30 avril 2027	121 741	118 866	
USD	9 745 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 31 juillet 2027	12 497 188	12 168 390	
USD	3 760 000	Obligation du Trésor américain, 3 %, 31 juillet 2024	4 821 750	4 855 852	
USD	5 800 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2027	7 531 914	7 347 245	
USD	12 045 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2029	15 517 520	15 153 173	
USD	8 630 000	Obligation du Trésor américain, 3,25 %, 31 août 2024	11 309 513	11 157 942	
USD	48 350 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	62 040 428	61 744 802	
USD	1 000 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 septembre 2025	1 320 138	1 288 966	
USD	28 160 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 31 janvier 2028	37 352 924	36 218 599	
USD	24 655 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 février 2033	33 181 528	31 804 341	
USD	33 495 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2026	44 833 759	43 289 188	
USD	1 725 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mai 2028	2 293 202	2 234 670	
USD	10 320 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	13 479 026	13 103 202	
USD	1 965 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2053	2 495 787	2 497 788	
USD	2 390 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 31 mars 2025	3 181 446	3 103 572	
USD	3 535 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 30 avril 2025	4 784 522	4 591 344	
USD	3 300 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 30 juin 2028	4 357 023	4 346 060	
USD	4 500 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 31 octobre 2029	6 079 957	5 945 074	
USD	370 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 juin 2026	485 139	485 103	
USD	32 435 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 30 septembre 2027	44 639 117	42 720 695	
USD	25 846 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 novembre 2032	35 880 592	34 972 428	
USD	51 945 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 31 octobre 2024	70 062 401	67 986 218	
USD	1 500 000	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 novembre 2025	2 019 509	1 976 801	
USD	1 155 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 28 février 2025	1 584 737	1 518 192	
USD	1 275 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 15 mars 2026	1 761 059	1 690 739	
USD	4 770 668	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	5 932 820	5 562 097	
USD	21 771 160	Obligation du Trésor américain, indexées sur l'inflation, 0,63 %, 15 juillet 2032	27 290 632	26 505 311	
			499 562 572	485 960 272	55,4
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	40 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} décembre 2030	32 950	32 546	
	4 610 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	4 395 657	4 366 069	
	265 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	241 448	241 539	
	795 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	687 070	693 785	
	23 615 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} décembre 2031	20 605 891	20 478 103	
	7 865 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} décembre 2053	5 662 914	5 804 849	
	150 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	140 655	139 830	
	240 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2032	217 957	215 990	
	1 485 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	1 454 088	1 452 840	
	66 055 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} décembre 2032	62 645 968	61 895 978	
	49 150 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} août 2024	48 220 009	48 019 022	
	10 450 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	10 259 770	10 042 923	
	60 700 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	57 663 379	58 097 715	
	11 630 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	11 438 610	11 356 604	
	5 175 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	5 055 385	5 018 114	
	125 820 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} mars 2028	125 666 263	124 861 998	
	17 090 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	16 868 384	16 843 569	
			371 256 398	369 561 474	42,1
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	717 000	1375209 BC Ltd., 9 %, 30 janvier 2028	958 668	952 653	
USD	1 060 000	Alexander Funding Trust, 1,84 %, 15 novembre 2023	1 305 176	1 373 638	
	55 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	54 996	45 819	
	2 600 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	2 584 400	2 533 345	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
	870 000	AltaGas Ltd., 4,4 %, 15 mars 2024	862 823	862 437	
	725 000	AltaLink LP, 3,67 %, 6 novembre 2023	720 331	720 950	
USD	170 000	Altice France SA, 5,5 %, 15 janvier 2028	214 213	170 363	
	1 215 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	1 207 986	1 178 437	
USD	360 000	Aramark Services Inc., 5 %, 1 ^{er} avril 2025	478 468	470 503	
	15 000	ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	15 000	13 815	
	40 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	40 000	35 127	
USD	2 500 000	Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc., 4,13 %, 15 août 2026	3 018 545	3 088 679	
	3 325 000	AT&T Inc., 2,85 %, 25 mai 2024	3 271 490	3 245 599	
USD	1 420 000	Bank of America Corp., taux variable, 25 septembre 2025	1 767 906	1 768 003	
USD	465 000	Bank of America Corp., taux variable, 13 février 2031	515 908	515 762	
USD	70 000	Bank of America Corp., taux variable, 23 juillet 2031	87 606	73 860	
USD	130 000	Bank of America Corp., taux variable, 21 septembre 2036	155 670	131 496	
	2 825 000	Banque de Montréal, 2,85 %, 6 mars 2024	2 756 260	2 776 595	
	500 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	497 605	464 629	
	280 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janvier 2025	279 880	265 122	
	80 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	82 355	75 810	
USD	432 000	Bausch Health Cos. Inc., 11 %, 30 septembre 2028	481 123	406 327	
USD	210 000	Bausch Health Cos. Inc., 14 %, 15 octobre 2030	165 179	166 918	
USD	1 480 000	Bausch Health Cos. Inc., 5,5 %, 1 ^{er} novembre 2025	1 883 687	1 735 060	
USD	250 000	Baytex Energy Corp., 8,5 %, 30 avril 2030	329 824	323 762	
USD	1 475 000	Baytex Energy Corp., 8,75 %, 1 ^{er} avril 2027	2 049 837	1 980 862	
	2 100 000	Bell Canada, 2,7 %, 27 février 2024	2 057 778	2 063 547	
	1 575 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	1 511 114	1 510 036	
	360 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	368 854	347 710	
	2 545 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	2 541 927	2 541 460	
USD	720 000	Booz Allen Hamilton Inc., 3,88 %, 1 ^{er} septembre 2028	840 681	867 728	
USD	95 000	Brightsphere Investment Group Inc., 4,8 %, 27 juillet 2026	120 511	117 965	
USD	740 000	Cablevision Lightpath LLC, 3,88 %, 15 septembre 2027	821 943	822 313	
USD	1 325 000	Calumet Specialty Products Partners LP/Calumet Finance Corp, 8,13 %, 15 janvier 2027	1 509 389	1 682 258	
	240 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	239 453	217 122	
	100 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	103 401	96 367	
	1 940 000	Canadian Natural Resources Ltd., 1,45 %, 16 novembre 2023	1 908 002	1 913 236	
	5 095 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 1,59 %, 24 novembre 2023	4 971 114	5 021 315	
	630 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,15 %, 13 mars 2029	577 710	576 627	
	3 040 000	La Société Canadian Tire Limitée, 3,17 %, 6 juillet 2023	3 028 291	3 040 169	
	40 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 2,61 %, 30 janvier 2025	40 000	37 916	
USD	180 000	CANPACK SA/Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,13 %, 1 ^{er} novembre 2025	216 000	218 468	
USD	520 000	CANPACK SA/Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,88 %, 15 novembre 2029	607 323	561 514	
USD	640 000	Carnival Corp., 4 %, 1 ^{er} août 2028	709 862	754 509	
USD	280 000	Carnival Corp., 7,63 %, 1 ^{er} mars 2026	307 123	363 631	
USD	290 000	Carnival Holdings Bermuda Ltd., 10,38 %, 1 ^{er} mai 2028	398 573	420 541	
USD	500 000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 15 janvier 2034	487 884	501 359	
USD	275 000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp/Millennium Operations LLC, 5,5 %, 1 ^{er} mai 2025	362 561	361 356	
	125 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	124 805	108 471	
USD	1 633 650	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 30 avril 2025	2 122 982	2 165 530	
USD	719 705	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 1 ^{er} février 2027	929 628	948 858	
USD	1 740 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,3 %, 1 ^{er} février 2032	1 757 944	1 745 450	
USD	290 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,8 %, 1 ^{er} avril 2031	306 205	309 137	
	1 200 000	FPI Propriétés de Choix, série B, 4,9 %, 5 juillet 2023	1 199 349	1 200 227	
	90 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	90 000	81 904	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	1 345 000	CHS/Community Health Systems Inc., 8 %, 15 mars 2026	1 679 484	1 734 296	
USD	1 375 000	CITGO Petroleum Corp., 7 %, 15 juin 2025	1 750 298	1 789 017	
USD	155 000	Citigroup Inc., taux variable, 3 novembre 2032	191 358	165 489	
USD	290 000	Citigroup Inc., taux variable, 25 janvier 2033	368 774	320 717	
USD	290 000	Coeur Mining Inc., 5,13 %, 15 février 2029	336 903	317 354	
USD	110 000	Columbia Care Inc., 9,5 %, 3 février 2026	139 535	130 695	
USD	32 000	CommScope Technologies LLC, 6 %, 15 juin 2025	40 926	39 569	
USD	1 750 000	Comstock Resources Inc., 6,75 %, 1 ^{er} mars 2029	2 133 859	2 123 953	
USD	890 000	Consensus Cloud Solutions Inc., 6,5 %, 15 octobre 2028	1 025 216	1 009 129	
	600 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	550 838	423 750	
USD	1 130 000	CrowdStrike Holdings Inc., 3 %, 15 février 2029	1 294 170	1 292 327	
USD	1 315 000	CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15 novembre 2031	1 361 872	1 216 148	
USD	395 000	CSC Holdings LLC, 5,5 %, 15 avril 2027	449 059	436 161	
USD	280 000	CSC Holdings LLC, 11,25 %, 15 mai 2028	376 782	360 141	
	115 000	CT REIT, 3,03 %, 5 février 2029	115 000	100 888	
USD	1 275 000	Curaleaf Holdings Inc., 8 %, 15 décembre 2026	1 536 929	1 325 909	
	765 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	737 106	726 239	
USD	60 550	DIRECTV Financing LLC, taux variable, 2 août 2027	75 350	78 598	
USD	175 000	DISH DBS Corp., 5,75 %, 1 ^{er} décembre 2028	218 663	172 885	
USD	650 000	DISH Network Corp., coupon zéro, convertibles, 15 décembre 2025	718 936	459 649	
	2 040 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	2 031 069	2 027 634	
	2 185 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	2 185 563	2 171 521	
	660 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	598 198	596 206	
USD	1 305 000	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,63 %, 15 décembre 2030	1 746 938	1 715 833	
USD	434 128	Emerald Debt Merger Sub LLC, taux variable, 31 mai 2030	581 803	575 831	
USD	10 000	EQM Midstream Partners LP, 4 %, 1 ^{er} août 2024	12 750	12 971	
USD	665 000	Expedia Group Inc., 6,25 %, 1 ^{er} mai 2025	887 572	884 124	
	675 000	FPI First Capital, série Q, 3,9 %, 30 octobre 2023	669 215	671 184	
USD	640 000	FMG Resources (2006 août) Pty Ltd., 4,38 %, 1 ^{er} avril 2031	736 359	725 100	
	995 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	995 000	993 031	
	505 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 7,38 %, 12 mai 2026	505 000	506 869	
USD	828 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1 ^{er} mars 2028	1 069 206	1 031 924	
USD	1 325 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,55 %, 14 novembre 2024	1 762 312	1 731 825	
USD	475 000	Freeport-McMoRan Inc., 5 %, 1 ^{er} septembre 2027	617 273	613 475	
USD	850 000	Frontier Communications Holdings LLC, 5 %, 1 ^{er} mai 2028	977 426	972 582	
USD	750 000	Frontier Communications Holdings LLC, 6,75 %, 1 ^{er} mai 2029	790 413	771 499	
USD	350 000	Frontier Communications Holdings LLC, 8,75 %, 15 mai 2030	462 229	453 547	
USD	1 000 000	General Motors Financial Co., Inc., série A, convertibles, taux variable, 30 septembre 2027	1 089 103	1 081 327	
	120 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 3,15 %, 8 février 2027	119 962	109 888	
USD	1 230 000	GFL Environmental Inc., 3,75 %, 1 ^{er} août 2025	1 520 292	1 551 735	
USD	464 000	GFL Environmental Inc., 5,13 %, 15 décembre 2026	599 628	593 593	
	645 000	Gibson Energy Inc., série 20-A, convertibles, taux variable, 22 décembre 2080	533 093	534 508	
	310 000	Gibson Energy Inc., taux variable, 12 juillet 2083	310 000	312 393	
USD	500 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), 0,93 %, 21 octobre 2024	646 624	651 234	
USD	230 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 octobre 2027	290 561	271 054	
USD	710 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 22 avril 2032	789 035	771 328	
USD	210 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 juillet 2032	258 558	222 852	
	2 345 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 3, 3,87 %, 30 novembre 2023	2 330 586	2 327 847	
	150 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	154 334	137 566	
USD	320 000	Graphic Packaging International LLC, 0,82 %, 15 avril 2024	410 184	406 857	
USD	719 000	Hudbay Minerals Inc., 4,5 %, 1 ^{er} avril 2026	806 939	887 861	
USD	725 000	Husky III Holding Ltd., paiement en nature, 13 %, 15 février 2025	889 733	876 405	
USD	70 000	IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15 octobre 2028	89 108	69 505	
	665 000	Intact Corporation financière, 1,21 %, 20 mai 2024	631 803	641 656	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
	3 925 000	Inter Pipeline Ltd., 2,61 %, 13 septembre 2023	3 878 359	3 903 482	
	175 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	175 000	153 875	
USD	390 000	IQVIA Inc., 5 %, 15 octobre 2026	501 986	499 123	
USD	140 000	Jacobs Entertainment Inc., 6,75 %, 15 février 2029	177 464	166 167	
	1 020 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	973 920	897 922	
USD	700 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 16 février 2025	890 085	895 206	
USD	1 690 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 23 juin 2025	2 122 275	2 125 550	
USD	450 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 4 février 2032	515 629	475 003	
USD	245 000	KB Home, 4 %, 15 juin 2031	261 515	280 221	
USD	250 000	Kenvue Inc., 4,9 %, 22 mars 2033	345 080	335 189	
	115 000	Kruger Products Inc., 6 %, 24 avril 2025	110 688	109 695	
USD	810 000	Kyndryl Holdings Inc., 2,05 %, 15 octobre 2026	912 121	926 122	
USD	165 000	Level 3 Financing Inc., 3,63 %, 15 janvier 2029	115 703	131 358	
USD	1 200 000	Level 3 Financing Inc., 3,75 %, 15 juillet 2029	1 036 945	961 084	
USD	855 000	Level 3 Financing Inc., 3,88 %, 15 novembre 2029	879 503	902 828	
	1 630 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	1 642 896	1 607 093	
USD	140 000	Lumen Technologies Inc., 4 %, 15 février 2027	177 616	138 886	
	181 000	Mattamy Group Corp., 4,63 %, 1 ^{er} mars 2028	156 113	161 409	
USD	320 000	Mattel Inc., 3,75 %, 1 ^{er} avril 2029	378 621	373 403	
USD	198 000	McAfee Corp., 7,38 %, 15 février 2030	249 254	228 318	
	925 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	956 411	893 322	
	1 750 000	Metro Inc., série J, 1,92 %, 2 décembre 2024	1 684 015	1 665 181	
	4 910 000	Molson Coors International LP, 2,84 %, 15 juillet 2023	4 863 470	4 905 596	
	1 095 000	Mondelez International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	1 060 059	1 054 638	
	405 000	Morgan Stanley, 3 %, 7 février 2024	398 961	399 237	
USD	1 818 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2025	2 318 194	2 334 290	
USD	310 000	MSCI Inc., 3,25 %, 15 août 2033	380 843	331 160	
USD	360 000	MSCI Inc., 4 %, 15 novembre 2029	439 627	432 042	
USD	5 023 000	Netflix Inc., 3,63 %, 15 juin 2025	6 398 121	6 416 375	
USD	260 000	Newell Brands Inc., 6,63 %, 15 septembre 2029	335 165	330 841	
USD	300 000	Newmont Corp., 2,25 %, 1 ^{er} octobre 2030	375 620	325 854	
	60 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	60 000	58 004	
USD	85 000	NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC, 7,13 %, 1 ^{er} avril 2026	108 153	104 934	
	1 060 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série L, 1,2 %, 1 ^{er} décembre 2023	1 025 545	1 042 656	
USD	80 000	Novelis Corp., 3,25 %, 15 novembre 2026	97 111	96 062	
USD	185 000	NRG Energy Inc., 3,88 %, 15 février 2032	214 036	189 107	
	1 730 000	OMERS Realty Corp., série 12, 1,3 %, 22 septembre 2023	1 690 509	1 715 645	
USD	155 000	Open Text Corp., 6,9 %, 1 ^{er} décembre 2027	206 569	209 283	
	225 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	224 625	208 870	
	2 495 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	2 448 578	2 461 461	
	775 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	763 734	755 010	
USD	730 000	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,45 %, 19 mai 2026	980 410	955 100	
	3 110 000	FPI RioCan, série AA, 3,21 %, 29 septembre 2023	3 078 438	3 092 326	
USD	990 000	Rogers Communications Inc., 2,95 %, 15 mars 2025	1 295 337	1 245 252	
	60 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	64 477	56 388	
	920 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 13 mars 2024	916 217	909 826	
	2 980 000	Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	3 000 095	2 961 465	
	700 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, restreint, 17 décembre 2081	682 000	636 731	
	235 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,75 %, 15 avril 2029	234 744	217 184	
	515 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	505 713	465 266	
	2 020 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	1 945 361	1 942 551	
	1 185 000	Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	1 185 000	1 186 604	
	680 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 novembre 2031	665 110	604 548	
USD	265 000	Sabre Global Inc., 11,25 %, 15 décembre 2027	349 852	297 742	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
	635 000	Saputo Inc., 2,83 %, 21 novembre 2023	622 452	628 926	
	1 120 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	1 078 202	1 080 101	
USD	244 903	SBA Senior Finance II LLC, taux variable, 11 avril 2025	304 256	324 731	
	315 000	Secure Energy Services Inc., 7,25 %, 30 décembre 2026	316 050	311 062	
	3 890 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	3 883 451	3 868 350	
	100 000	ShawCor Ltd., 9 %, 10 décembre 2026	100 000	104 094	
USD	884 000	Six Flags Theme Parks Inc., 7 %, 1 ^{er} juillet 2025	1 178 200	1 177 985	
USD	755 000	South32 Treasury Ltd., 4,35 %, 14 avril 2032	944 166	878 240	
	980 000	Tamarack Valley Energy Ltd., 7,25 %, 10 mai 2027	938 600	917 219	
USD	500 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 4,88 %, 1 ^{er} juin 2027	378 738	398 144	
USD	233 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 5,63 %, 6 décembre 2026	219 205	190 765	
	1 260 000	TELUS Corp., 3,35 %, 1 ^{er} avril 2024	1 236 539	1 239 608	
	335 000	TELUS Corp., série CZ, 2,75 %, 8 juillet 2026	343 041	312 591	
	1 000 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	1 003 736	943 598	
USD	1 731 525	Titan Acquisition Ltd. du Canada, taux variable, 28 mars 2025	2 158 826	2 244 613	
	2 055 000	Groupe TMX Limitée, 4,46 %, 3 octobre 2023	2 052 156	2 050 410	
	615 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,89 %, 8 mars 2028	579 084	534 526	
	425 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,9 %, 11 septembre 2028	360 995	364 941	
	760 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	779 089	723 042	
	850 000	Transcontinental Inc., restreint, 2,67 %, 3 février 2025	813 370	801 857	
USD	4 389 000	TransDigm Inc., 6,25 %, 15 mars 2026	5 721 957	5 790 796	
USD	255 000	TransDigm Inc., 6,38 %, 15 juin 2026	330 376	333 823	
USD	1 500 000	Trulieve Cannabis Corp., 8 %, 6 octobre 2026	1 705 163	1 472 440	
	3 565 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	3 492 158	3 444 425	
USD	65 000	U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,38 %, 1 ^{er} mars 2026	83 386	73 819	
USD	120 000	Unisys Corp., 6,88 %, 1 ^{er} novembre 2027	163 740	114 673	
	895 000	United Parcel Service Inc., 2,13 %, 21 mai 2024	889 796	870 524	
USD	725 000	United Rentals North America Inc., 3,88 %, 15 novembre 2027	899 834	894 694	
	15 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	14 924	12 813	
USD	960 000	Verizon Communications Inc., 4,33 %, 21 septembre 2028	1 229 484	1 226 593	
	1 470 000	Vidéotron ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	1 297 981	1 143 844	
	395 000	Vidéotron ltée, 3,63 %, 15 juin 2028	368 650	343 773	
USD	110 000	Viking Cruises Ltd., 5,88 %, 15 septembre 2027	128 438	134 104	
USD	180 000	Viking Cruises Ltd., 13 %, 15 mai 2025	245 398	250 542	
USD	130 000	VistaJet Malta Finance PLC/XO Management Holding Inc., 6,38 %, 1 ^{er} février 2030	158 156	138 830	
USD	1 645 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,55 %, 15 juillet 2024	2 138 242	2 105 160	
USD	190 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,7 %, 30 janvier 2027	223 128	230 617	
USD	1 305 000	Vistra Operations Co., LLC, 4,88 %, 13 mai 2024	1 702 200	1 697 141	
USD	470 000	Vital Energy Inc., 9,5 %, 15 janvier 2025	629 259	618 635	
	1 380 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	1 308 123	1 282 016	
	505 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	513 163	465 362	
	615 000	Wells Fargo & Co., 2,51 %, 27 octobre 2023	604 207	609 543	
	545 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 ^{er} mai 2026	513 303	513 023	
USD	1 120 000	Ziff Davis Inc., 4,63 %, 15 octobre 2030	1 209 610	1 287 132	
USD	700 000	Ziff Davis Inc., convertible, 1,75 %, 1 ^{er} novembre 2026	867 947	869 367	
			201 425 922	198 888 951	22,7
		ACTIONS ORDINAIRES			
USD	1 000	ACI Worldwide Inc.	42 090	30 694	
USD	1 000	Activision Blizzard Inc.	87 113	111 676	
USD	26 000	AdaptHealth Corp.	395 514	419 177	
USD	600	Alphabet Inc., catégorie A	84 612	95 143	
USD	115 635	Altice USA Inc., catégorie A	1 169 833	462 626	
USD	8 230	Amazon.com Inc.	1 127 223	1 421 274	
USD	6 100	Ball Corp.	429 423	470 394	
USD	3 000	BHP Group Ltd., CAAE	219 980	237 143	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
ACTIONS ORDINAIRES (suite)					
USD	13 700	Brighthouse Financial Inc.	888 068	859 359	
USD	2 000	CF Industries Holdings Inc.	187 707	183 928	
USD	650	Charles River Laboratories International Inc.	240 427	181 044	
USD	100	Charter Communications Inc., catégorie A	42 137	48 667	
USD	5 900	Citigroup Inc.	370 259	359 850	
USD	6 100	Clarivate Analytics PLC	137 119	77 012	
USD	5 800	Comcast Corp., catégorie A	299 642	319 251	
USD	50 500	Coupang Inc.	1 084 011	1 164 057	
	10 000	Cresco Labs Inc.	85 755	19 800	
	11 800	Curaleaf Holdings Inc.	120 704	48 262	
USD	29 950	DISH Network Corp., catégorie A	696 849	261 467	
USD	500	EPAM Systems Inc.	213 926	148 869	
USD	3 100	Expedia Group Inc.	393 587	449 235	
	100	Fairfax Financial Holdings Ltd.	96 698	99 229	
USD	4 000	First Advantage Corp.	68 185	81 658	
USD	8 000	Freeport-McMoRan Inc.	402 365	423 920	
USD	19 000	GoPro Inc., catégorie A	206 538	104 205	
	17 500	Green Thumb Industries Inc.	427 932	175 700	
USD	12 500	HireRight Holdings Corp.	168 931	187 287	
USD	3 500	Intel Corp.	224 043	155 049	
USD	300	IQVIA Holdings Inc.	80 028	89 329	
USD	100	Las Vegas Sands Corp.	4 579	7 684	
USD	8 000	Mosaic Co. (The)	496 634	370 930	
USD	12 500	Occidental Petroleum Corp.	980 627	973 691	
USD	15 900	Palantir Technologies Inc.	167 863	322 904	
USD	3 750	Paysafe Ltd.	229 908	50 125	
USD	100	Salesforce Inc.	28 954	27 987	
USD	20 200	Sonos Inc.	499 611	436 990	
USD	2 150	Spotify Technology SA	315 156	457 281	
USD	4 000	Sterling Check Corp.	60 169	64 966	
USD	2 800	Stronghold Digital Mining Inc.	339 479	15 505	
	32 600	Suncor Énergie Inc.	1 331 273	1 266 836	
	6 300	Ressources Teck Limitée, catégorie B	324 124	351 162	
USD	12 700	Tronox Holdings PLC, catégorie A	191 051	213 837	
USD	18 000	Under Armour Inc., catégorie C	211 376	160 003	
EUR	47 700	Universal Music Group NV	1 265 357	1 403 205	
USD	525	Vail Resorts Inc.	170 439	175 098	
USD	3 800	Walt Disney Co. (The)	526 175	449 440	
USD	25 500	Warner Bros Discovery Inc.	593 786	423 615	
USD	7 600	Warner Music Group Corp., catégorie A	274 644	262 677	
	40 000	WELL Health Technologies Corp.	180 695	190 000	
			18 182 599	16 309 241	1,9
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
USD	600	Fonds Consumer Staples Select Sector SPDR	58 505	58 954	
USD	2 000	Energy Select Sector SPDR Fund	235 773	215 060	
USD	5 100	FNB iShares Expanded Tech-Software Sector	2 066 130	2 337 046	
USD	22 350	iShares MSCI Brazil ETF	816 213	960 193	
	45 000	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	710 557	652 500	
USD	8 000	FNB SPDR S&P Global Natural Resources	590 547	571 338	
			4 477 725	4 795 091	0,5
FONDS					
USD	32 615	DoubleLine Opportunistic Credit Fund	704 402	626 930	
	30 000	Sprott Physical Uranium Trust	474 728	501 600	
			1 179 130	1 128 530	0,1
		Total de la (des) positions acheteur	1 096 084 346	1 076 643 559	122,7

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) VENDEUR					
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	(1 375 000)	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	(1 237 237)	(1 239 102)	(0,1)
ACTIONS ORDINAIRES					
USD	(18 000)	Apple Inc.	(4 125 983)	(4 625 312)	
USD	(7 600)	Ares Management Corp., catégorie A	(861 007)	(970 061)	
USD	(5 400)	AutoNation Inc.	(1 001 749)	(1 177 562)	
USD	(6 400)	D.R. Horton Inc.	(945 851)	(1 031 736)	
USD	(3 100)	General Mills Inc.	(332 412)	(314 986)	
USD	(700)	Mastercard Inc., catégorie A	(355 656)	(364 717)	
USD	(1 200)	Visa Inc., catégorie A	(364 874)	(377 522)	
			(7 987 532)	(8 861 896)	(1,0)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	(440 000)	Apple Inc., 1,4 %, 5 août 2028	(525 722)	(503 280)	
USD	(505 000)	Bombardier Inc., 7,88 %, 15 avril 2027	(661 551)	(668 164)	
USD	(435 000)	Calpine Corp., 4,5 %, 15 février 2028	(537 543)	(522 272)	
USD	(800 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} mars 2030	(939 499)	(907 349)	
USD	(980 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} février 2032	(1 075 870)	(1 060 090)	
USD	(905 000)	GFL Environmental Inc., 4,75 %, 15 juin 2029	(1 049 894)	(1 096 825)	
USD	(415 000)	HealthEquity Inc., 4,5 %, 1 ^{er} octobre 2029	(485 680)	(485 235)	
USD	(760 000)	MGM Resorts International, 4,75 %, 15 octobre 2028	(913 767)	(915 109)	
USD	(130 000)	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance, Corp., 4,5 %, 15 février 2029	(152 690)	(152 567)	
USD	(300 000)	Tenet Healthcare Corp., 4,88 %, 1 ^{er} janvier 2026	(389 376)	(387 464)	
USD	(215 000)	TransDigm Inc., 4,63 %, 15 janvier 2029	(242 875)	(253 698)	
USD	(686 000)	TransDigm Inc., 4,88 %, 1 ^{er} mai 2029	(816 344)	(812 823)	
USD	(275 000)	TransDigm Inc., 5,5 %, 15 novembre 2027	(352 017)	(344 036)	
USD	(1 335 000)	United Rentals North America Inc., 5,25 %, 15 janvier 2030	(1 697 215)	(1 689 883)	
USD	(305 000)	US Foods Inc., 4,75 %, 15 février 2029	(363 129)	(370 287)	
USD	(750 000)	Walt Disney Co. (The), 3,6 %, 13 janvier 2051	(827 907)	(790 134)	
USD	(290 000)	Wyndham Hotels & Resorts Inc., 4,38 %, 15 août 2028	(342 998)	(351 177)	
USD	(120 000)	Yum! Brands Inc., 5,38 %, 1 ^{er} avril 2032	(149 840)	(151 265)	
			(11 523 917)	(11 461 658)	(1,3)
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	(125 300)	FNB BMO Equal Weight Banks Index	(4 858 943)	(4 208 827)	
USD	(19 100)	iShares Core MSCI Europe ETF	(1 348 031)	(1 331 682)	
USD	(37 225)	SPDR S&P 500 ETF Trust	(20 644 154)	(21 859 830)	
USD	(12 000)	FNB VanEck Semiconductor	(1 942 371)	(2 420 318)	
			(28 793 499)	(29 820 657)	(3,4)
Total de la (des) position(s) vendeur			(49 542 185)	(51 383 313)	(5,8)
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			1 046 542 161	1 025 260 246	116,9
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(3 451)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			1 046 538 710	1 025 260 246	116,9
Contrat(s) de change à terme				4 338 153	0,5
Swap(s) sur défaillance				(956 277)	(0,1)
Total du portefeuille de placements			1 046 538 710	1 028 642 122	117,3
Autres actifs (passifs) nets				(151 797 345)	(17,3)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				876 844 777	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	237 033	EUR	164 294	1,44	(546)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	535 441 646	USD	400 628 540	1,34	4 787 231
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	1 331 750	USD	1 000 000	1,33	7 195
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	291 902	USD	219 735	1,33	851
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	80 149	USD	60 000	1,34	676
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	141 381	USD	106 427	1,33	413
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	38 784	USD	29 196	1,33	113
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	25 280	USD	19 000	1,33	113
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	10 298	USD	7 752	1,33	30
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	3 999	USD	3 000	1,33	25
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	512 345	USD	386 794	1,32	16
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	16 563	USD	12 500	1,33	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	120	USD	90	1,34	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	100	USD	76	1,32	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	119	USD	90	1,32	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	148	USD	112	1,32	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	118	USD	90	1,32	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	510	USD	387	1,32	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	164	USD	125	1,31	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	746	USD	566	1,32	(3)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	1 178	USD	893	1,32	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	2 511	USD	1 904	1,32	(11)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	9 245	USD	7 000	1,32	(27)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	19 741	USD	15 000	1,32	(127)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	66 065	USD	50 000	1,32	(163)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	26 299	USD	20 000	1,31	(192)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	121 098	USD	91 571	1,32	(193)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	151 008	USD	114 188	1,32	(241)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	231 810	USD	176 288	1,31	(1 693)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	EUR	2 285 080	CAD	3 291 342	0,69	13 010
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	176 288	CAD	231 810	0,76	1 693
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	32 728	CAD	43 088	0,76	262
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	114 188	CAD	151 008	0,76	240
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	27 467	CAD	36 161	0,76	220
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	91 571	CAD	121 098	0,76	193
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	20 000	CAD	26 299	0,76	192
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	50 000	CAD	66 065	0,76	163
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	15 000	CAD	19 741	0,76	127
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	9 572	CAD	12 602	0,76	77
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	7 000	CAD	9 245	0,76	27
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 679	CAD	3 527	0,76	21
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 475	CAD	1 942	0,76	12
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 904	CAD	2 511	0,76	11
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	893	CAD	1 178	0,76	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	566	CAD	746	0,76	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	125	CAD	164	0,76	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	387	CAD	510	0,76	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	90	CAD	118	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	41	CAD	54	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	90	CAD	119	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	112	CAD	148	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	76	CAD	100	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	90	CAD	120	0,75	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	12 500	CAD	16 563	0,75	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	386 794	CAD	512 345	0,75	(16)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 000	CAD	3 999	0,75	(25)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	19 000	CAD	25 280	0,75	(114)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	60 000	CAD	80 149	0,75	(676)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	235 707	CAD	314 926	0,75	(2 718)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	657 736	CAD	878 792	0,75	(7 585)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	665 217	CAD	888 788	0,75	(7 671)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 768 517	CAD	5 000 000	0,75	(8 394)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	11 316 826	CAD	15 000 000	0,75	(10 245)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 751 439	CAD	3 676 161	0,75	(31 730)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	6 658 547	CAD	8 896 396	0,75	(76 787)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 327 669	CAD	13 798 662	0,75	(119 099)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	17 907 273	CAD	23 925 670	0,75	(206 507)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								4 338 153

Swap(s) sur défaillance

Swap(s)	Nombre de contrats	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
Verse tous les trimestres 1,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX-NAIGS40 V1 5Y P 1 %	1	Citigroup Global Market Inc.	A+	20 juin 2028	48 250 000	(956 277)
Valeur totale du (des) swap(s) sur défaillance						(956 277)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	4 813	(475)	-	4 338
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	4 813	(475)	-	4 338
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(475)	475	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(956)	-	-	(956)
Total	(1 431)	475	-	(956)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	3 858	(417)	-	3 441
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	3 858	(417)	-	3 441
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(417)	417	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(417)	417	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	209 960	653	0,3
DoubleLine Opportunistic Credit Fund	278 597	627	0,2
Sprott Physical Uranium Trust	279 558	502	0,2
iShares MSCI Brazil ETF	1 391 669	960	0,1
FNB SPDR S&P Global Natural Resources	3 845 746	571	-
Energy Select Sector SPDR Fund	8 718 324	215	-
FNB iShares Expanded Tech-Software Sector	158 331 796	2 337	-
Fonds Consumer Staples Select Sector SPDR	7 279 448	59	-

au 31 décembre 2022

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB de bitcoins CI Galaxy	198 652	515	0,3
DoubleLine Opportunistic Credit Fund	322 671	656	0,2
FNB 3iQ CoinShares Bitcoin	258 324	404	0,2
FNB iShares Expanded Tech-Software Sector	5 950 048	1 091	-
iShares MSCI Brazil ETF	6 411 507	619	-
iShares Biotechnology ETF	11 847 084	622	-
Actions aurifères SPDR	73 135 197	6 133	-
FNB SPDR S&P Global Natural Resources	4 842 823	463	-
Sprott Physical Uranium Trust	4 572 080	237	-
VanEck Vectors Gold Miners ETF	16 214 799	310	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	13	26
Paiements indirects [†]	1	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	7 199 226	2 897 379	50 728	38 899	31 621 248	5 338 428	647 080	413 906
Parts rachetables émises	3 793 757	4 344 447	19 699	26 121	15 192 330	20 848 477	625 702	241 077
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	111 386	48 655	872	515	537 228	180 890	16 510	7 054
Parts rachetables rachetées	(1 898 818)	(1 670 332)	(2 124)	(4 525)	(7 244 296)	(3 102 424)	(203 761)	(221 566)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 205 551	5 620 149	69 175	61 010	40 106 510	23 265 371	1 085 531	440 471

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 931 765	1 704 155	678 219	630 000	198 227	20 649	24 505	1 013
Parts rachetables émises	2 155 957	4 108 595	6 206	9 190	141 136	395 626	-	23 513
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	135 271	75 958	17 041	13 396	5 728	4 066	25	21
Parts rachetables rachetées	(990 311)	(1 021 592)	(3 126)	(1 389)	(69 925)	(162 066)	64	(13)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	7 232 682	4 867 116	698 340	651 197	275 166	258 275	24 594	24 534

	Série W		Série WH		Série Y*		Série YH*	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 918 517	602 937	48 213	11 624	1 190 703	4 337 606	285 139	356 488
Parts rachetables émises	2 319 390	1 701 268	19 267	67 319	67 822	252 085	-	32 402
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	136 340	26 872	1 486	621	24 527	62 336	6 018	6 059
Parts rachetables rachetées	(1 142 947)	(141 482)	(2 095)	(23 508)	(180 694)	(1 342 648)	(18 797)	(33 966)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	6 231 300	2 189 595	66 871	56 056	1 102 358	3 309 379	272 360	360 983

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 450 000	840 000	580 000	260 000
Parts rachetables émises	3 810 000	1 170 000	680 000	240 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 000 000)	(480 000)	(360 000)	(240 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	11 260 000	1 530 000	900 000	260 000

*Auparavant Catégorie F et Catégorie F - Série USD 0818, respectivement.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,800	0,17
Série AH	1,800	0,17
Série F	0,800	0,17
Série FH	0,800	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série Y*	0,600	0,15
Série YH*	0,600	0,15
Série FNB en \$ CA	0,800	0,17
Série FNB couverte en \$ US	0,800	0,17

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	42 380
Garanties (hors trésorerie)	-	44 811

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	103	57
Charges	(31)	(25)
Revenu tiré des prêts de titres	72	32
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,4	44,0

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
	-
Placements	2022
FNB de bitcoins CI Galaxy	525

*Auparavant Catégorie F et Catégorie F - Série USD 0818, respectivement.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	52,0
Obligations étrangères	18,4
Obligations de sociétés	14,3
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	8,7
Placement(s) à court terme	5,5
Actions ordinaires	2,0
Autres actifs (passifs) nets	1,9
Fonds négocié(s) en bourse	1,5
Contrat(s) de change à terme	0,5
Fonds	0,1
Total de la (des) position(s) acheteur	104,9

Position(s) vendeur

Fonds négocié(s) en bourse	(3,0)
Obligations étrangères	(1,3)
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	(0,2)
Obligations de sociétés	(0,2)
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	(0,1)
Actions ordinaires	(0,1)
Total de la (des) position(s) vendeur	(4,9)
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	98,2
AA/Aa/A+	0,2
A	2,7
BBB/Baa/B++	10,2
BB/Ba/B+	6,7
B	1,7
CCC/Caa/C++	0,8
C et moins	0,1
Aucune	0,2
Total	120,8

Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	61,2
AA/Aa/A+	6,4
A	2,9
BBB/Baa/B++	14,3
BB/Ba/B+	12,1
B	1,7
CCC/Caa/C++	0,3
Aucune	0,5
Total	99,4

* Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

** Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des actions.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 1 645 000 \$ (375 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	505 362	(461 410)	43 952	5,0	
Euro	1 404	3 067	4 471	0,5	
Total	506 766	(458 343)	48 423	5,5	

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	477 037	(448 113)	28 924	4,2	
Euro	1 161	2 190	3 351	0,5	
Total	478 198	(445 923)	32 275	4,7	

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 4 842 000 \$ (3 228 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	67 064	296 111	262 833	415 702	1 041 710

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	110 778	145 091	175 664	231 487	663 020

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 12 658 000 \$ (6 895 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	16 309	-	-	16 309
Obligations	-	1 054 411	-	1 054 411
Fonds	1 128	-	-	1 128
Fonds négocié(s) en bourse	4 795	-	-	4 795
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	4 338	-	4 338
Swap(s)	-	(956)	-	(956)
Total	22 232	1 057 793	-	1 080 025

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(8 862)	-	-	(8 862)
Obligations	-	(12 701)	-	(12 701)
Fonds négocié(s) en bourse	(29 820)	-	-	(29 820)
Total	(38 682)	(12 701)	-	(51 383)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	13 534	-	-	13 534
Obligations	-	637 676	-	637 676
Placement(s) à court terme	-	37 853	-	37 853
Fonds	893	-	-	893
Fonds négocié(s) en bourse	10 157	-	-	10 157
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	3 441	-	3 441
Total	24 584	678 970	-	703 554

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(358)	-	-	(358)
Obligations	-	(12 508)	-	(12 508)
Fonds négocié(s) en bourse	(20 481)	-	-	(20 481)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	-	-	-	-
Total	(20 839)	(12 508)	-	(33 347)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	1 320 042	914 312
Placements donnés en garantie	1 343	5 322
Trésorerie	-	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	667	901
Swaps, options sur swaps et options	14	51
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	6 091	4 422
Rabais sur frais à recevoir	6	1
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	13 564	13 164
Dividendes à recevoir	13	14
Intérêts à recevoir	9 872	6 021
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	24 065	65 533
Montant à recevoir pour la souscription de parts	457	180
	1 376 134	1 009 921
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	725 991	498 072
Découvert bancaire	24 025	84 187
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 445	1 446
Swaps, options sur swaps et options	844	265
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	42
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	3 606	2 724
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	27 360	62 866
Montant à payer pour le rachat de parts	1 037	681
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	8	6
Frais d'administration à payer	2	1
Comptes créditeurs et charges à payer	216	33
Frais de rendement à payer	-	-
	784 534	650 323
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	591 600	359 598

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	10 963	11 659	9,04	8,97	1 212 608
Série AH	33	13	8,67*	8,59*	2 883	1 149
Série F	52 127	67 630	8,98	8,93	5 803 632	7 574 380
Série FH	13	361	8,64*	8,57*	1 185	31 127
Série I	225 516	224 828	8,93	8,88	25 244 100	25 297 590
Série IH	70	69	8,60*	8,54*	6 106	5 967
Série P	210	465	9,34	9,27	22 489	50 140
Série PH	415	413	8,59*	8,53*	36 501	35 693
Série W	13 148	11 261	8,58	8,53	1 533 163	1 320 593
Série WH	148	13	8,57*	8,50*	13 024	1 146
Série FNB en \$ CA	286 073	39 330	18,81	18,68	15 210 000	2 105 000
Série FNB couverte en \$ US	2 884	3 556	18,93*	18,75*	115 000	140 000

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH et FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	164	91
Intérêts aux fins des distributions	22 559	12 301
Distributions de revenu provenant des placements	-	21
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	99	999
Charge d'intérêts sur les swaps	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(794)	(697)
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(7 478)	(4 125)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(5 936)	(10 441)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	8 234	(12 825)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	16 848	(14 676)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(17)	(418)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	857	95
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	313	-
Total des autres revenus	1 153	(323)
Total des revenus	18 001	(14 999)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	1 230	794
Frais d'administration (note 5)	263	168
Primes de rendement (note 5)	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	36	76
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	1 774	1 656
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	1 758	80
Retenues d'impôts	4	-
Taxe de vente harmonisée	71	96
Autres frais	-	-
Total des charges	5 137	2 871
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	12 864	(17 870)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	227	(707)	0,18	(0,47)	1 268 575	1 508 124
Série AH	-	(1)	(0,28)	(0,36)	1 449	1 058
Série F	1 364	(5 369)	0,21	(0,45)	6 383 389	11 887 443
Série FH	3	(10)	0,34	(0,32)	10 092	29 902
Série I	6 335	(8 887)	0,25	(0,38)	25 387 804	23 419 164
Série IH	1	(1)	0,09	(0,26)	6 028	4 341
Série P	10	(2)	0,26	(0,40)	40 569	4 418
Série PH	3	(9)	0,08	(0,27)	36 047	32 446
Série W	344	(496)	0,23	(0,37)	1 517 999	1 330 000
Série WH	-	-	-	(0,27)	10 298	1 042
Série FNB en \$ CA	4 551	(2 198)	0,37	(0,82)	12 260 000	2 683 591
Série FNB couverte en \$ US	26	(190)	0,16	(0,72)	158 453	263 039

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	11 659	16 647	13	13	67 630	143 709
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	227	(707)	-	(1)	1 364	(5 369)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(144)	(170)	-	-	(941)	(1 751)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	(4)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(144)	(170)	-	-	(941)	(1 755)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	740	1 865	20	-	9 360	15 477
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	116	142	-	1	730	1 472
Rachat de parts rachetables	(1 635)	(4 131)	-	-	(26 016)	(54 876)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(779)	(2 124)	20	1	(15 926)	(37 927)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(696)	(3 001)	20	-	(15 503)	(45 051)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	10 963	13 646	33	13	52 127	98 658

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	361	369	224 828	234 364	69	53
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3	(10)	6 335	(8 887)	1	(1)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(1)	(5)	(5 171)	(4 696)	(2)	(1)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(81)	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1)	(5)	(5 171)	(4 777)	(2)	(1)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	20	-	3 289	3 319	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1	5	5 171	4 777	2	1
Rachat de parts rachetables	(371)	(6)	(8 936)	(3 459)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(350)	(1)	(476)	4 637	2	1
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(348)	(16)	688	(9 027)	1	(1)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13	353	225 516	225 337	70	52

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	465	55	413	396	11 261	12 947
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10	(2)	3	(9)	344	(496)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(7)	(1)	(9)	(8)	(285)	(247)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(7)	(1)	(9)	(8)	(285)	(247)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	235	2	-	-	3 751	2 630
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	7	1	8	8	285	247
Rachat de parts rachetables	(500)	(11)	-	-	(2 208)	(3 302)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(258)	(8)	8	8	1 828	(425)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(255)	(11)	2	(9)	1 887	(1 168)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	210	44	415	387	13 148	11 779

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	12 864	(17 870)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	5 936	10 441
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	354	707
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	36	76
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(8 234)	12 825
Produit de la vente, de l'échéance des placements, des dérivés et des ventes à découvert	4 775 407	3 999 689
Achats de placements et de dérivés et achats à des fins de couverture de positions à découvert	(4 940 145)	(3 884 749)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	(1 669)	(17 243)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	(42)	1 937
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	882	(95)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	(401)	13 130
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	1	(7)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(3 852)	(1 649)
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	-	(869)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	178	(96)
Amortissement des produits d'intérêts	(19)	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(158 702)	116 226
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(5 159)	(1 320)
Produit de l'émission de parts rachetables	276 556	31 658
Montant versé au rachat de parts rachetables	(52 179)	(85 984)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	219 218	(55 646)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(354)	(707)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	60 516	60 580
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(84 187)	(71 481)
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	(24 025)	(11 608)

Tableaux des flux de trésorerie (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	161	105
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	18 688	10 652
Dividendes payés*	(836)	(793)
Intérêts payés*	(8 042)	(2 268)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS			
	5 245 000	Air Lease Corp., 2,63 %, 5 décembre 2024	5 052 563	4 984 150	
	8 800 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	7 423 860	7 331 040	
	6 975 000	Algonquin Power Co., 4,6 %, 29 janvier 2029	6 790 601	6 710 245	
	5 100 000	FPI Allied Properties, série D, 3,39 %, 15 août 2029	4 351 259	4 354 197	
	2 347 000	FPI Allied Properties, série F, 3,12 %, 21 février 2030	1 927 433	1 941 823	
	8 170 000	FPI Allied Properties, série G, 3,13 %, 15 mai 2028	7 116 663	7 097 729	
	2 580 000	FPI Allied Properties, série H, 1,73 %, 12 février 2026	2 312 170	2 304 628	
	15 040 000	AltaGas Ltd., 1,23 %, 18 mars 2024	14 425 985	14 588 543	
	7 915 000	AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	6 801 624	6 836 363	
USD	7 000 000	Amgen Inc., 5,15 %, 2 mars 2028	9 571 236	9 269 011	
	12 308 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	11 006 076	10 808 592	
USD	2 520 000	Aroundtown SA, 5,38 %, 21 mars 2029	2 542 377	2 473 649	
	8 400 000	Artis REIT, série D, 3,82 %, 18 septembre 2023	8 243 760	8 339 262	
	12 857 000	Athene Global Funding, 1,25 %, 9 avril 2024	12 327 055	12 377 755	
	7 310 000	Athene Global Funding, 2,47 %, 9 juin 2028	6 392 042	6 244 538	
USD	3 870 000	Bacardi Ltd./Bacardi-Martini BV, 5,25 %, 15 janvier 2029	5 196 404	5 085 466	
USD	4 200 000	Bank of America Corp., taux variable, 4 février 2025	5 486 319	5 421 448	
USD	1 680 000	Bank of America Corp., taux variable, 14 juin 2029	1 938 317	1 896 209	
USD	9 680 000	Banque de Montréal, 5,3 %, 5 juin 2026	13 124 301	12 791 071	
USD	8 600 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 5,45 %, 12 juin 2025	11 526 045	11 335 143	
	15 050 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 5,5 %, 29 décembre 2025	15 043 099	15 053 853	
	5 880 000	BMW Canada Auto Trust, catégorie A2, série 23-1, 5,43 %, 21 septembre 2026	5 880 000	5 849 503	
USD	4 300 000	BNP Paribas SA, taux variable, 12 juin 2029	5 772 377	5 619 627	
	8 600 000	BNP Paribas SA, taux variable, 13 juillet 2029	7 407 309	7 362 726	
	12 200 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,41 %, 9 octobre 2029	11 257 982	10 937 294	
	2 670 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,62 %, 14 novembre 2027	2 712 766	2 684 323	
	1 580 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 5,88 %, 9 novembre 2032	1 666 780	1 645 903	
	8 600 000	HCA Inc., 5,54 %, 12 juin 2028	8 615 523	8 620 786	
	15 696 000	Capital Power Corp., 4,42 %, 8 février 2030	14 768 792	14 847 297	
	9 350 000	Capital Power Corp., 4,99 %, 23 janvier 2026	9 316 412	9 150 708	
	8 200 000	CARDS II Trust, 4,33 %, 15 mai 2025	8 078 148	8 010 664	
	7 000 000	Central 1 Credit Union, 2,58 %, 6 décembre 2023	6 893 180	6 911 442	
	4 030 000	Central 1 Credit Union, taux variable, 30 juin 2031	4 037 281	3 535 263	
	13 315 000	Chartwell, résidences pour retraités, 3,79 %, 11 décembre 2023	13 140 524	13 163 413	
	2 520 000	Chartwell, résidences pour retraités, série B, 4,21 %, 28 avril 2025	2 438 722	2 405 965	
	5 295 000	FPI Propriétés de Choix, 4,29 %, 8 février 2024	5 255 129	5 253 444	
	1 910 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	1 863 568	1 861 463	
	13 300 000	FPI Propriétés de Choix, série N, 2,98 %, 4 mars 2030	11 754 245	11 520 441	
	6 620 000	FPI Propriétés de Choix, série R, 6 %, 24 juin 2032	7 000 061	6 885 618	
	11 130 000	CNH Industrial Capital Canada Ltd., 1,5 %, 1 ^{er} octobre 2024	10 992 621	10 546 828	
	7 320 000	Coast Capital Savings Federal Credit Union, taux flottant, 27 octobre 2023	7 321 614	7 311 743	
	3 120 000	Cogeco Communications Inc., 5,3 %, 16 février 2033	3 131 240	3 087 396	
	10 223 000	Services financiers Co-operators limitée, 3,33 %, 13 mai 2030	8 985 515	8 683 594	
	1 055 000	Corus Entertainment Inc., 5 %, 11 mai 2028	1 011 802	759 600	
	2 450 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	2 450 000	1 730 313	
	3 880 000	FPI Crombie, série F, 3,68 %, 26 août 2026	3 711 241	3 640 022	
	5 000 000	FPI Crombie, série G, 3,92 %, 21 juin 2027	4 809 850	4 673 762	
	2 190 000	FPI Crombie, série H, 2,69 %, 31 mars 2028	1 915 046	1 913 972	
	9 125 000	FPI Crombie, série J, 3,13 %, 12 août 2031	7 663 175	7 515 713	
	3 360 000	CT REIT, 3,03 %, 5 février 2029	2 996 078	2 947 682	
USD	2 600 000	Daimler Trucks Finance North America LLC, 5,15 %, 16 janvier 2026	3 492 750	3 428 843	
USD	4 300 000	Dollar General Corp., 5,2 %, 5 juillet 2028	5 772 164	5 635 299	
	3 240 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	2 918 398	2 926 832	
	2 300 000	FPI industriel Dream, série B, taux flottant, 17 juin 2024	2 300 000	2 285 800	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
	5 460 000	FPI industriel Dream, série C, 2,06 %, 17 juin 2027	4 761 150	4 761 541	
	7 300 000	FPI industriel Dream, série D, restreint, 2,54 %, 7 décembre 2026	6 465 099	6 563 202	
	13 850 000	Summit Industrial Income LP, série D, 2,44 %, 14 juillet 2028	12 066 780	11 920 290	
	2 580 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série A, 1,55 %, 17 juin 2026	2 327 676	2 313 579	
	9 855 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série A, 2,22 %, 17 juillet 2024	9 485 864	9 513 790	
	9 460 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série A, 5,13 %, 17 juin 2028	9 476 521	9 444 147	
	21 510 000	Empire, Compagnie d'Assurance-Vie (L), taux variable, 13 janvier 2033	21 619 453	21 130 704	
	2 520 000	L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, taux variable, restreint, 24 septembre 2031	2 266 236	2 232 090	
	6 720 000	Enbridge Inc., 5,36 %, 26 mai 2033	6 745 318	6 748 407	
USD	4 140 000	Enbridge Inc., 5,7 %, 8 mars 2033	5 753 199	5 557 835	
	2 190 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,79 %, 17 août 2023	2 174 473	2 186 549	
	3 048 000	Banque Équitable, 1,77 %, 21 septembre 2023	3 009 168	3 021 536	
	6 190 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,7 %, 16 décembre 2026	6 090 038	5 958 749	
	4 510 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	4 524 500	4 427 069	
	9 360 000	FPI First Capital, série Q, 3,9 %, 30 octobre 2023	9 296 378	9 307 078	
	5 080 000	FPI First Capital, série S, 4,32 %, 31 juillet 2025	4 918 943	4 884 604	
	4 200 000	Ford Auto Securitization Trust, catégorie A2, série 23-A, 5,1 %, 15 octobre 2027	4 200 000	4 157 140	
	5 684 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 4,46 %, 13 novembre 2024	5 525 368	5 530 149	
	7 580 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	7 555 000	7 564 998	
	9 540 000	Fortified Trust, série A, 4,42 %, 23 décembre 2027	9 540 430	9 231 943	
USD	2 520 000	General Motors Financial Co., Inc., 5,4 %, 6 avril 2026	3 383 204	3 296 422	
	4 200 000	La Financière General Motors du Canada Ltée, 5,2 %, 9 février 2028	4 163 544	4 094 612	
	8 600 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 5,95 %, 14 mai 2024	8 611 438	8 618 120	
	16 480 000	Gibson Energy Inc., 3,6 %, 17 septembre 2029	15 021 637	14 930 841	
	6 020 000	Gibson Energy Inc., 5,8 %, 12 juillet 2026	6 017 652	6 022 402	
	860 000	Gibson Energy Inc., taux variable, 12 juillet 2083	860 000	866 638	
	26 445 000	Glacier Credit Card Trust, 3,14 %, 20 septembre 2023	26 202 543	26 319 861	
	8 600 000	Glacier Credit Card Trust, série 2019, 2,28 %, 6 juin 2024	8 326 778	8 338 561	
	6 020 000	GMF Canada Leasing Trust, catégorie A2, série 23-1, 5,79 %, 20 août 2026	6 020 000	6 013 209	
	8 058 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux flottant, 29 avril 2025	8 061 807	8 107 259	
	12 055 000	Société en commandite Holding FPI Granite, 2,38 %, 18 décembre 2030	9 831 371	9 800 323	
	8 455 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 3, 3,87 %, 30 novembre 2023	8 388 290	8 393 155	
	12 190 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	11 205 960	11 179 526	
	9 460 000	FPI H&R, 3,37 %, 30 janvier 2024	9 317 627	9 333 175	
	8 560 000	FPI H&R, série Q, 4,07 %, 16 juin 2025	8 226 298	8 199 832	
	1 680 000	FPI H&R, série R, 2,91 %, 2 juin 2026	1 558 956	1 533 740	
USD	5 040 000	HCA Inc., 5,2 %, 1 ^{er} juin 2028	6 831 277	6 621 610	
USD	2 520 000	HCA Inc., 5,9 %, 1 ^{er} juin 2053	3 454 233	3 279 093	
USD	10 140 000	HSBC Holdings PLC, taux variable, 20 juin 2034	13 552 617	13 383 953	
USD	4 200 000	Hyundai Capital America, 5,5 %, 30 mars 2026	5 769 917	5 515 025	
	10 320 000	iA Société financière Inc., taux variable, 20 juin 2033	10 343 108	10 343 721	
	8 400 000	Industrielle Alliance, Assurance et services financiers Inc., taux flottant, 15 septembre 2028	8 327 760	8 364 049	
	15 160 000	Inter Pipeline Ltd., 4,23 %, 1 ^{er} juin 2027	14 586 398	14 448 253	
	14 700 000	Inter Pipeline Ltd., 5,71 %, 29 mai 2030	14 711 760	14 733 635	
	6 340 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	5 557 995	5 574 666	
USD	430 000	Intesa Sanpaolo SPA, 6,63 %, 20 juin 2033	574 343	567 854	
	5 280 000	Banque Laurentienne du Canada, taux variable, 15 juin 2032	5 118 977	4 945 416	
	2 190 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 6,54 %, 17 février 2033	2 433 857	2 402 634	
	13 450 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 6,65 %, 8 novembre 2027	14 628 605	14 133 326	
	12 040 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 10 mars 2033	12 140 032	11 944 773	
USD	5 880 000	Mars Inc., 4,55 %, 20 avril 2028	7 897 485	7 667 329	
	6 020 000	Mercedes-Benz Finance Canada Inc., 5,12 %, 27 juin 2028	6 033 717	6 029 463	
	6 880 000	Mercedes-Benz Finance Canada Inc., 5,14 %, 29 juin 2026	6 888 660	6 877 255	
	7 740 000	Metropolitan Life Global Funding I, 5,18 %, 15 juin 2026	7 742 941	7 705 766	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	2 100 000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc., taux variable, 17 avril 2026	2 831 178	2 766 351	
	11 525 000	Molson Coors International LP, 2,84 %, 15 juillet 2023	11 438 421	11 514 662	
	23 000 000	Mondelez International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	22 216 414	22 152 220	
USD	8 220 000	Morgan Stanley Bank NA, 4,75 %, 21 avril 2026	11 104 270	10 727 441	
	15 000 000	Morgan Stanley, 3 %, 7 février 2024	14 685 135	14 786 565	
	16 740 000	Morgan Stanley, taux flottant, 21 mars 2025	16 741 649	16 614 149	
USD	1 680 000	Morgan Stanley, taux variable, 20 avril 2029	2 260 692	2 199 460	
USD	860 000	Nasdaq Inc., 5,35 %, 28 juin 2028	1 128 607	1 141 458	
USD	860 000	Nasdaq Inc., 5,65 %, 28 juin 2025	1 129 952	1 142 576	
	4 300 000	National Australia Bank Ltd., taux variable, 12 juin 2030	4 045 913	4 034 406	
	6 632 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	6 403 992	6 411 428	
	3 870 000	Northland Power Inc., taux variable, 30 juin 2083	3 852 026	3 886 780	
	12 000 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	11 792 040	11 838 689	
	8 600 000	Pembina Pipeline Corp., 5,72 %, 22 juin 2026	8 601 772	8 594 579	
	6 130 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 5,44 %, 8 décembre 2025	6 122 889	6 092 125	
USD	4 100 000	Philip Morris International Inc., 4,88 %, 13 février 2026	5 453 129	5 393 194	
	12 380 000	Reliance LP, 2,67 %, 1 ^{er} août 2028	10 921 247	10 779 037	
	11 971 000	Reliance LP, 2,68 %, 1 ^{er} décembre 2027	10 737 952	10 599 477	
	4 300 000	Reliance LP, 3,84 %, 15 mars 2025	4 154 832	4 151 639	
	9 020 000	RioCan FPI, 5,61 %, 6 octobre 2027	9 037 573	8 902 443	
	7 740 000	RioCan FPI, 5,96 %, 1 ^{er} octobre 2029	7 740 292	7 772 260	
	4 520 000	FPI RioCan, série AE, 2,83 %, 8 novembre 2028	3 946 319	3 887 061	
	6 025 000	Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	5 984 813	5 987 526	
	12 900 000	Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	12 900 000	12 917 463	
USD	4 300 000	Santander Holdings USA Inc., taux flottant, 12 juin 2029	5 727 389	5 592 029	
	7 206 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	7 290 702	7 165 894	
	5 220 000	Sienna Senior Living Inc., série A, 3,11 %, 4 novembre 2024	4 960 632	4 982 478	
	4 634 000	Sienna Senior Living Inc., série B, 3,45 %, 27 février 2026	4 392 646	4 294 175	
	1 668 750	Sienna Senior Living Inc., série C, 2,82 %, 31 mars 2027	1 526 021	1 482 714	
	4 200 000	SmartCentres FPI, 5,35 %, 29 mai 2028	4 202 503	4 108 014	
	10 000 000	SmartCentres REIT, série S, 3,83 %, 21 décembre 2027	9 417 930	9 210 387	
	5 000 000	SmartCentres REIT, série U, 3,53 %, 20 décembre 2029	4 382 810	4 374 418	
	11 680 000	SmartCentres REIT, série V, 3,19 %, 11 juin 2027	10 797 937	10 603 921	
	9 621 000	Stantec Inc., 2,05 %, 8 octobre 2027	8 554 371	8 447 675	
	8 600 000	Stantec Inc., 5,39 %, 27 juin 2030	8 615 996	8 654 950	
USD	4 200 000	T-Mobile USA Inc., 2,05 %, 15 février 2028	4 952 995	4 825 899	
	8 796 000	Industries Toromont Limitée, 3,71 %, 30 septembre 2025	8 660 822	8 472 964	
	19 017 000	Industries Toromont Limitée, 3,84 %, 27 octobre 2027	18 457 521	18 153 936	
USD	3 360 000	Tractor Supply Co., 5,25 %, 15 mai 2033	4 548 981	4 416 706	
	5 000 000	TransCanada PipeLines Ltd., 2,97 %, 9 juin 2031	4 280 750	4 256 218	
	17 140 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,42 %, 10 mars 2026	17 146 501	17 024 754	
	3 538 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,65 %, 20 juin 2029	3 581 270	3 546 588	
	15 860 000	Transcontinental Inc., 2,28 %, 13 juillet 2026	14 792 430	14 267 592	
	11 162 000	Transcontinental Inc., restreint, 2,67 %, 3 février 2025	10 899 898	10 529 804	
	6 880 000	Ventas Canada Finance Ltd., 5,4 %, 21 avril 2028	6 812 980	6 806 954	
	1 381 000	Ventas Canada Finance Ltd., série B, 4,13 %, 30 septembre 2024	1 353 242	1 349 551	
	5 160 000	Ventas Canada Finance Ltd., série G, 2,45 %, 4 janvier 2027	4 657 519	4 628 600	
	4 200 000	Vidéotron Ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	3 381 000	3 268 125	
	5 000 000	Vidéotron Ltée, 5,63 %, 15 juin 2025	4 964 500	4 966 719	
	4 200 000	Crédit VW Canada Inc., 2,05 %, 10 décembre 2024	3 989 580	3 983 879	
	11 300 000	Wells Fargo & Co., 3,18 %, 8 février 2024	11 036 644	11 141 167	
USD	4 200 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 24 avril 2034	5 648 169	5 528 650	
USD	6 560 000	Williams Cos., Inc. (La), 5,4 %, 2 mars 2026	8 902 729	8 668 620	
	7 480 000	WSP Global Inc., 2,41 %, 19 avril 2028	6 624 610	6 628 084	
			1 185 314 048	1 172 313 345	198,1

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	23 532 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} avril 2024	22 483 921	22 742 348	
	1 512 130	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} septembre 2025	1 409 643	1 390 744	
	3 118 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	2 996 086	2 999 935	
	5 224 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2026	4 843 239	4 862 503	
	52 064	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} décembre 2031	46 493	45 148	
	12 765 760	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} décembre 2053	9 565 855	9 421 909	
	25 665 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} septembre 2023	25 381 361	25 551 364	
	19 187 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} mars 2024	18 826 065	18 854 404	
	3 595 500	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	3 452 363	3 451 043	
	26 561 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	25 981 558	25 985 776	
	2 052 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	1 934 215	1 964 028	
	7 373 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	7 190 887	7 199 677	
	1 330 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} février 2025	1 329 920	1 310 496	
			125 441 606	125 779 375	21,3
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	165 100	FNB BMO échelonné actions privilégiées	1 738 563	1 452 880	
USD	37 500	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	5 300 831	5 113 866	
USD	8 100	iShares TIPS Bond ETF	1 154 867	1 154 814	
			8 194 261	7 721 560	1,3
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES					
USD	21 700	Obligation du Trésor américain, 2,63 %, 31 juillet 2029	27 086	26 552	
USD	153 500	Obligation du Trésor américain, 3 %, 15 août 2052	181 864	172 668	
USD	41 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 31 janvier 2030	53 827	52 698	
USD	1 863 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mars 2028	2 493 726	2 410 213	
USD	2 297 300	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mai 2028	2 970 330	2 976 062	
USD	1 293 000	Obligation du Trésor américain, 3,75 %, 15 avril 2026	1 682 487	1 676 302	
USD	32 000	Obligation du Trésor américain, 3,75 %, 31 mai 2030	42 491	41 789	
USD	16 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 novembre 2042	21 462	21 034	
USD	11 800	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 15 mars 2026	16 270	15 647	
			7 489 543	7 392 965	1,2
ACTIONS ORDINAIRES					
	9 700	AltaGas Ltd., privilégiées, série A, taux variable, perpétuelles	150 169	144 724	
	10 200	Banque de Montréal, privilégiées, catégorie B, série 29, taux variable, perpétuelles	181 509	174 726	
	8 700	Banque de Montréal, privilégiées, série 27, taux variable, perpétuelles	173 019	155 904	
	10 600	BCE Inc., privilégiées, série AB, taux flottant, perpétuelles	190 541	190 906	
	3 200	BCE Inc., privilégiées, série AC, taux variable, perpétuelles	57 872	56 800	
	5 200	BCE Inc., privilégiées, série AJ, taux flottant, perpétuelles	96 779	94 640	
	2 200	BCE Inc., privilégiées, série AQ, taux variable, perpétuelles	37 994	45 012	
	5 600	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, catégorie A, série 47, taux variable, perpétuelles	118 118	113 288	
	5 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, catégorie A, série 49, taux variable, perpétuelles	113 998	116 650	
	1 200	Capital Power Corp., privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	25 284	24 780	
	1 000	Enbridge Inc., 4 %, privilégiées, série H, perpétuelles	15 905	16 750	
	9 000	Enbridge Inc., privilégiées, série B, taux variable, perpétuelles	147 233	146 340	
	9 500	Enbridge Inc., privilégiées, série F, taux variable, perpétuelles	173 280	164 350	
	4 700	Fairfax Financial Holdings Ltd., 5 %, privilégiées, série K, perpétuelles	94 580	83 707	
	21 000	Fortis Inc., privilégiées, série M, taux variable, perpétuelles	385 148	347 550	
	9 500	Banque Laurentienne du Canada, 4,3 %, privilégiées, catégorie A, série 13, perpétuelles	155 610	145 825	
	3 500	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,3 %, privilégiées, série B, perpétuelles	82 950	74 515	
	8 000	Banque Nationale du Canada, privilégiées, série 40, taux variable, perpétuelles	163 375	162 640	
	18 300	Pembina Pipeline Corp., privilégiées, catégorie A, série 21, taux variable, perpétuelles	384 981	374 601	
	16 300	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	310 625	279 708	
	4 600	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	80 889	79 488	
	7 400	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	129 993	127 798	
	800	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 18, taux variable, perpétuelles	18 762	16 712	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
ACTIONS ORDINAIRES (suite)					
	8 050	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 20, taux variable, perpétuelles	171 278	178 630	
	12 100	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 22, taux variable, perpétuelles	279 161	284 229	
			3 739 053	3 600 273	0,6
PLACEMENT(S) À COURT TERME					
	4 600 000	Enbridge Inc., billet à escompte, 5,248 %, 14 juillet 2023	4 577 920	4 577 920	0,8
		Total de la (des) position(s) acheteur	1 334 756 431	1 321 385 438	223,3
POSITION(S) VENDEUR					
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
USD	(2 400)	Invesco Senior Loan ETF	(68 201)	(66 895)	
	(1 730 000)	iShares Canadian Corporate Bond Index ETF	(33 521 384)	(33 008 400)	
USD	(120 000)	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF	(12 309 443)	(11 933 878)	
			(45 899 028)	(45 009 173)	(7,6)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
	(6 580 000)	Banque de Montréal, 4,71 %, 7 décembre 2027	(6 639 352)	(6 453 154)	
	(4 900 000)	Bell Canada, 3 %, 17 mars 2031	(4 092 137)	(4 256 083)	
	(3 650 000)	Bell Canada, 3,5 %, 30 septembre 2050	(2 789 951)	(2 730 787)	
	(5 110 000)	Bell Canada, 3,55 %, 2 mars 2026	(4 787 814)	(4 886 347)	
	(5 000 000)	Bell Canada, 5,15 %, 9 février 2053	(4 975 350)	(4 925 195)	
	(5 040 000)	Brookfield Finance II Inc., 5,43 %, 14 décembre 2032	(5 125 504)	(4 987 446)	
	(3 360 000)	Brookfield Property Finance ULC, 7,13 %, 13 février 2028	(3 175 200)	(3 112 591)	
	(5 250 000)	Enbridge Inc., 4,24 %, 27 août 2042	(4 449 495)	(4 450 099)	
	(4 200 000)	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,23 %, 14 juin 2029	(3 938 424)	(3 890 424)	
	(1 250 000)	Hydro One Inc., série 43, 3,02 %, 5 avril 2029	(1 189 812)	(1 160 278)	
	(2 520 000)	FPI Primaris, 5,93 %, 29 mars 2028	(2 506 241)	(2 481 458)	
	(7 300 000)	Rogers Communications Inc., 3,25 %, 1 ^{er} mai 2029	(6 545 581)	(6 563 551)	
	(7 300 000)	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	(6 735 418)	(6 860 521)	
	(8 400 000)	Banque Royale du Canada, 1,83 %, 31 juillet 2028	(7 385 028)	(7 209 256)	
	(2 520 000)	Banque Royale du Canada, taux variable, 1 ^{er} février 2033	(2 507 123)	(2 445 043)	
	(5 060 000)	TELUS Corp., 2,85 %, 13 novembre 2031	(4 393 771)	(4 270 852)	
	(3 650 000)	TELUS Corp., série CAB, 3,95 %, 16 février 2050	(2 960 734)	(2 897 931)	
			(74 196 935)	(73 581 016)	(12,4)
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES					
USD	(10 400)	Obligation du Trésor américain, 0,63 %, 15 octobre 2024	(12 879)	(12 980)	
USD	(6 653 000)	Obligation du Trésor américain, 1,25 %, 30 novembre 2026	(8 387 811)	(7 940 124)	
USD	(25 000)	Obligation du Trésor américain, 1,25 %, 31 mars 2028	(31 247)	(28 978)	
USD	(1 050 000)	Obligation du Trésor américain, 1,38 %, 15 novembre 2031	(1 184 095)	(1 146 831)	
USD	(728 000)	Obligation du Trésor américain, 1,5 %, 31 janvier 2027	(910 695)	(873 514)	
USD	(4 712 000)	Obligation du Trésor américain, 1,88 %, 15 février 2032	(5 559 679)	(5 345 390)	
USD	(2 710 200)	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 31 juillet 2027	(3 437 559)	(3 384 174)	
USD	(358 000)	Obligation du Trésor américain, 3,25 %, 30 juin 2027	(469 024)	(456 068)	
USD	(4 346 000)	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	(5 631 396)	(5 550 008)	
USD	(737 000)	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 septembre 2025	(995 799)	(949 968)	
USD	(23 554 000)	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 30 avril 2028	(31 762 872)	(30 309 728)	
USD	(91 000)	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 30 avril 2030	(122 007)	(117 030)	
USD	(17 206 000)	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 février 2033	(23 390 289)	(22 195 315)	
USD	(9 660 000)	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2026	(12 916 400)	(12 484 656)	
USD	(42 000)	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mars 2030	(54 582)	(54 417)	
USD	(22 000)	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	(28 031)	(27 933)	
USD	(2 545 000)	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 30 avril 2025	(3 418 668)	(3 305 508)	
USD	(14 576 000)	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 15 janvier 2026	(19 436 261)	(18 948 256)	
USD	(18 592 000)	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 31 décembre 2027	(25 150 365)	(24 280 991)	
USD	(32 000)	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 15 février 2043	(42 570)	(41 273)	
USD	(3 460 000)	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 février 2026	(4 669 420)	(4 512 732)	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) VENDEUR (suite)					
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES (suite)					
USD	(2 589 000)	Obligation du Trésor américain, 4 %, 29 février 2028	(3 407 292)	(3 403 920)	
USD	(47 000)	Obligation du Trésor américain, 4 %, 28 février 2030	(64 059)	(62 205)	
USD	(67 000)	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 novembre 2052	(92 573)	(91 047)	
USD	(4 961 000)	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 30 septembre 2027	(6 662 169)	(6 534 218)	
USD	(1 638 000)	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 31 octobre 2027	(2 206 795)	(2 158 158)	
USD	(7 049 800)	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 31 mai 2025	(9 373 916)	(9 220 841)	
USD	(1 366 000)	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 15 octobre 2025	(1 820 619)	(1 789 392)	
			(171 239 072)	(165 225 655)	(27,9)
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	(37 450 610)	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	(33 708 556)	(33 749 171)	
	(21 250 000)	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} décembre 2030	(17 500 283)	(17 290 267)	
	(19 626 510)	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} septembre 2026	(18 132 365)	(17 911 838)	
	(98 205 000)	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} juin 2027	(89 726 344)	(88 691 824)	
	(2 706 000)	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	(2 561 473)	(2 562 815)	
	(12 325 200)	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	(11 329 932)	(11 234 020)	
	(46 837 000)	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} juin 2030	(40 903 828)	(40 733 123)	
	(10 528 000)	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	(9 252 715)	(9 187 639)	
	(55 706 650)	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	(52 608 721)	(51 929 725)	
	(846 000)	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2032	(776 599)	(761 363)	
	(76 038 000)	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	(72 628 070)	(71 396 171)	
	(2 720 000)	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} décembre 2032	(2 595 773)	(2 548 741)	
	(31 957 000)	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	(31 165 122)	(30 712 122)	
	(16 512 000)	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	(15 999 071)	(16 011 419)	
	(45 469 400)	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} mars 2028	(45 259 359)	(45 123 193)	
	(1 932 000)	Gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2033	(2 392 790)	(2 332 107)	
			(446 541 001)	(442 175 538)	(74,8)
Total de la (des) position(s) vendeur			(737 876 036)	(725 991 382)	(122,7)
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			596 880 395	595 394 056	100,6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(2 705)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			596 877 690	595 394 056	100,6
Contrat(s) de change à terme				(597 586)	(0,1)
Position(s) acheteur sur option(s)				13 618	0,0
Position(s) vendeur sur option(s)				(51 416)	(0,1)
Position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)				(847 747)	(0,1)
Position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)				666 818	0,1
Swap(s) sur défaillance				(792 541)	(0,1)
Total du portefeuille de placements			596 877 690	593 785 202	100,3
Autres actifs (passifs) nets				(2 184 728)	(0,3)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				591 600 474	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	626 931	USD	473 282	1,32	44
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	9 276	USD	7 000	1,33	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 164	CAD	1 532	0,76	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	415	CAD	547	0,76	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	201	CAD	264	0,76	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	55	CAD	72	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	28	CAD	37	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 174	CAD	13 593	0,75	(117)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	24 834	CAD	33 181	0,75	(286)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	52 216	CAD	69 765	0,75	(602)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	110 315	CAD	147 391	0,75	(1 272)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	311 779	CAD	416 563	0,75	(3 595)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 627 534	CAD	3 510 613	0,75	(30 302)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	05 juillet 2023	USD	20 712 230	CAD	28 000 000	0,74	(561 474)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(597 586)

Position(s) acheteur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devises	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
443	Fonds Consumer Staples Select Sector SPDR, (option de vente) – 70,00	100	21 juillet 2023	70,00	USD	18 425	8 803
160	iShares U.S. Home Construction ETF, (option de vente) – 53,00	100	21 juillet 2023	53,00	USD	17 906	1 060
162	iShares U.S. Home Construction ETF, (option de vente) – 67,00	100	21 juillet 2023	67,00	USD	29 095	1 073
810	KB Home, (option de vente) – 20,00	100	21 juillet 2023	20,00	USD	28 869	2 682
Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur option(s)						94 295	13 618

Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devises	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(100)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option d'achat) – 105,00	100	30 juin 2023	105,00	USD	(13 996)	(66)
(100)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option d'achat) – 106,00	100	21 juillet 2023	106,00	USD	(13 760)	(3 776)
(100)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option d'achat) – 107,00	100	18 août 2023	107,00	USD	(17 740)	(9 737)
(100)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option d'achat) – 108,00	100	15 septembre 2023	108,00	USD	(18 965)	(14 506)
(110)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option d'achat) – 113,00	100	30 juin 2023	113,00	USD	(16 200)	(73)
(95)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF, (option de vente) – 99,00	100	18 août 2023	99,00	USD	(12 976)	(8 243)
(81)	iShares TIPS Bond ETF, (option d'achat) – 109,00	100	15 septembre 2023	109,00	USD	(11 262)	(8 531)
(95)	iShares TIPS Bond ETF, (option de vente) – 107,00	100	21 juillet 2023	107,00	USD	(7 690)	(5 412)
(162)	iShares U.S. Home Construction ETF, (option de vente) – 60,00	100	21 juillet 2023	60,00	USD	(11 231)	(1 072)
Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)						(123 820)	(51 416)

Position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)

Contrat(s)	Nom du contrat à terme standardisé	Date d'expiration	Prix (\$)	Devises	Valeur du contrat (\$)	Juste valeur (\$)	Profit (perte) latent(e) (\$)
80	Contrats à terme sur les bons du Trésor américain à 10 ans	20 septembre 2023	119,46	USD	12 660 779	12 552 006	(108 773)
350	Contrat à terme sur bons des États-Unis à 10 ans	20 septembre 2023	113,86	USD	52 792 334	52 053 360	(738 974)
Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)						64 605 366	(847 747)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)

Contrat(s)	Nom du contrat à terme standardisé	Date d'expiration	Prix (\$)	Devise	Valeur du contrat (\$)	Juste valeur (\$)	Profit (perte) latent(e) (\$)
(55)	Contrat à terme sur obligations canadiennes à 10 ans	29 septembre 2023	123,24	CAD	(6 778 050)	(6 739 150)	38 900
(85)	CME, contrats à terme SOFR de 3 mois	19 mars 2024	94,85	USD	(26 701 164)	(26 642 047)	59 117
(540)	Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Canada à deux ans	20 septembre 2023	103,12	CAD	(55 685 100)	(55 255 500)	429 600
(50)	Bons du Trésor américain à 5 ans (CBT)	29 septembre 2023	109,20	USD	(7 232 824)	(7 093 622)	139 201
Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)						(95 730 319)	666 818

Swap(s) sur défaillance

Swap(s)	Nombre de contrats	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
Verse tous les trimestres 5,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX iTraxx s30 Xover 5Y V1 P 5 %	1	Wells Fargo Securities LLC	A+	20 décembre 2027	7 600 000	(281 206)
Verse tous les trimestres 1,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX CDX-NAIGS40 V1 P 1 %	1	Wells Fargo Securities LLC	A+	20 juin 2028	25 800 000	(511 335)
Valeur totale du (des) swap(s) sur défaillance						(792 541)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(598)	-	-	(598)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(793)	-	-	(793)
Total	(1 391)	-	-	(1 391)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	537	(123)	-	414
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	537	(123)	-	414
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(874)	123	-	(751)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(257)	-	-	(257)
Total	(1 131)	123	-	(1 008)

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
FINB BMO échelonné actions privilégiées	77 440	1 453	1,9
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	14 022 009	5 114	-
iShares TIPS Bond ETF	15 325 967	1 155	-

au 31 décembre 2022

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
FINB BMO échelonné actions privilégiées	1 605 640	1 526	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	36 707 374	1 483	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	20	51
Paiements indirects [†]	7	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 298 990	1 632 479	1 149	1 053	7 574 380	14 140 570	31 127	29 886
Parts rachetables émises	81 971	187 347	1 715	-	1 041 452	1 563 670	1 722	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	12 875	14 446	19	13	81 435	150 228	117	459
Parts rachetables rachetées	(181 228)	(415 841)	-	-	(2 893 635)	(5 554 798)	(31 781)	(500)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 212 608	1 418 431	2 883	1 066	5 803 632	10 299 670	1 185	29 845

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	25 297 590	23 154 854	5 967	4 301	50 140	5 228	35 693	32 162
Parts rachetables émises	367 826	336 867	-	-	25 132	163	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	580 130	490 545	139	92	804	79	808	665
Parts rachetables rachetées	(1 001 446)	(355 479)	-	-	(53 587)	(1 039)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	25 244 100	23 626 787	6 106	4 393	22 489	4 431	36 501	32 827

	Série W		Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 320 593	1 334 320	1 146	1 032	2 105 000	2 900 000	140 000	350 000
Parts rachetables émises	436 856	281 181	11 632	-	13 485 000	195 000	200 000	170 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	33 362	26 472	246	22	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(257 648)	(354 183)	-	-	(380 000)	(625 000)	(225 000)	(320 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 533 163	1 287 790	13 024	1 054	15 210 000	2 470 000	115 000	200 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,300	0,17
Série AH	1,300	0,17
Série F	0,800	0,17
Série FH	0,800	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série FNB en \$ CA	0,800	0,17
Série FNB couverte en \$ US	0,800	0,17

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	644
Garanties (hors trésorerie)	-	676

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	-
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	100,0	-

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
Obligations de sociétés	158,7
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	40,1
Obligations étrangères	37,2
Placement(s) à court terme	13,3
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	4,9
Fonds négocié(s) en bourse	0,8
Actions ordinaires	0,8
Option(s)	0,0
Swap(s) sur rendement total	0,0
Swap(s) sur défaillance	(0,1)
Contrat(s) à terme standardisé(s)	(0,1)
Contrat(s) de change à terme	(0,1)
Autres actifs (passifs) nets	(17,0)
Total de la (des) position(s) acheteur	238,5

Position(s) vendeur

Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	(72,7)
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	(49,1)
Obligations de sociétés	(12,0)
Fonds négocié(s) en bourse	(3,8)
Obligations étrangères	(0,9)
Option(s)	0,0
Total de la (des) position(s) vendeur	(138,5)
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	28,7
AA/Aa/A+	12,4
A	35,1
BBB/Baa/B++	123,7
BB/Ba/B+	9,3
B	8,0
CCC/Caa/C+	3,4
C et moins	0,3
Aucune	1,2
Total	222,1

Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	51,4
AA/Aa/A+	1,2
A	45,8
BBB/Baa/B++	149,2
BB/Ba/B+	7,5
Total	255,1

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des actions.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 3 369 000 \$ (780 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	(35 304)	29 480	(5 824)	(1,0)
Total	(35 304)	29 480	(5 824)	(1,0)

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	(217 476)	213 448	(4 028)	(1,1)
Total	(217 476)	213 448	(4 028)	(1,1)

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 582 000 \$ (403 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	312 307	234 988	(54 771)	136 557	629 081

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	306 459	166 427	(28 282)	(15 243)	429 361

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 980 000 \$ (835 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	3 600	-	-	3 600
Obligations	-	1 305 485	-	1 305 485
Placement(s) à court terme	-	4 578	-	4 578
Fonds négocié(s) en bourse	7 722	-	-	7 722
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(598)	-	(598)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	(848)	-	-	(848)
Option(s)	14	-	-	14
Swap(s)	-	(793)	-	(793)
Total	10 488	1 308 672	-	1 319 160

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	(680 982)	-	(680 982)
Fonds négocié(s) en bourse	(45 009)	-	-	(45 009)
Option(s)	(51)	-	-	(51)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	667	-	-	667
Total	(44 393)	(680 982)	-	(725 375)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	2 989	-	-	2 989
Obligations	-	865 901	-	865 901
Placement(s) à court terme	-	47 735	-	47 735
Fonds négocié(s) en bourse	3 009	-	-	3 009
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(338)	-	(338)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	(569)	-	-	(569)
Option(s)	51	-	-	51
Swaps	-	(257)	-	(257)
Total	5 480	913 041	-	918 521

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	-	-	-	-
Obligations	-	(484 275)	-	(484 275)
Fonds négocié(s) en bourse	(13 797)	-	-	(13 797)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	361	-	-	361
Option(s)	(8)	-	-	(8)
Total	(13 444)	(484 275)	-	(497 719)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Fonds alternatif multistratégie CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	3 680	343
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	415	4
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	2	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	25	51
	4 122	398
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	1
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	1	1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 121	397

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	140	130	10,29	9,75	13 631
Série AH	14	13	9,93*	9,38*	1 049	1 049
Série F	135	12	10,34	9,75	13 024	1 213
Série FH	14	13	9,98*	9,38*	1 053	1 052
Série I	95	11	10,36	9,76	9 193	1 106
Série IH	14	13	10,00*	9,39*	1 061	1 055
Série P	25	120	10,37	9,76	2 379	12 307
Série PH	14	13	10,00*	9,39*	1 060	1 054
Série W	3 656	58	10,69	10,06	342 083	5 726
Série WH	14	14	10,56*	9,92*	1 035	1 029

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH et WH est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	24	-
Intérêts aux fins des distributions	1	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1)	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	66	-
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	90	-
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	6	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	6	-
Total des revenus	96	-
Charges		
Frais de gestion (note 5)	1	-
Frais d'administration (note 5)	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	10	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	86	-

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	7	-	0,54	-	13 550	8 000
Série AH	1	-	0,45	-	1 049	1 000
Série F	3	-	0,73	-	4 245	1 000
Série FH	1	-	0,53	-	1 052	1 000
Série I	4	-	0,64	-	6 765	1 000
Série IH	1	-	0,61	-	1 056	1 000
Série P	6	-	0,61	-	10 331	1 000
Série PH	1	-	0,60	-	1 055	1 000
Série W	62	-	0,61	-	100 900	1 000
Série WH	-	-	0,64	-	1 030	1 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	130	-	13	-	12	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7	-	1	-	3	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	3	80	-	13	120	10
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	3	80	-	13	120	10
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10	-	1	-	123	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	140	80	14	13	135	10

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13	-	11	-	13	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	-	4	-	1	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(1)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(1)	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	13	81	10	-	13
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	1	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(1)	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	13	81	10	-	13
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	-	84	-	1	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	14	13	95	10	14	13

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	120	-	13	-	58	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6	-	1	-	62	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	(8)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	(6)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	(14)	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	154	10	-	13	3 599	10
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	14	-
Rachat de parts rachetables	(255)	-	-	-	(63)	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(101)	10	-	13	3 550	10
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(95)	-	1	-	3 598	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	25	10	14	13	3 656	10

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	14	-	397	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	86	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables				
Revenu net de placement	-	-	(9)	-
Profits nets réalisés	-	-	(6)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(15)	-
Transactions sur parts rachetables				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	13	3 957	185
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	15	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(319)	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	13	3 653	185
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	3 724	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	14	13	4 121	185

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	86	-
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(66)	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2	-
Achat de placements et de dérivés	(3 281)	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(2)	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(3 253)	-
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-	-
Produit de l'émission de parts rachetables	3 982	185
Montant versé au rachat de parts rachetables	(318)	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	3 664	185
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	411	185
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	415	185
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	24	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE				
24 200	Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI (série FNB en \$ CA)	470 068	464 882	
19 900	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	376 537	373 125	
17 600	Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI (série FNB en \$ CA)	351 244	380 864	
9 000	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	185 710	180 630	
4 900	FNB Biorévolution CI (parts ordinaires)	90 978	89 278	
4 700	FNB Sécurité numérique CI (parts ordinaires)	84 556	94 893	
5 700	FNB alpha Innovation mondiale CI (série FNB en \$ CA)	83 653	93 708	
4 000	Mandat privé d'infrastructures mondiales CI (série FNB en \$ CA)	94 233	93 780	
4 500	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI (parts ordinaires couvertes)	92 321	93 690	
4 500	Mandat privé d'immobilier mondial CI (série FNB en \$ CA)	93 076	91 530	
8 100	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires couvertes)	91 618	92 502	
20 600	Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret (série de FNB en \$ CA)	378 514	371 830	
26 900	Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	526 539	520 246	
2 600	FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires couvertes)	90 727	92 469	
18 300	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	442 314	463 356	
4 700	FNB d'actions privilégiées CI (parts ordinaires)	94 665	91 979	
5 300	FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI (parts ordinaires couvertes)	79 367	91 213	
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		3 626 120	3 679 975	89,3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(7 347)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés		3 618 773	3 679 975	89,3
Contrat(s) de change à terme			(611)	0,0
Total du portefeuille de placements		3 618 773	3 679 364	89,3
Autres actifs (passifs) nets			441 893	10,7
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			4 121 257	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	172	USD	131	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	187	USD	142	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	189	USD	144	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	181	USD	138	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	43	CAD	56	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	115	CAD	152	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	13	CAD	17	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	45	CAD	59	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	40	CAD	52	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	119	CAD	158	0,75	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	121	CAD	162	0,75	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	117	CAD	156	0,75	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 346	CAD	13 823	0,75	(119)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 413	CAD	13 913	0,75	(120)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 486	CAD	14 010	0,75	(121)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 472	CAD	13 991	0,75	(121)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 803	CAD	14 434	0,75	(124)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(611)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	-	-	(1)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	-	-	(1)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	-	-	(1)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	-	-	(1)

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB alpha Innovation mondiale CI	2 755	94	3,4
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	21 409	381	1,8
FNB Biorévolution CI	5 486	89	1,6
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	65 162	520	0,8
FNB Sécurité numérique CI	14 067	95	0,7
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	45 976	94	0,2
FNB d'actions privilégiées CI	54 538	92	0,2
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	56 081	92	0,2
FNB de produits de base généraux CI Auspice	113 413	181	0,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	103 989	93	0,1
Mandat privé d'immobilier mondial CI	111 496	92	0,1
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	489 214	372	0,1
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	591 600	373	0,1
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	876 845	465	0,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 515 209	463	-
CI Mandat privé mondial Infrastructure	347 136	94	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	640 137	91	-

au 31 décembre 2022

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB alpha Innovation mondiale CI	2 478	9	0,4
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	12 147	35	0,3
FNB Biorévolution CI	5 354	9	0,2
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI	8 814	10	0,1
FNB Sécurité numérique CI	10 925	8	0,1
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	97 745	49	0,1
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	56 031	10	-
FNB de produits de base généraux CI Auspice	103 812	18	-
FNB d'actions privilégiées CI	62 496	10	-
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	359 598	34	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	90 055	8	-
Mandat privé d'immobilier mondial CI	101 419	8	-
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	503 693	35	-
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	683 238	42	-
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 602 418	42	-
CI Mandat privé mondial Infrastructure	372 400	9	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	522 596	8	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	7	-
Paiements indirects [†]	2	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13 288	-	1 049	-	1 213	-	1 052	-
Parts rachetables émises	343	8 000	-	1 000	11 795	1 000	-	1 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	16	-	1	-
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 631	8 000	1 049	1 000	13 024	1 000	1 053	1 000

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 106	-	1 055	-	12 307	-	1 054	-
Parts rachetables émises	8 089	1 000	-	1 000	15 359	1 000	-	1 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	54	-	6	-	12	-	6	-
Parts rachetables rachetées	(56)	-	-	-	(25 299)	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 193	1 000	1 061	1 000	2 379	1 000	1 060	1 000

	Série W		Série WH	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 726	-	1 029	-
Parts rachetables émises	341 065	1 000	-	1 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	1 325	-	6	-
Parts rachetables rachetées	(6 033)	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	342 083	1 000	1 035	1 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,900	0,17
Série AH	1,900	0,17
Série F	0,900	0,17
Série FH	0,900	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI (série FNB en \$ CA)	465
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB \$ CA)	373
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI (Série FNB \$ CA)	381
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	181
FNB Biorévolution CI (parts ordinaires)	89
FNB Sécurité numérique CI (parts ordinaires)	95
FNB alpha Innovation mondiale CI (série FNB \$ CA)	94
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI (série FNB \$ CA)	94
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI (parts ordinaires couvertes)	94
Mandat privé d'immobilier mondial CI (série FNB \$ CA)	92
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires couvertes)	93
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret (série de FNB en \$ CA)	372
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	520
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires couvertes)	92
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	463
FNB d'actions privilégiées CI (parts ordinaires)	92
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI (parts ordinaires couvertes)	91

Placements	2022
	-

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	12,7
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI (série FNB en \$ CA)	11,3
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	11,2
Autres actifs (passifs) nets	10,7
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI (série FNB en \$ CA)	9,2
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	9,1
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret (série de FNB en \$ CA)	9,0
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4,4
FNB Sécurité numérique CI (parts ordinaires)	2,3
FNB alpha Innovation mondiale CI (série FNB en \$ CA)	2,3
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI (série FNB en \$ CA)	2,3
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI (parts ordinaires couvertes)	2,3
FNB Biorévolution CI (parts ordinaires)	2,2
Mandat privé d'immobilier mondial CI (série FNB en \$ CA)	2,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires couvertes)	2,2
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires couvertes)	2,2
FNB d'actions privilégiées CI (parts ordinaires)	2,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI (parts ordinaires couvertes)	2,2
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

au 31 décembre 2022

Fonds	Actif net (%)
Autres actifs (passifs) nets	13,8
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	12,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	10,6
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI (série FNB en \$ CA)	10,6
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI (série FNB en \$ CA)	8,8
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret (série de FNB en \$ CA)	8,7
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	8,5
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4,6
FNB d'actions privilégiées CI (parts ordinaires)	2,5
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI (parts ordinaires couvertes)	2,5
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires couvertes)	2,5
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI (série FNB en \$ CA)	2,4
FNB Biorévolution CI (parts ordinaires)	2,2
FNB alpha Innovation mondiale CI (série FNB en \$ CA)	2,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires couvertes)	2,1
Mandat privé d'immobilier mondial CI (série FNB en \$ CA)	2,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI (parts ordinaires couvertes)	2,0
FNB Sécurité numérique CI (parts ordinaires)	2,0
Contrat(s) de change à terme	(0,2)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 368 000 \$ (34 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	-	70	70	1,7
Total	-	70	70	1,7

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	-	67	67	16,9
Total	-	67	67	16,9

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 7 000 \$ (7 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds négocié(s) en bourse	3 680	-	-	3 680
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(1)	-	(1)
Total	3 680	(1)	-	3 679

Fonds alternatif multistratégie CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds négocié(s) en bourse	343	-	-	343
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(1)	-	(1)
Total	343	(1)	-	342

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	17 914	12 220
Placements donnés en garantie	2 328	-
Trésorerie	1 107	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	3
Swaps, options sur swaps et options	190	74
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	54	-
Dividendes à recevoir	6	10
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	3
	21 599	12 310
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	3
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	59	66
Swaps, options sur swaps et options	43	55
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	7	20
Frais de rendement à payer	54	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	27	19
	190	163
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	21 409	12 147

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	1 874	1 620	10,68	8,61	175 513
Série AH	14	11	10,63*	8,55*	1 016	1 016
Série F	491	158	10,88	8,72	45 091	18 061
Série FH	15	12	10,84*	8,67*	1 017	1 017
Série I	8 871	1 451	11,08	8,85	800 570	163 890
Série IH	806	1 091	11,13*	8,89*	54 634	90 665
Série P	821	560	11,07	8,84	74 171	63 384
Série PH	189	155	11,14*	8,89*	12 787	12 839
Série W	1 499	1 319	10,86	8,68	138 008	151 986
Série WH	682	557	10,93*	8,74*	47 129	47 097
Série FNB en \$ CA	1 079	436	21,57	17,44	50 000	25 000
Série FNB couverte en \$ US	5 068	4 777	21,86*	17,64*	175 000	200 000

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH et FNB en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	70	240
Intérêts aux fins des distributions	12	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	240	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1	(2 664)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3 369	(11 440)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	3 692	(13 864)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(20)	(83)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	19	198
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
Total des autres revenus	-	115
Total des revenus	3 692	(13 749)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	42	233
Frais d'administration (note 5)	7	45
Primes de rendement (note 5)	54	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	30
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	1	-
Charge d'intérêts	-	7
Retenues d'impôts	9	34
Taxe de vente harmonisée	9	10
Autres frais	-	-
Total des charges	132	360
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 560	(14 109)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	376	(417)	2,07	(2,50)	181 603	166 883
Série AH	3	(3)	2,50	(3,02)	1 016	1 016
Série F	61	(47)	1,75	(2,46)	34 874	19 280
Série FH	3	(3)	2,61	(2,97)	1 017	1 017
Série I	1 262	(578)	1,93	(2,27)	655 200	254 770
Série IH	152	(209)	2,71	(2,80)	56 376	74 715
Série P	146	(106)	2,25	(2,10)	64 758	50 331
Série PH	35	(27)	2,73	(2,53)	12 824	10 552
Série W	335	(515)	2,15	(2,44)	155 501	211 272
Série WH	125	(124)	2,66	(2,88)	47 098	42 974
Série FNB en \$ CA	134	(9 604)	4,29	(4,56)	31 354	2 105 939
Série FNB couverte en \$ US	928	(2 476)	5,25	(5,82)	176 519	425 414

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 620	997	11	13	158	204
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	376	(417)	3	(3)	61	(47)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	158	1 498	-	-	783	178
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(280)	(513)	-	-	(511)	(218)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(122)	985	-	-	272	(40)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	254	568	3	(3)	333	(87)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 874	1 565	14	10	491	117

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12	14	1 451	1 604	1 091	760
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3	(3)	1 262	(578)	152	(209)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(4)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(5)	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(9)	-	(1)	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	6 853	1 610	-	396
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	9	-	1	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(695)	(277)	(437)	(1)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	6 167	1 333	(436)	395
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3	(3)	7 420	755	(285)	186
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	15	11	8 871	2 359	806	946

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	560	45	155	67	1 319	2 185
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	146	(106)	35	(27)	335	(515)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	(1)	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	196	635	-	97	885	262
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	1	-
Rachat de parts rachetables	(81)	(26)	(1)	(1)	(1 040)	(406)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	115	609	(1)	96	(154)	(144)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	261	503	34	69	180	(659)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	821	548	189	136	1 499	1 526

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	557	548	436	43 754	4 777	10 834
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	125	(124)	134	(9 604)	928	(2 476)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	(171)	(9)	(32)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(1)	-	-	-	(11)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1)	-	-	(171)	(20)	(32)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	65	509	27 188	656	4 630
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	(30 737)	(1 273)	(4 534)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1	65	509	(3 549)	(617)	96
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	125	(59)	643	(13 324)	291	(2 412)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	682	489	1 079	30 430	5 068	8 422

	Total du Fonds	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12 147	61 025
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 560	(14 109)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(13)	(203)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(19)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(32)	(203)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	10 040	36 559
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	12	-
Rachat de parts rachetables	(4 318)	(36 713)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5 734	(154)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 262	(14 466)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	21 409	46 559

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 560	(14 109)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1)	2 664
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(4)	46
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	30
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3 369)	11 440
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 629	38 363
Achat de placements et de dérivés	(9 421)	(41 892)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	(54)	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	4	7
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	54	(21)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	9	(30)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(4 584)	(3 502)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(21)	(203)
Produit de l'émission de parts rachetables	10 043	36 529
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4 332)	(36 712)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	5 690	(386)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	4	(46)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 106	(3 888)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(3)	5 037
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	1 107	1 103
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	66	213
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	12	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(7)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	1 624	Adobe Inc.	906 112	1 052 010	
USD	2 579	Analog Devices Inc.	588 197	665 574	
USD	3 986	Apple Inc.	807 580	1 024 250	
USD	1 355	Applied Materials Inc.	242 621	259 455	
	217	Constellation Software Inc.	451 327	595 613	
	2 940	Kinaxis Inc.	461 583	556 542	
USD	726	KLA Corp.	365 247	466 477	
	8 521	Lightspeed Commerce Inc.	302 659	190 956	
USD	2 081	Microsoft Corp.	804 458	938 802	
USD	2 540	Salesforce Inc.	538 088	710 862	
	10 260	Shopify Inc., catégorie A	1 070 366	878 461	
USD	7 422	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	1 020 324	992 275	
	6 090	Topicus.com Inc.	575 612	661 679	
			8 134 174	8 992 956	42,1
SOINS DE SANTÉ					
USD	6 434	Centene Corp.	592 766	574 906	
USD	4 569	Edwards Lifesciences Corp.	553 519	570 959	
USD	924	Eli Lilly and Co.	534 921	574 064	
USD	719	Humana Inc.	410 612	425 889	
USD	731	Thermo Fisher Scientific Inc.	513 557	505 259	
USD	924	UnitedHealth Group Inc.	563 134	588 336	
			3 168 509	3 239 413	15,1
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	2 924	AMETEK Inc.	520 332	627 053	
USD	3 771	Jacobs Solutions Inc.	617 819	593 931	
USD	1 735	United Rentals Inc.	843 712	1 023 657	
	3 569	WSP Global Inc.	564 755	624 646	
			2 546 618	2 869 287	13,4
SERVICES FINANCIERS					
USD	1 160	Mastercard Inc., catégorie A	529 254	604 388	
USD	1 362	S&P Global Inc.	709 576	723 330	
USD	1 862	Visa Inc., catégorie A	508 231	585 788	
			1 747 061	1 913 506	8,9
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	7 036	Amazon.com Inc.	1 214 060	1 215 078	
USD	877	Lululemon Athletica Inc.	407 031	439 743	
USD	1 733	Starbucks Corp.	219 780	227 421	
			1 840 871	1 882 242	8,8
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	2 342	Activision Blizzard Inc.	235 617	261 546	
USD	4 926	Alphabet Inc., catégorie A	772 465	781 129	
			1 008 082	1 042 675	4,9
MATÉRIAUX					
USD	3 139	Sociedad Química y Minera de Chile SA, CAAE	307 801	301 982	1,4
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			18 753 116	20 242 061	94,6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(6 355)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			18 746 761	20 242 061	94,6
Contrat(s) de change à terme				(58 547)	(0,3)
Position(s) acheteur sur option(s)				190 011	0,9
Position(s) vendeur sur option(s)				(42 591)	(0,2)
Total du portefeuille de placements			18 746 761	20 330 934	95,0
Autres actifs (passifs) nets				1 077 886	5,0
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				21 408 820	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	231	USD	176	1,31	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	232	USD	176	1,31	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	420	USD	319	1,32	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	1 260	USD	956	1,32	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	2 960	USD	2 252	1,31	(23)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	10 212	USD	7 771	1,31	(81)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	12 593	USD	9 583	1,31	(100)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	65 948	USD	50 183	1,31	(523)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	42 440	CAD	56 117	0,76	98
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	7 459	CAD	9 863	0,76	17
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	6 471	CAD	8 557	0,76	15
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	582	CAD	767	0,76	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 809	CAD	2 392	0,76	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	337	CAD	443	0,76	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	138	CAD	183	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	143	CAD	189	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	53	CAD	70	0,76	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	172	CAD	229	0,75	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	179	CAD	239	0,75	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 356	CAD	3 144	0,75	(24)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	8 174	CAD	10 910	0,75	(83)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 088	CAD	13 465	0,75	(103)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 431	CAD	13 936	0,75	(120)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 646	CAD	14 224	0,75	(123)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	53 883	CAD	71 922	0,75	(551)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	138 009	CAD	184 391	0,75	(1 591)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	498 927	CAD	666 610	0,75	(5 754)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	589 112	CAD	787 104	0,75	(6 794)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 711 656	CAD	4 959 094	0,75	(42 803)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(58 547)

Position(s) acheteur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par		Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
		contrat	Date d'expiration				
274	Activision Blizzard Inc., (option d'achat) – 90,00	100	18 août 2023	90,00	USD	77 334	74 048
35	Amazon.com Inc., (option de vente) – 80,00	100	18 août 2023	80,00	USD	16 990	185
16	Apple Inc., (option de vente) – 130,00	100	18 août 2023	130,00	USD	7 220	191
155	Bank of America Corp., (option d'achat) – 31,00	100	15 septembre 2023	31,00	USD	26 738	8 624
7	Eli Lilly and Co., (option de vente) – 390,00	100	15 septembre 2023	390,00	USD	12 306	1 665
10	Home Depot Inc. (Le), (option d'achat) – 310,00	100	15 septembre 2023	310,00	USD	17 570	16 857
16	Humana Inc., (option d'achat) – 490,00	100	19 janvier 2024	490,00	USD	52 492	38 471
60	International Business Machines Corp., (option de vente) – 110,00	100	20 octobre 2023	110,00	USD	28 345	4 292
106	Invesco QQQ Trust, série 1, (option de vente) – 280,00	100	18 août 2023	280,00	USD	85 699	2 879
100	Invesco QQQ Trust, série 1, (option de vente) – 300,00	100	15 septembre 2023	300,00	USD	78 635	12 121
48	Invesco QQQ Trust, série 1, (option de vente) – 330,00	100	20 octobre 2023	330,00	USD	34 410	25 372
90	SPDR S&P 500 ETF Trust, (option de vente) – 375,00	100	18 août 2023	375,00	USD	79 177	5 306
Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur option(s)						516 916	190 011

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(10)	NVIDIA Corp., (option de vente) – 425,00	100	18 août 2023	425,00	USD	(34 917)	(31 761)
(30)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE, (option d'achat) – 102,00	100	21 juillet 2023	102,00	USD	(15 587)	(10 830)
Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)						(50,504)	(42 591)

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(59)	-	-	(59)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(59)	-	-	(59)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	3	(3)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	3	(3)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(66)	3	-	(63)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(66)	3	-	(63)

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	5	20
Paiements indirects [†]	2	9

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	188 029	93 505	1 016	1 016	18 061	19 141	1 017	1 017
Parts rachetables émises	16 072	155 553	-	-	80 018	18 877	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(28 588)	(54 877)	-	-	(52 988)	(23 629)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	175 513	194 181	1 016	1 016	45 091	14 389	1 017	1 017

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	163 890	149 900	90 665	56 396	63 384	4 233	12 839	4 955
Parts rachetables émises	705 894	168 673	-	33 433	18 933	65 531	-	7 997
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	849	-	58	-	34	-	5	-
Parts rachetables rachetées	(70 063)	(30 445)	(36 089)	(125)	(8 180)	(2 829)	(57)	(51)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	800 570	288 128	54 634	89 704	74 171	66 935	12 787	12 901

	Série W		Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	151 986	207 936	47 097	41 266	25 000	2 050 000	200 000	400 000
Parts rachetables émises	92 629	29 498	-	5 831	25 000	1 500 000	25 000	200 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	96	-	32	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(106 703)	(47 485)	-	-	-	(1 675 000)	(50 000)	(200 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	138 008	189 949	47 129	47 097	50 000	1 875 000	175 000	400 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,900	0,17
Série AH	1,900	0,17
Série F	0,900	0,17
Série FH	0,900	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série FNB en \$ CA	0,900	0,17
Série FNB couverte en \$ US	0,900	0,17

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
Technologies de l'information	44,3
Produits industriels	15,8
Biens de consommation discrétionnaire	14,2
Soins de santé	11,7
Services de communication	6,8
Services Financiers	5,3
Services publics	2,5
Option(s)	0,6
Autres actifs (passifs) nets	(0,2)
Contrat(s) de change à terme	(0,5)
Total de la (des) position(s) acheteur	100,5

Position(s) vendeur

Option(s)	(0,5)
Total de la (des) position(s) vendeur	(0,5)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 2 024 000 \$ (1 222 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	17 450	6 799	24 249	113,3
Total	17 450	6 799	24 249	113,3

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	10 366	6 643	17 009	140,0
Total	10 366	6 643	17 009	140,0

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 425 000 \$ (1 701 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	20 242	-	-	20 242
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(59)	-	(59)
Option(s)	190	-	-	190
Total	20 432	(59)	-	20 373

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Option(s)	(43)	-	-	(43)
Total	(43)	-	-	(43)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	12 220	-	-	12 220
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(63)	-	(63)
Option(s)	74	-	-	74
Total	12 220	(63)	-	12 231

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Option(s)	(55)	-	-	(55)
Total	(55)	-	-	(55)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	112 769	97 004
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	92	2 955
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	9	1 559
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	3 662	2 353
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	11	1
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	31	-
	116 574	103 872
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3 159	3
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	2	42
Frais d'administration à payer	-	8
Comptes créditeurs et charges à payer	-	7
	3 161	60
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	113 413	103 812

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	473	-	9,67	-	48 948
Série F	319	-	9,68	-	32 924	-
Série I	10	-	9,69	-	1 000	-
Série P	14	-	9,68	-	1 499	-
Série W	10	-	9,69	-	1 000	-
Parts ordinaires couvertes	112 587	103 812	20,02	20,26	5 625 000	5 125 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

États financiers (non audité)

État du résultat global

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023
Revenu	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	-
Intérêts aux fins des distributions	150
Distributions de revenu provenant des placements	2 428
Distributions de gains en capital provenant des placements	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	4 376
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(4 707)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	2 247
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(36)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
Total des autres revenus	(36)
Total des revenus	2 211
Charges	
Frais de gestion (note 5)	293
Frais d'administration (note 5)	56
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	23
Frais du comité d'examen indépendant	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	-
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	45
Autres frais	-
Total des charges	418
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 793

État du résultat global (suite)

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie : 2023	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2023	Nombre moyen pondéré de parts : 2023
Série A	(13)	(0,54)	23 804
Série F	(8)	(0,75)	10 176
Série I	-	(0,31)	1 000
Série P	-	(0,32)	1 382
Série W	-	(0,32)	1 000
Parts ordinaires couvertes	1 814	0,33	5 512 569

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

États financiers (non audité)

État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A 2023	Série F 2023	Série I 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	-	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(13)	(8)	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables			
Revenu net de placement	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-
Transactions sur parts rachetables			
Produit de l'émission de parts rachetables	486	327	10
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	486	327	10
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	473	319	10
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	473	319	10

	Série P 2023	Série W 2023	Parts ordinaires couvertes 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	-	-	103 812
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	1 814
Distributions aux porteurs de parts rachetables			
Revenu net de placement	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(3 249)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(3 249)
Transactions sur parts rachetables			
Produit de l'émission de parts rachetables	14	10	24 180
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(13 970)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	14	10	10 210
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	14	10	8 775
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	14	10	112 587

	Total du Fonds 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	103 812
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 793
Distributions aux porteurs de parts rachetables	
Revenu net de placement	-
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	(3 249)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 249)
Transactions sur parts rachetables	
Produit de l'émission de parts rachetables	25 027
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	(13 970)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	11 057
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 601
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	113 413

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

États financiers (non audité)

Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 793
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4 376)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	13
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	23
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	4 707
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	18 638
Achat de placements et de dérivés	(27 623)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(2 428)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(10)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(41)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(8)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(6)
Amortissement des produits d'intérêts	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(10 626)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 249)
Produit de l'émission de parts rachetables	24 995
Montant versé au rachat de parts rachetables	(13 970)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	7 776
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(13)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(2 850)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	2 955
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	92
Informations supplémentaires :	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	140
Dividendes payés*	-
Intérêts payés*	-
Impôts à recouvrer (payés)	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS SOUS-JACENT(S)				
11 178 021	Fonds marché monétaire CI (série I)	111 780 206	111 780 206	98,5
PLACEMENT(S) À COURT TERME				
1 000 000	Gouvernement du Canada, obligation du Trésor, 3,637 %, 6 juillet 2023	988 400	988 400	0,9
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		112 768 606	112 768 606	99,4
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-	-	-
Total du portefeuille de placements avant les dérivés		112 768 606	112 768 606	99,4
Contrat(s) de change à terme			5 000	-
Position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)			(3 155 438)	(2,8)
Total du portefeuille de placements		112 768 606	109 618 168	96,6
Autres actifs (passifs) nets			3 794 996	3,4
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			113 413 164	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	CAD	1 238 652	USD	937 014	1,32	(2 332)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	456 738	CAD	601 277	0,76	3 629
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	387 013	CAD	510 709	0,76	1 852
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	146 427	CAD	192 413	0,76	1 515
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	510 910	CAD	675 500	0,76	1 149
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	33 009	CAD	43 359	0,76	358
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	315 168	CAD	417 672	0,75	(263)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	21 juillet 2023	USD	428 275	CAD	568 116	0,75	(908)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								5 000

Position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)

Contrat(s)	Nom du contrat à terme standardisé	Date d'expiration	Prix (\$)	Devise	Valeur du contrat (\$)	Juste valeur (\$)	Profit (perte) latent(e) (\$)
243	Contrats à terme sur cuivre	14 septembre 2023	616,01	USD	9 915 075	7 862 756	(2 052 319)
61	Contrats à terme sur l'or de 100 onces	29 août 2023	1 985,57	USD	16 045 319	15 591 433	(453 886)
54	Contrats à terme sur l'argent	27 septembre 2023	23,03	USD	8 237 428	8 233 851	(3 577)
256	Marchés à terme mondiaux n° 11	28 juin 2024	22,80	USD	8 660 118	8 014 462	(645 656)
Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur contrat(s) à terme standardisé(s)						39 702 502	(3 155 438)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	9	(4)	-	5
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	9	(4)	-	5
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(4)	4	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(4)	4	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	7	(3)	-	4
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	7	(3)	-	4
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(3)	3	-	-

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
Fonds marché monétaire CI	856 490	111 780	13,1

au 31 décembre 2022

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
Fonds marché monétaire CI (série I)	814 483	96 015	11,8

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects [†]	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Série A 2023	Série F 2023	Série I 2023	Série P 2023
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	-	-	-	-
Parts rachetables émises	48 948	32 924	1 000	1 499
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	48 948	32 924	1 000	1 499

	Série W 2023	Parts ordinaires couvertes 2023
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	-	5 125 000
Parts rachetables émises	1 000	1 175 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(675 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 000	5 625 000

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,520	0,10
Série F	0,520	0,10
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,10
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,05
Parts ordinaires couvertes	0,520	0,10

Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-

Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds marché monétaire CI (série I)	111 780

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

The table/tables below summarizes/summarize the Underlying Fund's exposure to concentration risk.

au 30 juin 2023

Catégories	Net Assets (%)
Placement(s) à court terme	81,5
Obligations de sociétés	8,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,0
Titres adossés à des actifs	3,4
Autres actifs (passifs) nets	(0,7)
Total	100,0

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Placement(s) à court terme	60,5
Services financiers	17,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	13,0
Titres adossés à des actifs	5,3
Biens de consommation discrétionnaire	2,5
Produits industriels	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,9
Total	0,9

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,0
Total	1,0

De plus, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds avait une exposition indirecte au risque de crédit du fonds sous-jacent.

Le fonds sous-jacent investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	15,8
AA/Aa/A+	17,0
A	52,7
BBB/Baa/B++	8,2
Total	93,7

Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	8,6
AA/Aa/A+	28,3
A	36,3
BBB/Baa/B++	13,5
Total	86,7

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des contrats à terme sur matières premières.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des contrats à terme sur matières premières du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 3 970 000 \$ (6 267 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

De plus, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix du fonds sous-jacent.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le fonds sous-jacent n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de change puisque la plupart de ses placements étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds avait une exposition indirecte au risque de change du fonds sous-jacent.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les actifs du fonds sous-jacent étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds et du fonds sous-jacent. Par conséquent, le Fonds et le fonds sous-jacent n'étaient pas exposés au risque de change.

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	988	-	-	-	988

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds de produits de base généraux CI Auspice

(auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt (suite)

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	989	-	-	-	989

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds avait une exposition indirecte au risque de taux d'intérêt du fonds sous-jacent.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le fonds sous-jacent était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des placements à court terme. L'exposition des placements à court terme au risque de taux d'intérêt est peu importante en raison de leur courte durée à l'échéance.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Placement(s) à court terme	-	988	-	988
Fonds sous-jacent(s)	111 780	-	-	111 780
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	5	-	5
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	(3 155)	-	-	(3 155)
Total	108 625	993	-	109 618

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Placement(s) à court terme	-	988	-	989
Fonds sous-jacent(s)	96 015	-	-	96 015
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	4	-	4
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	1 552	-	-	1 552
Total	97 567	989	-	98 560

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des périodes closes les 30 juin 2023 et 31 décembre 2022.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	464 750	461 425
Placements donnés en garantie	186 756	151 826
Trésorerie	-	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2 624	2 709
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	1 006	214
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	4	4
Intérêts à recevoir	4 046	4 561
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1 266	3
Montant à recevoir pour la souscription de parts	633	1 548
	661 085	622 290
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	28 813	28 279
Découvert bancaire	139 194	87 705
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	202	259
Swaps, options sur swaps et options	533	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	57	38
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	135	186
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	1 669	1 150
Montant à payer pour le rachat de parts	1 202	907
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	8	16
Frais d'administration à payer	2	4
Comptes créditeurs et charges à payer	56	53
Frais de rendement à payer	-	-
	171 871	118 597
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	489 214	503 693

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	38 152	41 340	9,19	9,23	4 150 814
Série AH	383	435	8,73*	8,75*	33 139	36 704
Série F	212 271	219 878	9,14	9,18	23 234 768	23 961 421
Série FH	6 082	6 585	8,80*	8,82*	521 966	551 561
Série I	32 273	36 992	8,99	9,03	3 589 102	4 095 083
Série IH	275	600	8,61*	8,63*	24 162	51 311
Série P	380	350	8,50	8,54	44 648	41 001
Série PH	12 163	12 170	8,41*	8,43*	1 092 331	1 066 622
Série W	114 550	108 939	8,47	8,51	13 523 220	12 798 745
Série WH	195	194	8,39*	8,41*	17 522	17 071
Série FNB en \$ CA	70 073	73 116	18,08	18,16	3 875 000	4 025 000
Série FNB couverte en \$ US	2 417	3 094	18,25*	18,28*	100 000	125 000

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH et FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	82	124
Intérêts aux fins des distributions	9 996	12 026
Distributions de revenu provenant des placements	-	277
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(82)	-
Charge d'intérêts sur les swaps	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(231)	(99)
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(265)	(285)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	3 682	(9 980)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	234	(65 482)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	13 416	(63 419)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(356)	921
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	35	114
Rabais sur frais	1	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	3
Total des autres revenus	(319)	1 038
Total des revenus	13 097	(62 381)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	1 481	2 107
Frais d'administration (note 5)	348	476
Primes de rendement (note 5)	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	50
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	63	42
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	1 905	172
Retenues d'impôts	7	-
Taxe de vente harmonisée	194	280
Autres frais	-	-
Total des charges	4 013	3 128
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 084	(65 509)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	608	(4 978)	0,14	(0,92)	4 367 605	5 419 136
Série AH	(1)	(41)	(0,04)	(0,86)	33 811	47 784
Série F	3 800	(28 387)	0,16	(0,88)	24 075 930	32 302 072
Série FH	(13)	(799)	(0,03)	(0,85)	537 676	941 770
Série I	957	(8 985)	0,24	(0,82)	3 921 547	10 946 011
Série IH	15	(129)	0,38	(1,30)	39 909	98 550
Série P	7	(293)	0,16	(0,82)	43 500	357 530
Série PH	23	(862)	0,03	(0,79)	1 077 078	1 099 761
Série W	2 347	(11 079)	0,17	(0,78)	13 443 303	14 248 883
Série WH	1	(20)	0,03	(0,75)	17 267	26 642
Série FNB en \$ CA	1 348	(9 133)	0,34	(1,75)	3 926 381	5 210 083
Série FNB couverte en \$ US	(8)	(803)	(0,07)	(1,82)	124 586	440 746

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	41 340	62 169	435	532	219 878	328 007
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	608	(4 978)	(1)	(41)	3 800	(28 387)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(684)	(352)	(7)	(4)	(4 299)	(2 674)
Profits nets réalisés	-	(289)	-	(3)	-	(2 192)
Remboursement de capital	(73)	(1)	(1)	-	(460)	(5)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(757)	(642)	(8)	(7)	(4 759)	(4 871)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	4 850	5 971	-	256	34 086	91 177
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	708	600	6	5	3 004	3 211
Rachat de parts rachetables	(8 597)	(15 863)	(49)	(179)	(43 738)	(100 810)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 039)	(9 292)	(43)	82	(6 648)	(6 422)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 188)	(14 912)	(52)	34	(7 607)	(39 680)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	38 152	47 257	383	566	212 271	288 327

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	6 585	13 771	36 992	114 735	600	5 451
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(13)	(799)	957	(8 985)	15	(129)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(126)	(89)	(867)	(1 216)	(11)	(9)
Profits nets réalisés	-	(73)	-	(999)	-	(8)
Remboursement de capital	(13)	-	(93)	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(139)	(162)	(960)	(2 215)	(12)	(17)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	382	1 047	4 402	21 024	-	183
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	99	109	955	1 867	12	12
Rachat de parts rachetables	(832)	(4 070)	(10 073)	(33 892)	(340)	(4 676)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(351)	(2 914)	(4 716)	(11 001)	(328)	(4 481)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(503)	(3 875)	(4 719)	(22 201)	(325)	(4 627)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	6 082	9 896	32 273	92 534	275	824

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	350	1 302	12 170	13 280	108 939	132 525
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7	(293)	23	(862)	2 347	(11 079)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(9)	(14)	(292)	(143)	(2 769)	(1 457)
Profits nets réalisés	-	(61)	-	(117)	-	(1 194)
Remboursement de capital	(1)	-	(31)	-	(296)	(3)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(10)	(75)	(323)	(260)	(3 065)	(2 654)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	55	3 999	235	89	28 954	34 793
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	10	69	277	202	3 064	2 653
Rachat de parts rachetables	(32)	(3 822)	(219)	(793)	(25 689)	(34 214)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	33	246	293	(502)	6 329	3 232
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	30	(122)	(7)	(1 624)	5 611	(10 501)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	380	1 180	12 163	11 656	114 550	122 024

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	194	323	73 116	114 553	3 094	11 752
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	(20)	1 348	(9 133)	(8)	(803)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(5)	(3)	(1 421)	(849)	(61)	(90)
Profits nets réalisés	-	(3)	-	(696)	-	(74)
Remboursement de capital	(1)	-	(152)	(2)	(7)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(6)	(6)	(1 573)	(1 547)	(68)	(164)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	49	-	1 831	5 032	-	638
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	5	6	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(48)	(119)	(4 649)	(16 847)	(601)	(2 446)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	6	(113)	(2 818)	(11 815)	(601)	(1 808)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	(139)	(3 043)	(22 495)	(677)	(2 775)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	195	184	70 073	92 058	2 417	8 977
	Total du Fonds					
	2023	2022				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	503 693	798 400				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 084	(65 509)				
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(10 551)	(6 900)				
Profits nets réalisés	-	(5 709)				
Remboursement de capital	(1 129)	(11)				
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(11 680)	(12 620)				
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	74 844	164 209				
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	8 140	8 734				
Rachat de parts rachetables	(94 867)	(217 731)				
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(11 883)	(44 788)				
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(14 479)	(122 917)				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	489 214	675 483				

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 084	(65 509)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(3 682)	9 980
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	148	(1 327)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	50
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(234)	65 482
Produit de la vente, de l'échéance des placements, des dérivés et des ventes à découvert	612 810	1 210 812
Achats de placements et de dérivés et achats à des fins de couverture de positions à découvert	(646 768)	(1 352 351)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	(792)	1 088
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	19	104
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	(51)	(9)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	51 955
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	19
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	515	(835)
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(9)	(2)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	-
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	(4)
Amortissement des produits d'intérêts	(42)	(22)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(28 987)	(80 569)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 539)	(3 886)
Produit de l'émission de parts rachetables	75 757	165 558
Montant versé au rachat de parts rachetables	(94 572)	(222 387)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(22 354)	(60 715)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(148)	1 327
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(51 341)	(141 284)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(87 705)	94 665
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	(139 194)	(45 292)

Tableaux des flux de trésorerie (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	76	420
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10 469	11 169
Dividendes payés*	(212)	(109)
Intérêts payés*	(2 221)	(354)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR					
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES					
USD	6 630 000	Obligation du Trésor américain, 1,88 %, 28 février 2027	8 230 096	8 049 910	
USD	16 939 000	Obligation du Trésor américain, 1,88 %, 15 février 2032	19 908 014	19 215 952	
USD	8 890 000	Obligation du Trésor américain, 2,38 %, 31 mars 2029	11 089 440	10 750 678	
USD	3 390 000	Obligation du Trésor américain, 2,5 %, 31 mars 2027	4 251 786	4 208 116	
USD	3 070 000	Obligation du Trésor américain, 2,63 %, 31 juillet 2029	3 883 417	3 756 398	
USD	5 015 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 30 avril 2027	6 437 190	6 274 848	
USD	4 070 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 31 juillet 2027	5 164 895	5 082 129	
USD	4 585 000	Obligation du Trésor américain, 3 %, 31 juillet 2024	5 880 369	5 921 299	
USD	4 585 000	Obligation du Trésor américain, 3 %, 15 août 2052	4 938 326	5 157 543	
USD	950 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2027	1 230 909	1 203 428	
USD	6 610 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2029	8 504 686	8 315 689	
USD	29 140 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	37 295 340	37 212 896	
USD	14 250 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 31 janvier 2028	18 905 692	18 327 949	
USD	6 665 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2026	8 925 149	8 613 896	
USD	11 015 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mai 2028	14 335 260	14 269 500	
USD	5 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mars 2030	6 719	6 478	
USD	2 320 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	3 066 150	2 945 681	
USD	1 044 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2053	1 328 564	1 327 069	
USD	3 805 000	Obligation du Trésor américain, 3,75 %, 15 avril 2026	5 113 508	4 932 969	
USD	1 415 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 31 mars 2025	1 883 576	1 837 470	
USD	4 175 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 30 avril 2025	5 638 652	5 422 591	
USD	9 475 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 30 juin 2028	12 496 468	12 478 459	
USD	17 730 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 30 septembre 2027	24 272 448	23 352 487	
USD	12 884 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 novembre 2032	18 075 280	17 433 443	
USD	17 470 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 31 octobre 2024	23 528 113	22 864 939	
USD	1 330 000	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 novembre 2025	1 798 945	1 752 764	
USD	230 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 28 février 2025	315 584	302 324	
USD	1 778 059	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	2 204 121	2 073 029	
USD	2 087 860	Obligation du Trésor américain, indexées sur l'inflation, 0,63 %, 15 juillet 2032	2 615 024	2 541 866	
			261 323 721	255 631 800	52,3
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	3 030 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	2 721 008	2 730 529	
	14 899 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} décembre 2030	13 919 053	12 122 715	
	1 580 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	1 505 318	1 496 397	
	945 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	876 953	861 337	
	3 930 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	3 771 653	3 781 188	
	535 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2026	501 247	497 978	
	34 975 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	34 431 327	30 522 196	
	46 770 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} décembre 2031	41 820 148	40 557 309	
	965 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	904 881	899 573	
	605 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2032	540 169	544 474	
	15 189 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} décembre 2051	15 245 863	12 025 866	
	225 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	211 984	211 265	
	5 385 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	5 269 655	5 268 379	
	27 930 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} décembre 2032	26 537 706	26 171 443	
	1 255 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	1 211 075	1 206 112	
	47 810 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	45 359 291	45 760 326	
	5 780 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	5 683 404	5 644 125	
	3 045 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	2 975 082	2 952 687	
	14 705 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} mars 2028	14 742 158	14 593 035	
	12 940 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	12 778 924	12 753 410	
			231 006 899	220 600 344	45,1

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	458 000	1375209 BC Ltd., 9 %, 30 janvier 2028	616 242	608 528	
USD	1 161 000	Alexander Funding Trust, 1,84 %, 15 novembre 2023	1 436 822	1 504 522	
	3 125 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	3 217 554	3 044 886	
USD	390 000	Altice France SA, 5,5 %, 15 janvier 2028	501 084	390 834	
USD	70 000	American Tower Corp., 1,45 %, 15 septembre 2026	78 479	81 655	
	695 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	713 122	674 085	
USD	250 000	Aramark Services Inc., 5 %, 1 ^{er} avril 2025	332 269	326 738	
USD	606 113	Aramark Services Inc., taux variable, 11 mars 2025	801 914	802 948	
USD	1 493 000	Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc., 4,13 %, 15 août 2026	1 851 827	1 844 559	
	3 730 000	AT&T Inc., 2,85 %, 25 mai 2024	3 790 594	3 640 928	
USD	300 000	Bank of America Corp., taux variable, 13 février 2031	401 385	332 750	
USD	785 000	Bank of America Corp., taux variable, 23 juillet 2031	980 093	828 288	
USD	305 000	Bank of America Corp., taux variable, 21 septembre 2036	360 773	308 510	
	1 205 000	Banque de Montréal, 2,85 %, 6 mars 2024	1 175 513	1 184 353	
	875 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	870 809	813 101	
	660 000	Banque de Montréal, taux variable, 26 novembre 2080	664 213	606 141	
	1 150 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janvier 2025	1 149 506	1 088 896	
	1 310 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	1 348 566	1 241 390	
USD	1 035 000	Bausch Health Cos. Inc., 5,5 %, 1 ^{er} novembre 2025	1 323 276	1 213 369	
USD	394 000	Bausch Health Cos. Inc., 11 %, 30 septembre 2028	438 802	370 586	
USD	134 000	Bausch Health Cos. Inc., 14 %, 15 octobre 2030	106 770	106 510	
	775 000	BCI QuadReal Realty, série 1, 1,68 %, 3 mars 2025	778 439	727 899	
	785 000	Bell Canada, 2,5 %, 14 mai 2030	811 797	670 464	
	1 435 000	Bell Canada, 2,7 %, 27 février 2024	1 411 949	1 410 091	
	1 080 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	1 036 176	1 035 453	
	485 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	498 963	468 442	
USD	205 000	Brightsphere Investment Group Inc., 4,8 %, 27 juillet 2026	260 051	254 557	
USD	495 000	Cablevision Lightpath LLC, 3,88 %, 15 septembre 2027	550 150	550 061	
	950 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	947 838	859 440	
	750 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	775 507	722 754	
	300 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, convertibles, taux variable, 28 octobre 2080	301 619	275 683	
	3 320 000	Canadian Natural Resources Ltd., 1,45 %, 16 novembre 2023	3 318 584	3 274 198	
	3 435 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 1,59 %, 24 novembre 2023	3 372 002	3 385 322	
	350 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,15 %, 13 mars 2029	320 950	320 349	
	835 000	La Société Canadian Tire Limitée, 3,17 %, 6 juillet 2023	846 965	835 046	
USD	1 635 000	CANPACK SA/Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,88 %, 15 novembre 2029	2 056 340	1 765 532	
USD	360 000	Carnival Corp., 4 %, 1 ^{er} août 2028	399 011	424 411	
USD	210 000	Carnival Corp., 7,63 %, 1 ^{er} mars 2026	243 662	272 724	
USD	230 000	Carnival Holdings Bermuda Ltd., 10,38 %, 1 ^{er} mai 2028	312 500	333 533	
USD	200 000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp/Millennium Operations LLC, 5,5 %, 1 ^{er} mai 2025	262 205	262 804	
	900 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	898 596	780 989	
USD	970 459	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 30 avril 2025	1 305 044	1 286 419	
USD	424 726	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 1 ^{er} février 2027	546 376	559 958	
USD	1 380 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,3 %, 1 ^{er} février 2032	1 448 017	1 384 322	
USD	230 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,8 %, 1 ^{er} avril 2031	244 623	245 177	
	455 000	FPI Propriétés de Choix, série B, 4,9 %, 5 juillet 2023	454 527	455 086	
	835 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	835 000	759 885	
USD	800 000	CHS/Community Health Systems Inc., 8 %, 15 mars 2026	1 037 722	1 031 551	
USD	1 020 000	CITGO Petroleum Corp., 7 %, 15 juin 2025	1 308 629	1 327 125	
USD	10 000	Citigroup Inc., 4 %, 5 août 2024	13 235	12 979	
USD	275 000	Citigroup Inc., taux variable, 3 novembre 2032	339 969	293 610	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	360 000	Citigroup Inc., taux variable, 25 janvier 2033	457 120	398 132	
USD	220 000	Coeur Mining Inc., 5,13 %, 15 février 2029	275 247	240 751	
USD	440 000	Columbia Care Inc., 9,5 %, 3 février 2026	558 140	522 779	
USD	880 000	CommScope Technologies LLC, 6 %, 15 juin 2025	1 135 585	1 088 154	
	840 000	Corus Entertainment Inc., 5 %, 11 mai 2028	840 000	604 800	
	955 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	955 000	674 469	
USD	565 000	Cox Communications Inc., 2,95 %, 1 ^{er} octobre 2050	734 913	470 004	
USD	175 000	CSC Holdings LLC, 11,25 %, 15 mai 2028	235 489	225 088	
USD	1 055 000	CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15 novembre 2031	1 215 078	975 693	
USD	250 000	CSC Holdings LLC, 5,5 %, 15 avril 2027	284 215	276 051	
	445 000	CT REIT, 3,03 %, 5 février 2029	445 000	390 392	
USD	1 445 000	Curaleaf Holdings Inc., 8 %, 15 décembre 2026	1 839 970	1 502 697	
	530 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	518 215	503 146	
USD	293 873	DIRECTV Financing LLC, taux variable, 2 août 2027	365 832	381 468	
USD	1 100 000	DISH DBS Corp., 5,75 %, 1 ^{er} décembre 2028	1 374 450	1 086 707	
USD	1 130 000	DISH Network Corp., coupon zéro, convertibles, 15 décembre 2025	1 247 113	799 081	
	1 440 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	1 437 794	1 431 271	
	1 250 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	1 262 823	1 242 289	
USD	790 000	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,63 %, 15 décembre 2030	1 057 534	1 038 703	
USD	267 156	Emerald Debt Merger Sub LLC, taux variable, 31 mai 2030	358 033	354 357	
	950 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	950 000	948 120	
	305 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 7,38 %, 12 mai 2026	305 000	306 129	
USD	1 355 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1 ^{er} mars 2028	1 724 402	1 688 716	
USD	840 000	Freeport-McMoRan Inc., 5 %, 1 ^{er} septembre 2027	1 087 191	1 084 882	
USD	475 000	Frontier Communications Holdings LLC, 5 %, 1 ^{er} mai 2028	546 658	543 502	
USD	605 000	Frontier Communications Holdings LLC, 8,75 %, 15 mai 2030	798 996	783 988	
USD	965 000	GFL Environmental Inc., 3,75 %, 1 ^{er} août 2025	1 197 772	1 217 418	
USD	311 000	GFL Environmental Inc., 5,13 %, 15 décembre 2026	418 935	397 861	
	1 800 000	Gibson Energy Inc., série 20-A, convertibles, taux variable, 22 décembre 2080	1 787 645	1 491 652	
	170 000	Gibson Energy Inc., taux variable, 12 juillet 2083	170 000	171 312	
USD	370 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 octobre 2027	462 908	436 043	
USD	740 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 22 avril 2032	905 182	803 919	
USD	195 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 juillet 2032	243 443	206 934	
	765 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	787 101	701 586	
USD	190 000	Graphic Packaging International LLC, 0,82 %, 15 avril 2024	243 075	241 571	
	1 150 000	Great-West Lifeco Inc., série 1, taux variable, 31 décembre 2081	1 150 000	850 054	
USD	695 000	Group 1 Automotive Inc., 4 %, 15 août 2028	884 354	811 627	
USD	270 000	Hudbay Minerals Inc., 4,5 %, 1 ^{er} avril 2026	313 067	333 411	
USD	140 000	Humana Inc., 2,15 %, 3 février 2032	174 322	146 178	
USD	465 000	Husky III Holding Ltd., paiement en nature, 13 %, 15 février 2025	636 531	562 108	
	565 000	Hydro One Inc., 2,16 %, 28 février 2030	584 111	490 657	
USD	400 000	IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15 octobre 2028	517 008	397 173	
	645 000	Inter Pipeline Ltd., 2,61 %, 13 septembre 2023	653 501	641 464	
	100 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	100 000	87 928	
USD	320 000	IQVIA Inc., 5 %, 15 octobre 2026	415 127	409 537	
USD	280 000	Iris Holdings Inc., paiement en nature, 8,75 %, 15 février 2026	359 156	353 402	
USD	310 000	JBS USA LUX SA/JBS Food Co./JBS USA Finance Inc., 3,63 %, 15 janvier 2032	371 437	333 589	
	1 080 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	1 077 243	950 741	
USD	800 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 23 juin 2025	1 004 558	1 006 177	
USD	700 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 4 février 2032	835 517	738 894	
USD	165 000	KB Home, 4 %, 15 juin 2031	176 503	188 720	
USD	175 000	Kenvue Inc., 4,9 %, 22 mars 2033	241 556	234 632	
USD	315 000	Kyndryl Holdings Inc., 2,05 %, 15 octobre 2026	386 788	360 159	
USD	235 000	Level 3 Financing Inc., 3,4 %, 1 ^{er} mars 2027	268 694	264 336	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	115 000	Level 3 Financing Inc., 3,63 %, 15 janvier 2029	80 641	91 552	
USD	865 000	Level 3 Financing Inc., 3,75 %, 15 juillet 2029	747 465	692 781	
USD	615 000	Level 3 Financing Inc., 3,88 %, 15 novembre 2029	632 749	649 403	
	1 510 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	1 570 411	1 488 779	
USD	223 000	Lumen Technologies Inc., 4 %, 15 février 2027	293 068	221 226	
USD	225 000	Mattel Inc., 3,75 %, 1 ^{er} avril 2029	273 592	262 549	
	3 260 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	3 389 404	3 148 355	
	1 960 000	Metro Inc., série J, 1,92 %, 2 décembre 2024	1 931 406	1 865 003	
USD	325 000	Minerals Technologies Inc., 5 %, 1 ^{er} juillet 2028	441 808	392 202	
	2 230 000	Molson Coors International LP, 2,84 %, 15 juillet 2023	2 201 671	2 228 000	
	690 000	Morgan Stanley, 3 %, 7 février 2024	679 712	680 182	
USD	905 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2025	1 154 194	1 162 009	
USD	415 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2031	499 031	467 689	
USD	395 000	Moss Creek Resources Holdings Inc., 10,5 %, 15 mai 2027	369 142	501 932	
USD	255 000	MSCI Inc., 3,25 %, 15 août 2033	314 384	272 405	
USD	410 000	MSCI Inc., 4 %, 15 novembre 2029	515 045	492 048	
	1 045 000	Banque Nationale du Canada, convertibles, taux variable, 15 août 2081	1 045 000	783 351	
	610 000	National Grid Electricity Transmission PLC, 2,3 %, 22 juin 2029	610 000	524 117	
USD	4 545 000	Netflix Inc., 3,63 %, 15 juin 2025	5 856 111	5 805 778	
USD	150 000	Newell Brands Inc., 6,63 %, 15 septembre 2029	194 617	190 870	
USD	235 000	Newmont Corp., 2,25 %, 1 ^{er} octobre 2030	294 236	255 253	
	590 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	590 000	570 377	
	1 375 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série L, 1,2 %, 1 ^{er} décembre 2023	1 354 317	1 352 502	
USD	105 000	Novelis Corp., 3,25 %, 15 novembre 2026	127 494	126 082	
	2 135 000	OMERS Realty Corp., série 12, 1,3 %, 22 septembre 2023	2 139 782	2 117 284	
USD	100 000	Open Text Corp., 6,9 %, 1 ^{er} décembre 2027	133 270	135 021	
	1 140 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	1 141 140	1 058 276	
	300 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	295 293	295 967	
	505 000	Pembina Pipeline Corp., convertibles, taux variable, 25 janvier 2081	505 000	412 438	
	570 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	580 699	555 297	
USD	1 304 000	Rackspace Technology Global Inc., 3,5 %, 15 février 2028	1 202 236	779 208	
	500 000	FPI RioCan, série AA, 3,21 %, 29 septembre 2023	496 000	497 158	
USD	1 135 000	Rogers Communications Inc., 2,95 %, 15 mars 2025	1 459 545	1 427 637	
	795 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	855 028	747 139	
	630 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 13 mars 2024	624 097	623 033	
	1 990 000	Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	1 997 737	1 977 623	
	1 875 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, restreint, 17 décembre 2081	1 875 000	1 705 530	
	645 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,75 %, 15 avril 2029	644 297	596 101	
	680 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	671 836	614 332	
	1 190 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	1 146 029	1 144 374	
	665 000	Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	665 000	665 900	
	895 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 novembre 2031	894 776	795 692	
	800 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 28 janvier 2033	800 000	670 110	
	1 610 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2080	1 622 040	1 494 484	
	515 000	Saputo Inc., 2,83 %, 21 novembre 2023	504 824	510 074	
	900 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	866 412	867 939	
USD	618 764	SBA Senior Finance II LLC, taux variable, 11 avril 2025	766 125	820 454	
	1 155 000	Secure Energy Services Inc., 7,25 %, 30 décembre 2026	1 155 714	1 140 563	
	3 980 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	3 982 671	3 957 849	
	250 000	ShawCor Ltd., 9 %, 10 décembre 2026	250 000	260 234	
USD	622 000	Six Flags Theme Parks Inc., 7 %, 1 ^{er} juillet 2025	823 294	828 854	
	1 230 000	Tamarack Valley Energy Ltd., 7,25 %, 10 mai 2027	1 215 000	1 151 203	
USD	19 000	Teleflex Inc., 4,25 %, 1 ^{er} juin 2028	25 518	23 008	
USD	825 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 4,88 %, 1 ^{er} juin 2027	1 065 229	656 937	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)					
USD	465 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 5,63 %, 6 décembre 2026	532 038	380 712	
	3 295 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	3 325 603	3 109 154	
USD	1 037 258	Titan Acquisition Ltd. du Canada, taux variable, 28 mars 2025	1 292 211	1 344 619	
	730 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,89 %, 8 mars 2028	687 368	634 478	
	1 000 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,9 %, 11 septembre 2028	848 619	858 685	
	685 000	Banque Toronto Dominion (La), série 1, convertibles, taux variable, 31 octobre 2081	685 000	503 983	
	1 050 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	1 091 590	998 940	
	1 070 000	Transcontinental Inc., restreint, 2,67 %, 3 février 2025	1 006 784	1 009 397	
USD	2 990 000	TransDigm Inc., 6,25 %, 15 mars 2026	3 926 044	3 944 972	
USD	145 000	TransDigm Inc., 6,38 %, 15 juin 2026	188 021	189 821	
USD	1 575 000	Trulieve Cannabis Corp., 8 %, 6 octobre 2026	1 981 350	1 546 062	
	3 445 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	3 499 229	3 328 483	
USD	245 000	U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,38 %, 1 ^{er} mars 2026	314 300	278 242	
USD	373 000	Unisys Corp., 6,88 %, 1 ^{er} novembre 2027	508 670	356 442	
	1 095 000	United Parcel Service Inc., 2,13 %, 21 mai 2024	1 114 723	1 065 054	
USD	440 000	United Rentals North America Inc., 3,88 %, 15 novembre 2027	561 121	542 987	
	1 550 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	1 553 650	1 323 995	
	800 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	798 514	613 485	
USD	545 000	Verizon Communications Inc., 4,33 %, 21 septembre 2028	697 988	696 347	
USD	295 000	Vermilion Energy Inc., 5,63 %, 15 mars 2025	333 177	381 597	
	1 895 000	Vidéotron ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	1 880 955	1 474 547	
	855 000	Vidéotron ltée, 3,63 %, 15 juin 2028	828 981	744 117	
USD	340 000	Viking Cruises Ltd., 5,88 %, 15 septembre 2027	401 947	414 503	
USD	285 000	Viking Cruises Ltd., 13 %, 15 mai 2025	388 546	396 691	
USD	240 000	VistaJet Malta Finance PLC/XO Management Holding Inc., 6,38 %, 1 ^{er} février 2030	292 847	256 302	
USD	970 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,55 %, 15 juillet 2024	1 234 786	1 241 341	
USD	465 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,7 %, 30 janvier 2027	546 077	564 404	
USD	1 205 000	Vistra Operations Co., LLC, 4,88 %, 13 mai 2024	1 570 322	1 567 092	
USD	370 000	Vital Energy Inc., 9,5 %, 15 janvier 2025	488 723	487 011	
	975 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	987 159	905 772	
	1 355 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	1 393 057	1 248 644	
	350 000	Wells Fargo & Co., 2,51 %, 27 octobre 2023	343 857	346 895	
	435 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 ^{er} mai 2026	409 700	409 477	
			178 753 438	167 308 308	34,2
ACTIONS ORDINAIRES					
USD	400	Alphabet Inc., catégorie A	62 762	63 429	
USD	68 965	Altice USA Inc., catégorie A	1 437 314	275 911	
USD	4 770	Amazon.com Inc.	772 575	823 752	
USD	3 900	Ball Corp.	273 014	300 743	
USD	4 100	Citigroup Inc.	255 904	250 065	
USD	4 200	Comcast Corp., catégorie A	236 582	231 182	
USD	29 500	Coupang Inc.	615 282	679 994	
USD	20 050	DISH Network Corp., catégorie A	540 449	175 039	
USD	1 900	Expedia Group Inc.	241 231	275 337	
USD	4 500	Freeport-McMoRan Inc.	226 331	238 455	
USD	200	IQVIA Holdings Inc.	53 352	59 553	
USD	7 500	Occidental Petroleum Corp.	591 393	584 215	
USD	9 100	Palantir Technologies Inc.	91 823	184 807	
USD	11 800	Sonos Inc.	253 482	255 271	
USD	1 350	Spotify Technology SA	247 943	287 130	
	19 400	Suncor Énergie Inc.	792 397	753 884	
	3 700	Ressources Teck Limitée, catégorie B	190 359	206 238	
USD	7 300	Tronox Holdings PLC, catégorie A	109 905	122 914	
EUR	27 300	Universal Music Group NV	681 297	803 092	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
ACTIONS ORDINAIRES (suite)					
USD	475	Vail Resorts Inc.	150 333	158 422	
USD	2 200	Walt Disney Co. (The)	347 520	260 202	
USD	14 500	Warner Bros Discovery Inc.	424 342	240 879	
USD	4 400	Warner Music Group Corp., catégorie A	144 875	152 076	
			8 740 465	7 382 590	1,5
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
USD	400	Fonds Consumer Staples Select Sector SPDR	39 004	39 303	
USD	12 650	iShares MSCI Brazil ETF	463 130	543 465	
			502 134	582 768	0,1
Total de la (des) positions acheteur			680 326 657	651 505 810	133,2
POSITION(S) VENDEUR					
ACTIONS ORDINAIRES					
USD	(10 000)	Apple Inc.	(2 293 067)	(2 569 617)	
USD	(4 600)	Ares Management Corp., catégorie A	(521 136)	(587 142)	
USD	(3 000)	AutoNation Inc.	(555 538)	(654 201)	
USD	(3 600)	D.R. Horton Inc.	(529 738)	(580 352)	
USD	(1 800)	General Mills Inc.	(161 991)	(182 895)	
USD	(500)	Mastercard Inc., catégorie A	(254 040)	(260 512)	
USD	(800)	Visa Inc., catégorie A	(243 250)	(251 681)	
			(4 558 760)	(5 086 400)	(1,0)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	(265 000)	Apple Inc., 1,4 %, 5 août 2028	(316 628)	(303 112)	
USD	(375 000)	Bombardier Inc., 7,88 %, 15 avril 2027	(476 756)	(496 161)	
USD	(515 000)	Calpine Corp., 4,5 %, 15 février 2028	(636 401)	(618 322)	
USD	(485 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} mars 2030	(569 571)	(550 080)	
USD	(585 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} février 2032	(642 893)	(632 809)	
USD	(500 000)	GFL Environmental Inc., 4,75 %, 15 juin 2029	(580 162)	(605 980)	
USD	(670 000)	HealthEquity Inc., 4,5 %, 1 ^{er} octobre 2029	(784 431)	(783 391)	
USD	(590 000)	MGM Resorts International, 4,75 %, 15 octobre 2028	(702 810)	(710 414)	
USD	(90 000)	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance, Corp., 4,5 %, 15 février 2029	(105 709)	(105 624)	
USD	(220 000)	Tenet Healthcare Corp., 4,88 %, 1 ^{er} janvier 2026	(285 543)	(284 141)	
USD	(115 000)	TransDigm Inc., 4,63 %, 15 janvier 2029	(129 910)	(135 699)	
USD	(455 000)	TransDigm Inc., 4,88 %, 1 ^{er} mai 2029	(552 689)	(539 117)	
USD	(182 000)	TransDigm Inc., 5,5 %, 15 novembre 2027	(238 704)	(227 689)	
USD	(835 000)	United Rentals North America Inc., 5,25 %, 15 janvier 2030	(1 061 719)	(1 056 968)	
USD	(560 000)	US Foods Inc., 4,75 %, 15 février 2029	(666 728)	(679 871)	
USD	(285 000)	Wyndham Hotels & Resorts Inc., 4,38 %, 15 août 2028	(337 084)	(345 122)	
USD	(145 000)	Yum! Brands Inc., 5,38 %, 1 ^{er} avril 2032	(180 815)	(182 779)	
			(8 268 553)	(8 257 279)	(1,7)
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	(74 700)	FNB BMO Equal Weight Banks Index	(2 963 473)	(2 509 173)	
USD	(10 900)	iShares Core MSCI Europe ETF	(764 565)	(759 965)	
USD	(20 775)	SPDR S&P 500 ETF Trust	(11 443 082)	(12 199 812)	
			(15 171 120)	(15 468 950)	(3,2)
Total de la (des) position(s) vendeur			(27 998 433)	(28 812 629)	(5,9)
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			652 328 224	622 693 181	127,3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(2 931)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			652 325 293	622 693 181	127,3
Contrat(s) de change à terme				2 421 602	0,5
Swap(s) sur défaillance				(533 137)	(0,1)
Total du portefeuille de placements			652 325 293	624 581 646	127,7
Autres actifs (passifs) nets				(135 367 573)	(27,7)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				489 214 073	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	819 465	EUR	568 930	1,44	(3 239)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	290 980 296	USD	217 717 490	1,34	2 601 571
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	4 964	USD	3 724	1,33	31
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	100 000	USD	75 483	1,32	19
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	4 397	USD	3 310	1,33	13
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	25 573	USD	19 300	1,33	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	288	USD	218	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	314	USD	238	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	526	USD	400	1,32	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	911	USD	691	1,32	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	6 143	USD	4 659	1,32	(28)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	10 982	USD	8 354	1,31	(84)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	153 869	USD	117 015	1,31	(1 124)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	601 923	USD	456 841	1,32	(3 188)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 558 323	CAD	4 700 000	0,76	13 193
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	757 846	CAD	1 000 000	0,76	3 808
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	456 841	CAD	601 923	0,76	3 188
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	117 015	CAD	153 869	0,76	1 124
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	75 723	CAD	100 000	0,76	299
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	34 655	CAD	45 625	0,76	278
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	75 572	CAD	100 000	0,76	99
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	12 108	CAD	15 940	0,76	97
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	8 354	CAD	10 982	0,76	84
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	4 659	CAD	6 143	0,76	28
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 028	CAD	1 353	0,76	8
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	645	CAD	850	0,76	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	708	CAD	932	0,76	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	691	CAD	911	0,76	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	400	CAD	526	0,76	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	238	CAD	314	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	218	CAD	288	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	75 496	CAD	100 000	0,75	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	19 300	CAD	25 573	0,75	(9)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 724	CAD	4 964	0,75	(31)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	905 346	CAD	1 200 000	0,75	(820)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	146 136	CAD	195 251	0,75	(1 685)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	226 607	CAD	302 766	0,75	(2 613)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	290 764	CAD	388 486	0,75	(3 353)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 277 841	CAD	3 043 393	0,75	(26 268)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	4 721 011	CAD	6 307 680	0,75	(54 442)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	9 137 374	CAD	12 208 324	0,75	(105 372)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								2 421 602

Swap(s) sur défaillance

Swap(s)	Nombre de contrats	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
Verse tous les trimestres 1,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX-NA IGS40 V1.5Y P1 %	1	Citigroup Global Market Inc.	A+	20 juin 2028	26 900 000	(533 137)
Valeur totale du (des) swap(s) sur défaillance						(533 137)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	2 624	(202)	-	2 422
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	2 624	(202)	-	2 422
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(202)	202	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(202)	202	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	2 709	(259)	-	2 450
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	2 709	(259)	-	2 450
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(259)	259	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(259)	259	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
iShares MSCI Brazil ETF	1 391 669	543	-
Fonds Consumer Staples Select Sector SPDR	7 279 448	39	-

au 31 décembre 2022

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
iShares MSCI Brazil ETF	6 411 507	517	-
iShares Biotechnology ETF	11 847 084	533	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	5	28
Paiements indirects [†]	1	3

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 477 503	5 955 271	36 704	42 568	23 961 421	31 591 801	551 561	1 094 404
Parts rachetables émises	517 860	596 291	-	21 274	3 662 414	9 100 736	32 141	86 872
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	75 900	60 809	480	411	324 227	327 932	8 219	9 107
Parts rachetables rachetées	(920 449)	(1 586 241)	(4 045)	(14 893)	(4 713 294)	(10 176 355)	(69 955)	(333 193)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	4 150 814	5 026 130	33 139	49 360	23 234 768	30 844 114	521 966	857 190

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 095 083	11 216 849	51 311	442 494	41 001	134 553	1 066 622	1 100 794
Parts rachetables émises	479 425	2 151 891	1	15 097	6 270	416 890	20 410	7 727
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	104 653	193 252	1 028	1 008	1 133	7 452	24 113	17 608
Parts rachetables rachetées	(1 090 059)	(3 509 501)	(28 178)	(385 685)	(3 756)	(423 329)	(18 814)	(71 062)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 589 102	10 052 491	24 162	72 914	44 648	135 566	1 092 331	1 055 067

	Série W		Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12 798 745	13 748 832	17 071	26 817	4 025 000	5 575 000	125 000	450 000
Parts rachetables émises	3 348 628	3 780 066	4 158	-	100 000	250 000	-	25 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	356 702	291 888	451	522	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(2 980 855)	(3 754 442)	(4 158)	(10 659)	(250 000)	(850 000)	(25 000)	(100 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 523 220	14 066 344	17 522	16 680	3 875 000	4 975 000	100 000	375 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,300	0,17
Série AH	1,300	0,17
Série F	0,800	0,17
Série FH	0,800	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série FNB en \$ CA	0,800	0,12
Série FNB couverte en \$ US	0,800	0,12

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	107 842
Garanties (hors trésorerie)	-	113 493

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	54	220
Charges	(19)	(106)
Revenu tiré des prêts de titres	35	114
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	35,0	48,1

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	49,5
Obligations étrangères	28,8
Obligations de sociétés	22,6
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	18,8
Actions ordinaires	1,7
Contrat(s) de change à terme	0,5
Obligations et garanties provinciales	0,2
Fonds négocié(s) en bourse	0,2
Autres actifs (passifs) nets	(16,6)
Total de la (des) position(s) acheteur	105,7

Position(s) vendeur

Fonds négocié(s) en bourse	(3,1)
Obligations étrangères	(2,1)
Obligations de sociétés	(0,4)
Actions ordinaires	(0,1)
Total de la (des) position(s) vendeur	(5,7)
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	98,0
AA/Aa/A+	0,2
A	5,7
BBB/Baa/B++	15,3
BB/Ba/B+	8,4
B	2,4
CCC/Caa/C+	1,6
C et moins	0,2
Aucune	0,3
Total	132,1

Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	68,8
AA/Aa/A+	1,4
A	6,5
BBB/Baa/B++	22,2
BB/Ba/B+	16,1
B	2,4
CCC/Caa/C+	1,5
Aucune	1,5
Total	120,4

* Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

** Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisque certains de ses actifs étaient investis dans des actions et des Fonds négociés en bourse.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 1 259 000 \$ (638 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	280 533	(259 482)	21 051	4,3	
Euro	858	(823)	35	0,0	
Total	281 391	(260 305)	21 086	4,3	

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	339 006	(320 166)	18 840	3,7	
Euro	871	(881)	(10)	0,0	
Total	339 877	(321 047)	18 830	3,7	

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 109 000 \$ (1 883 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	43 105	141 173	126 137	324 868	635 283

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	59 650	114 323	146 721	270 661	591 355

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 8 996 000 \$ (8 376 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	7 383	-	-	7 383
Obligations	-	643 540	-	643 540
Fonds négocié(s) en bourse	583	-	-	583
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 422	-	2 422
Swap(s)	-	(533)	-	(533)
Total	7 966	645 429	-	653 395

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(5 087)	-	-	(5 087)
Obligations	-	(8 257)	-	(8 257)
Fonds négocié(s) en bourse	(15 469)	-	-	(15 469)
Total	(20 556)	(8 257)	-	(28 813)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	8 437	-	-	8 437
Obligations	-	603 764	-	603 764
Fonds négocié(s) en bourse	1 050	-	-	1 050
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 450	-	2 450
Total	9 487	606 214	-	615 701

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(307)	-	-	(307)
Obligations	-	(12 409)	-	(12 409)
Fonds négocié(s) en bourse	(15 563)	-	-	(15 563)
Total	(15 870)	(12 409)	-	(28 279)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	58 272	90 110
Placements donnés en garantie	13 932	1 115
Trésorerie	-	3 282
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	344	497
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	224	110
Rabais sur frais à recevoir	-	1
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	4 558
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	568	838
Montant à recevoir pour la vente de placements	360	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	6	64
	73 706	100 575
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	1 408	2 320
Découvert bancaire	6 350	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	88	121
Swaps, options sur swaps et options	53	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	23	36
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	517	221
Montant à payer pour le rachat de parts	53	81
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	1	4
Frais d'administration à payer	-	1
Comptes créditeurs et charges à payer	43	46
Frais de rendement à payer	8	-
	8 544	2 830
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	65 162	97 745

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Série A	13 089	14 718	9,50	9,53	1 377 225
Série AH	439	929	9,64*	9,64*	34 389	71 182
Série F	21 336	22 946	9,52	9,55	2 240 066	2 402 847
Série FH	1 003	1 247	9,64*	9,65*	78 527	95 479
Série I	10 647	10 765	9,55	9,58	1 114 987	1 124 044
Série IH	632	862	9,69*	9,70*	49 243	65 643
Série P	596	982	9,56	9,58	62 301	102 498
Série PH	6 271	6 371	9,69*	9,70*	488 329	485 172
Série W	7 021	5 838	9,54	9,58	735 575	609 679
Série WH	838	505	9,57*	9,57*	66 108	38 972
Série FNB en \$ CA	2 517	30 476	19,36	19,41	130 000	1 570 000
Série FNB en \$ US	773	2 106	19,45*	19,44*	30 000	80 000

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH et FNB en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4	2
Intérêts aux fins des distributions	1 526	2 046
Distributions de revenu provenant des placements	-	38
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(13)	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	(1)
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(54)	(81)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 834	(1 243)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(780)	(6 118)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	2 517	(5 357)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(358)	556
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	5	9
Rabais sur frais	10	87
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
Total des autres revenus	(342)	652
Total des revenus	2 175	(4 705)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	236	458
Frais d'administration (note 5)	52	99
Primes de rendement (note 5)	8	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	24
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	4	6
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	33	53
Autres frais	-	-
Total des charges	344	641
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 831	(5 346)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	243	(950)	0,17	(0,43)	1 463 668	2 187 492
Série AH	8	(29)	0,12	(0,37)	61 357	76 301
Série F	475	(1 615)	0,20	(0,41)	2 417 051	3 956 965
Série FH	2	(110)	0,01	(0,30)	91 192	371 043
Série I	272	(629)	0,24	(0,37)	1 142 266	1 719 257
Série IH	9	(16)	0,17	(0,22)	55 243	72 096
Série P	23	(34)	0,23	(0,39)	98 395	87 929
Série PH	29	(143)	0,05	(0,27)	486 530	519 601
Série W	143	(396)	0,21	(0,35)	689 187	1 138 311
Série WH	3	(47)	0,05	(0,32)	57 449	147 633
Série FNB en \$ CA	570	(1 359)	1,16	(0,81)	492 320	1 674 088
Série FNB en \$ US	54	(18)	1,02	(0,40)	53 481	44 641

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	14 718	24 932	929	1 087	22 946	43 367
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	243	(950)	8	(29)	475	(1 615)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(260)	(144)	(15)	(6)	(477)	(321)
Profits nets réalisés	-	(129)	-	(6)	-	(288)
Remboursement de capital	(10)	-	(1)	-	(31)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(270)	(273)	(16)	(12)	(508)	(609)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 707	5 045	17	146	5 323	13 133
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	263	267	15	12	465	561
Rachat de parts rachetables	(3 572)	(11 259)	(514)	(346)	(7 365)	(23 958)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 602)	(5 947)	(482)	(188)	(1 577)	(10 264)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 629)	(7 170)	(490)	(229)	(1 610)	(12 488)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 089	17 762	439	858	21 336	30 879

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 247	4 911	10 765	17 884	862	992
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2	(110)	272	(629)	9	(16)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(25)	(37)	(287)	(189)	(19)	(10)
Profits nets réalisés	-	(34)	-	(170)	-	(9)
Remboursement de capital	(2)	-	(14)	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(27)	(71)	(301)	(359)	(20)	(19)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	10	2 591	2 494	9 314	72	297
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	24	71	299	359	20	19
Rachat de parts rachetables	(253)	(5 397)	(2 882)	(12 359)	(311)	(351)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(219)	(2 735)	(89)	(2 686)	(219)	(35)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(244)	(2 916)	(118)	(3 674)	(230)	(70)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 003	1 995	10 647	14 210	632	922

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	982	965	6 371	6 853	5 838	16 140
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23	(34)	29	(143)	143	(396)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(23)	(9)	(161)	(69)	(170)	(117)
Profits nets réalisés	-	(8)	-	(62)	-	(106)
Remboursement de capital	(1)	-	(8)	-	(8)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(24)	(17)	(169)	(131)	(178)	(223)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	191	92	8	105	2 404	1 942
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	16	14	140	100	178	223
Rachat de parts rachetables	(592)	(268)	(108)	(612)	(1 364)	(10 533)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(385)	(162)	40	(407)	1 218	(8 368)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(386)	(213)	(100)	(681)	1 183	(8 987)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	596	752	6 271	6 172	7 021	7 153

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	505	2 117	30 476	27 025	2 106	523
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3	(47)	570	(1 359)	54	(18)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(20)	(20)	(194)	(323)	(31)	(10)
Profits nets réalisés	-	(18)	-	(290)	-	(10)
Remboursement de capital	(1)	-	(9)	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(21)	(38)	(203)	(613)	(32)	(20)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	441	241	2 151	13 445	-	1 540
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	21	38	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(111)	(1 470)	(30 477)	(5 791)	(1 355)	(519)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	351	(1 191)	(28 326)	7 654	(1 355)	1 021
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	333	(1 276)	(27 959)	5 682	(1 333)	983
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	838	841	2 517	32 707	773	1 506
	Total du Fonds					
	2023	2022				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	97 745	146 796				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 831	(5 346)				
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(1 682)	(1 255)				
Profits nets réalisés	-	(1 130)				
Remboursement de capital	(87)	-				
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 769)	(2 385)				
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	14 818	47 891				
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 441	1 664				
Rachat de parts rachetables	(48 904)	(72 863)				
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(32 645)	(23 308)				
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(32 583)	(31 039)				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	65 162	115 757				

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 831	(5 346)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 834)	1 243
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(24)	(174)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	24
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	780	6 118
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	156 956	321 120
Achat de placements et de dérivés	(137 686)	(333 423)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	(114)	(648)
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	6
Augmentation (diminution) des dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	(12)	(5)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	4 558	7 232
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	270	(165)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(3)	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(1)	-
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	8	(18)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(3)	(3)
Amortissement des produits d'intérêts	(8)	(3)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	24 728	(4 043)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(327)	(720)
Produit de l'émission de parts rachetables	14 873	47 895
Montant versé au rachat de parts rachetables	(48 930)	(72 637)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(34 384)	(25 462)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	24	174
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9 656)	(29 505)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 282	37 940
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	(6 350)	8 609
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	39
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 788	1 878
Dividendes payés*	-	(6)
Intérêts payés*	(66)	(75)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	63 000	1375209 BC Ltd., 9 %, 30 janvier 2028	85 106	83 706	
USD	190 000	Alexander Funding Trust, 1,84 %, 15 novembre 2023	235 606	246 218	
	75 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	74 994	62 480	
	610 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	629 399	594 362	
	65 000	AltaGas Ltd., 4,4 %, 15 mars 2024	64 464	64 435	
	165 000	AltaLink LP, 3,67 %, 6 novembre 2023	163 937	164 078	
USD	75 000	Altice France SA, 5,5 %, 15 janvier 2028	94 361	75 160	
USD	10 000	AMC Networks Inc., 5 %, 1 ^{er} avril 2024	13 277	13 055	
	90 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	92 422	87 292	
USD	40 000	Aramark Services Inc., 5 %, 1 ^{er} avril 2025	53 163	52 278	
	75 000	ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	75 000	69 074	
	70 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	70 000	61 472	
USD	200 000	Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc., 4,13 %, 15 août 2026	248 692	247 094	
	610 000	AT&T Inc., 2,85 %, 25 mai 2024	623 105	595 433	
	100 000	Athene Global Funding, 2,1 %, 24 septembre 2025	99 547	91 483	
USD	200 000	Bank of America Corp., taux variable, 25 septembre 2025	249 001	249 015	
USD	90 000	Bank of America Corp., taux variable, 21 septembre 2036	109 167	91 036	
	400 000	Banque de Montréal, 2,85 %, 6 mars 2024	390 209	393 146	
USD	220 000	Banque de Montréal, taux flottant, 8 décembre 2023	274 843	291 366	
	155 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	154 258	144 035	
	65 000	Banque de Montréal, taux variable, 26 novembre 2080	65 000	59 696	
	210 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janvier 2025	209 910	198 842	
	55 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	56 619	52 119	
USD	135 000	Bausch Health Cos. Inc., 5,5 %, 1 ^{er} novembre 2025	171 493	158 266	
USD	52 000	Bausch Health Cos. Inc., 11 %, 30 septembre 2028	57 913	48 910	
USD	22 000	Bausch Health Cos. Inc., 14 %, 15 octobre 2030	17 544	17 487	
	5 000	BCI QuadReal Realty, série 1, 1,68 %, 3 mars 2025	4 999	4 696	
	235 000	Bell Canada, 2,7 %, 27 février 2024	231 078	230 921	
	175 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	167 895	167 782	
	65 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	66 722	62 781	
	205 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	204 764	204 715	
USD	25 000	Brightsphere Investment Group Inc., 4,8 %, 27 juillet 2026	31 714	31 044	
	60 000	Brookfield Property Finance ULC, 4 %, 30 septembre 2026	60 001	51 628	
USD	65 000	Cablevision Lightpath LLC, 3,88 %, 15 septembre 2027	72 636	72 230	
	100 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	99 770	90 467	
	660 000	Canadian Natural Resources Ltd., 1,45 %, 16 novembre 2023	659 091	650 895	
	590 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 1,59 %, 24 novembre 2023	578 820	581 467	
	45 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,15 %, 13 mars 2029	41 265	41 188	
	430 000	La Société Canadian Tire Limitée, 3,17 %, 6 juillet 2023	429 750	430 024	
USD	135 000	CANPACK SA/Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,88 %, 15 novembre 2029	169 789	145 778	
USD	50 000	Carnival Corp., 4 %, 1 ^{er} août 2028	55 418	58 946	
USD	40 000	Carnival Corp., 7,63 %, 1 ^{er} mars 2026	46 505	51 947	
USD	40 000	Carnival Holdings Bermuda Ltd., 10,38 %, 1 ^{er} mai 2028	54 136	58 006	
USD	40 000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp/Millennium Operations LLC, 5,5 %, 1 ^{er} mai 2025	52 399	52 561	
	145 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	144 774	125 826	
USD	125 051	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 30 avril 2025	159 278	165 764	
USD	56 943	Charter Communications Operating LLC, taux variable, 1 ^{er} février 2027	71 862	75 074	
USD	185 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,3 %, 1 ^{er} février 2032	194 316	185 579	
USD	45 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,8 %, 1 ^{er} avril 2031	47 911	47 970	
	95 000	FPI Propriétés de Choix, série B, 4,9 %, 5 juillet 2023	94 911	95 018	
	25 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	25 000	22 751	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	105 000	CHS/Community Health Systems Inc., 8 %, 15 mars 2026	134 823	135 391	
USD	135 000	CITGO Petroleum Corp., 7 %, 15 juin 2025	171 590	175 649	
USD	50 000	Citigroup Inc., taux variable, 3 novembre 2032	61 790	53 384	
USD	40 000	Citigroup Inc., taux variable, 25 janvier 2033	50 872	44 237	
	160 000	CNH Industrial Capital Canada Ltd., 1,5 %, 1 ^{er} octobre 2024	159 898	151 617	
USD	30 000	Coeur Mining Inc., 5,13 %, 15 février 2029	36 635	32 830	
USD	75 000	Columbia Care Inc., 9,5 %, 3 février 2026	95 137	89 110	
USD	120 000	CommScope Technologies LLC, 6 %, 15 juin 2025	153 873	148 385	
	130 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	130 000	91 812	
USD	25 000	Cox Communications Inc., 2,95 %, 1 ^{er} octobre 2050	32 720	20 797	
USD	145 000	CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15 novembre 2031	173 283	134 100	
USD	35 000	CSC Holdings LLC, 5,5 %, 15 avril 2027	39 790	38 647	
USD	25 000	CSC Holdings LLC, 11,25 %, 15 mai 2028	33 641	32 155	
	90 000	CT REIT, 3,03 %, 5 février 2029	90 000	78 956	
USD	190 000	Curaleaf Holdings Inc., 8 %, 15 décembre 2026	240 952	197 586	
	70 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	68 451	66 453	
USD	34 466	DIRECTV Financing LLC, taux variable, 2 août 2027	42 968	44 739	
USD	175 000	DISH DBS Corp., 5,75 %, 1 ^{er} décembre 2028	218 663	172 885	
USD	195 000	DISH Network Corp., coupon zéro, convertibles, 15 décembre 2025	209 629	137 895	
	190 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	190 192	188 848	
	165 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	165 607	163 982	
	150 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	141 171	135 501	
	240 000	FPI industriel Dream, série B, taux flottant, 17 juin 2024	240 000	238 518	
USD	105 000	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,63 %, 15 décembre 2030	140 558	138 056	
USD	33 395	Emerald Debt Merger Sub LLC, taux variable, 31 mai 2030	44 257	44 295	
USD	21 000	EQM Midstream Partners LP, 4 %, 1 ^{er} août 2024	26 717	27 239	
USD	74 000	EQT Corp., 3,13 %, 15 mai 2026	92 352	90 223	
USD	50 000	Expedia Group Inc., 6,25 %, 1 ^{er} mai 2025	66 775	66 475	
	60 000	FPI First Capital, série Q, 3,9 %, 30 octobre 2023	59 486	59 661	
	220 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	220 000	219 565	
	40 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 7,38 %, 12 mai 2026	40 000	40 148	
USD	185 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1 ^{er} mars 2028	237 700	230 563	
USD	530 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,55 %, 14 novembre 2024	711 988	692 730	
USD	115 000	Freeport-McMoRan Inc., 5 %, 1 ^{er} septembre 2027	149 479	148 526	
USD	65 000	Frontier Communications Holdings LLC, 5 %, 1 ^{er} mai 2028	74 681	74 374	
USD	105 000	Frontier Communications Holdings LLC, 8,75 %, 15 mai 2030	138 669	136 064	
	80 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 3,15 %, 8 février 2027	79 974	73 259	
USD	155 000	GFL Environmental Inc., 3,75 %, 1 ^{er} août 2025	192 847	195 544	
USD	40 000	GFL Environmental Inc., 5,13 %, 15 décembre 2026	52 830	51 172	
	20 000	Gibson Energy Inc., taux variable, 12 juillet 2083	20 000	20 154	
USD	25 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), 0,93 %, 21 octobre 2024	32 331	32 562	
USD	65 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 octobre 2027	81 465	76 602	
USD	70 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 22 avril 2032	80 929	76 046	
USD	45 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 juillet 2032	55 964	47 754	
	370 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 3, 3,87 %, 30 novembre 2023	368 351	367 294	
	135 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	138 756	123 809	
USD	25 000	Graphic Packaging International LLC, 0,82 %, 15 avril 2024	31 811	31 786	
USD	35 000	Hudbay Minerals Inc., 4,5 %, 1 ^{er} avril 2026	43 343	43 220	
USD	70 000	Husky III Holding Ltd., paiement en nature, 13 %, 15 février 2025	94 973	84 618	
USD	75 000	IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15 octobre 2028	96 436	74 470	
	100 000	Intact Corporation financière, 1,21 %, 20 mai 2024	95 008	96 490	
	305 000	Inter Pipeline Ltd., 2,61 %, 13 septembre 2023	303 714	303 328	
	15 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	15 000	13 189	
USD	65 000	IQVIA Inc., 5 %, 15 octobre 2026	84 403	83 187	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
USD	100 000	Jacobs Entertainment Inc., 6,75 %, 15 février 2029	126 760	118 691	
	170 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	167 108	149 654	
USD	30 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 16 février 2025	38 146	38 366	
USD	200 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 23 juin 2025	251 145	251 544	
USD	50 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 4 février 2032	58 317	52 778	
USD	25 000	KB Home, 4 %, 15 juin 2031	26 753	28 594	
USD	30 000	Kenvue Inc., 4,9 %, 22 mars 2033	41 410	40 223	
	35 000	Kruger Products Inc., 6 %, 24 avril 2025	33 688	33 385	
USD	60 000	Kyndryl Holdings Inc., 2,05 %, 15 octobre 2026	73 124	68 602	
USD	30 000	Level 3 Financing Inc., 3,4 %, 1 ^{er} mars 2027	34 301	33 745	
USD	20 000	Level 3 Financing Inc., 3,63 %, 15 janvier 2029	14 025	15 922	
USD	140 000	Level 3 Financing Inc., 3,75 %, 15 juillet 2029	120 977	112 126	
USD	100 000	Level 3 Financing Inc., 3,88 %, 15 novembre 2029	102 874	105 594	
	265 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	274 730	261 276	
USD	30 000	Lumen Technologies Inc., 4 %, 15 février 2027	37 952	29 761	
	110 000	Banque Manuvie du Canada, 1,54 %, 14 septembre 2026	110 000	98 244	
USD	60 000	Masco Corp., 2 %, 15 février 2031	75 180	62 730	
USD	30 000	Mattel Inc., 3,75 %, 1 ^{er} avril 2029	36 288	35 007	
	435 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	451 765	420 103	
	285 000	Metro Inc., série J, 1,92 %, 2 décembre 2024	280 944	271 187	
	495 000	Molson Coors International LP, 2,84 %, 15 juillet 2023	488 638	494 556	
	85 000	Mondeléz International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	82 288	81 867	
USD	175 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2025	223 187	224 698	
USD	10 000	Moss Creek Resources Holdings Inc., 10,5 %, 15 mai 2027	8 970	12 707	
USD	35 000	MSCI Inc., 3,25 %, 15 août 2033	43 028	37 389	
USD	55 000	MSCI Inc., 4 %, 15 novembre 2029	69 670	66 006	
USD	585 000	Netflix Inc., 3,63 %, 15 juin 2025	774 045	747 278	
USD	20 000	Newell Brands Inc., 6,63 %, 15 septembre 2029	26 045	25 449	
USD	40 000	Newmont Corp., 2,25 %, 1 ^{er} octobre 2030	50 083	43 447	
	120 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	120 000	116 009	
	270 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série L, 1,2 %, 1 ^{er} décembre 2023	264 618	265 582	
USD	17 000	Novelis Corp., 3,25 %, 15 novembre 2026	20 636	20 413	
	300 000	OMERS Realty Corp., série 12, 1,3 %, 22 septembre 2023	297 516	297 511	
USD	15 000	Open Text Corp., 6,9 %, 1 ^{er} décembre 2027	19 990	20 253	
	195 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	195 218	181 021	
	190 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	186 012	187 446	
	100 000	Pembina Pipeline Corp., convertibles, taux variable, 25 janvier 2081	98 031	81 671	
	110 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	112 121	107 163	
USD	55 000	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,45 %, 19 mai 2026	73 866	71 960	
	240 000	FPI RioCan, série AA, 3,21 %, 29 septembre 2023	237 052	238 636	
USD	95 000	Rogers Communications Inc., 2,95 %, 15 mars 2025	123 591	119 494	
	135 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	145 116	126 873	
	100 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 13 mars 2024	99 063	98 894	
	310 000	Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	311 658	308 072	
	185 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, restreint, 17 décembre 2081	183 703	168 279	
	120 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,75 %, 15 avril 2029	119 869	110 902	
	135 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	132 942	121 963	
	155 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	149 230	149 057	
	90 000	Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	90 000	90 122	
	140 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 novembre 2031	138 760	124 466	
	100 000	Saputo Inc., 2,83 %, 21 novembre 2023	98 024	99 043	
	175 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	168 469	168 766	
USD	106 155	SBA Senior Finance II LLC, taux variable, 11 avril 2025	132 026	140 756	
	220 000	Secure Energy Services Inc., 7,25 %, 30 décembre 2026	220 340	217 250	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		POSITION(S) ACHETEUR (suite)			
		OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)			
	720 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	725 590	715 993	
	50 000	ShawCor Ltd., 9 %, 10 décembre 2026	50 000	52 047	
USD	253 000	Six Flags Theme Parks Inc., 7 %, 1 ^{er} juillet 2025	343 791	337 138	
	210 000	Tamarack Valley Energy Ltd., 7,25 %, 10 mai 2027	208 800	196 547	
USD	110 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 4,88 %, 1 ^{er} juin 2027	118 030	87 592	
USD	60 000	Télesat Canada/Télesat S.a.r.l., 5,63 %, 6 décembre 2026	69 682	49 124	
	195 000	TELUS Corp., 3,35 %, 1 ^{er} avril 2024	191 369	191 844	
	135 000	TELUS Corp., série CZ, 2,75 %, 8 juillet 2026	140 039	125 970	
	345 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	348 104	325 541	
USD	137 668	Titan Acquisition Ltd. du Canada, taux variable, 28 mars 2025	167 033	178 462	
	230 000	Groupe TMX Limitée, 4,46 %, 3 octobre 2023	230 719	229 486	
	85 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,89 %, 8 mars 2028	78 969	73 878	
	170 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,9 %, 11 septembre 2028	144 287	145 976	
	100 000	Banque Toronto-Dominion (La), 2,5 %, 2 décembre 2024	95 503	95 776	
	95 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	97 991	90 380	
	180 000	Transcontinental Inc., restreint, 2,67 %, 3 février 2025	178 818	169 805	
USD	395 000	TransDigm Inc., 6,25 %, 15 mars 2026	518 032	521 158	
USD	20 000	TransDigm Inc., 6,38 %, 15 juin 2026	25 893	26 182	
USD	85 000	Travel + Leisure Co., taux échelonné, 1 ^{er} avril 2024	114 485	111 415	
USD	200 000	Trulieve Cannabis Corp., 8 %, 6 octobre 2026	251 600	196 325	
	375 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	381 752	362 317	
USD	50 000	U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,38 %, 1 ^{er} mars 2026	64 143	56 784	
USD	45 000	Unisys Corp., 6,88 %, 1 ^{er} novembre 2027	59 656	43 002	
	145 000	United Parcel Service Inc., 2,13 %, 21 mai 2024	147 377	141 035	
USD	60 000	United Rentals North America Inc., 3,88 %, 15 novembre 2027	76 191	74 044	
	20 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	19 867	17 084	
USD	70 000	Verizon Communications Inc., 4,33 %, 21 septembre 2028	89 650	89 439	
	305 000	Vidéotron Ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	289 171	237 328	
USD	145 000	Vidéotron Ltée, 5,38 %, 15 juin 2024	189 528	190 270	
USD	55 000	Viking Cruises Ltd., 13 %, 15 mai 2025	75 466	76 554	
USD	65 000	Viking Cruises Ltd., 5,88 %, 15 septembre 2027	76 658	79 243	
USD	50 000	VistaJet Malta Finance PLC/XO Management Holding Inc., 6,38 %, 1 ^{er} février 2030	61 079	53 396	
USD	125 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,55 %, 15 juillet 2024	157 334	159 967	
USD	85 000	Vistra Operations Co., LLC, 3,7 %, 30 janvier 2027	99 821	103 171	
USD	225 000	Vistra Operations Co., LLC, 4,88 %, 13 mai 2024	294 157	292 611	
USD	70 000	Vital Energy Inc., 9,5 %, 15 janvier 2025	93 038	92 137	
	195 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	198 540	181 153	
	170 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	174 191	156 656	
	45 000	Wells Fargo & Co., 2,51 %, 27 octobre 2023	44 210	44 601	
	80 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 ^{er} mai 2026	75 347	75 306	
USD	50 000	Yum! Brands Inc., 3,88 %, 1 ^{er} novembre 2023	67 832	65 729	
			29 589 351	28 357 473	43,5
		OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES			
USD	585 000	Obligation du Trésor américain, 2,38 %, 31 mars 2029	730 053	707 442	
USD	265 000	Obligation du Trésor américain, 2,63 %, 31 juillet 2029	335 184	324 250	
USD	1 175 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 31 juillet 2027	1 517 148	1 467 199	
USD	1 425 000	Obligation du Trésor américain, 3,25 %, 31 août 2024	1 871 261	1 842 418	
USD	2 037 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	2 614 198	2 601 327	
USD	2 725 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 31 janvier 2028	3 615 790	3 504 818	
USD	110 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 février 2033	147 893	141 897	
USD	900 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2026	1 205 826	1 163 167	
USD	135 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mai 2028	179 468	174 887	
USD	140 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2053	178 280	177 959	
USD	500 000	Obligation du Trésor américain, 3,75 %, 15 avril 2026	671 946	648 222	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR (suite)					
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES (suite)					
USD	185 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 31 mars 2025	246 263	240 235	
USD	2 970 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 30 avril 2025	4 003 912	3 857 508	
USD	245 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 30 juin 2028	323 467	322 662	
USD	85 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 31 janvier 2025	113 231	110 842	
USD	30 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 juin 2026	39 336	39 333	
USD	1 095 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 30 septembre 2027	1 505 322	1 442 243	
USD	5 420 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 31 octobre 2024	7 306 370	7 093 759	
USD	150 000	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 novembre 2025	206 251	197 680	
USD	90 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 28 février 2025	123 488	118 301	
USD	35 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 15 mars 2026	48 254	46 412	
USD	103 948	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	127 454	121 192	
			27 110 395	26 343 753	40,4
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES					
	520 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	468 827	468 606	
	30 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} septembre 2025	27 564	27 592	
	70 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} juin 2027	63 569	63 219	
	399 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	380 552	377 888	
	190 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2026	177 981	176 852	
	35 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	30 559	30 544	
	1 315 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} décembre 2031	1 145 268	1 140 322	
	200 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	192 339	192 427	
	545 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} décembre 2053	388 622	402 243	
	85 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	79 705	79 237	
	935 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	915 129	914 751	
	3 150 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} décembre 2032	3 003 919	2 951 666	
	860 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} août 2024	852 071	840 211	
	3 675 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	3 493 468	3 517 448	
	875 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	860 079	854 431	
	400 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	390 800	387 874	
	3 145 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} mars 2028	3 140 473	3 121 053	
	1 985 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	1 960 680	1 956 376	
			17 571 605	17 502 740	26,9
Total de la (des) positions acheteur			74 271 351	72 203 966	110,8
POSITION(S) VENDEUR					
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES					
USD	(5 000)	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	(6 290)	(6 348)	0,0
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
USD	(35 000)	Apple Inc., 1,4 %, 5 août 2028	(41 819)	(40 034)	
USD	(50 000)	Bombardier Inc., 7,88 %, 15 avril 2027	(62 131)	(66 155)	
USD	(90 000)	Calpine Corp., 4,5 %, 15 février 2028	(111 216)	(108 056)	
USD	(65 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} mars 2030	(76 334)	(73 722)	
USD	(80 000)	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1 ^{er} février 2032	(87 875)	(86 538)	
USD	(70 000)	GFL Environmental Inc., 4,75 %, 15 juin 2029	(81 227)	(84 837)	
USD	(115 000)	HealthEquity Inc., 4,5 %, 1 ^{er} octobre 2029	(134 655)	(134 463)	
USD	(100 000)	MGM Resorts International, 4,75 %, 15 octobre 2028	(119 120)	(120 409)	
USD	(15 000)	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance, Corp., 4,5 %, 15 février 2029	(17 618)	(17 604)	
USD	(35 000)	Tenet Healthcare Corp., 4,88 %, 1 ^{er} janvier 2026	(45 427)	(45 204)	
USD	(20 000)	TransDigm Inc., 4,63 %, 15 janvier 2029	(22 593)	(23 600)	
USD	(60 000)	TransDigm Inc., 4,88 %, 1 ^{er} mai 2029	(72 790)	(71 092)	
USD	(25 000)	TransDigm Inc., 5,5 %, 15 novembre 2027	(33 012)	(31 276)	
USD	(125 000)	United Rentals North America Inc., 5,25 %, 15 janvier 2030	(157 540)	(158 229)	
USD	(100 000)	US Foods Inc., 4,75 %, 15 février 2029	(119 059)	(121 405)	
USD	(115 000)	Walt Disney Co. (The), 3,6 %, 13 janvier 2051	(126 946)	(121 154)	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) VENDEUR (suite)					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)					
USD	(55 000)	Wyndham Hotels & Resorts Inc., 4,38 %, 15 août 2028	(65 051)	(66 602)	
USD	(25 000)	Yum! Brands Inc., 5,38 %, 1 ^{er} avril 2032	(31 146)	(31 515)	
Total de la (des) position(s) vendeur			(1 405 559)	(1 401 895)	(2,2)
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			72 859 502	70 795 723	108,6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille					
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			72 859 502	70 795 723	108,6
Contrat(s) de change à terme				256 445	0,4
Swap(s) sur défaillance				(53 116)	(0,1)
Total du portefeuille de placements			72 859 502	70 999 052	109,0
Autres actifs (passifs) nets				(5 837 347)	(9,0)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				65 161 705	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	38 407 222	USD	28 737 080	1,34	343 388
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	96 583	USD	72 462	1,33	603
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	36 531	USD	27 348	1,34	308
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	112	USD	85	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	513	USD	389	1,32	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	888	USD	675	1,32	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	1 441	USD	1 093	1,32	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	58 430	USD	44 312	1,32	(264)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	44 312	CAD	58 430	0,76	264
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	18 083	CAD	23 807	0,76	145
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 732	CAD	3 596	0,76	22
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 631	CAD	3 464	0,76	21
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 211	CAD	2 911	0,76	18
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 063	CAD	1 399	0,76	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 093	CAD	1 441	0,76	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	675	CAD	888	0,76	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	389	CAD	513	0,76	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	85	CAD	112	0,76	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	27 348	CAD	36 531	0,75	(308)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	72 462	CAD	96 583	0,75	(603)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	332 496	CAD	444 244	0,75	(3 834)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	476 129	CAD	636 150	0,75	(5 491)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	585 451	CAD	782 214	0,75	(6 751)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	590 029	CAD	788 329	0,75	(6 804)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	859 378	CAD	1 148 203	0,75	(9 910)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	4 714 380	CAD	6 298 820	0,75	(54 367)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								256 445

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Swap(s) sur défaillance

Swap(s)	Nombre de contrats	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
Verse tous les trimestres 1,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX-NAIGS40 V1 5Y P 1 %	1	Citigroup Global Market Inc.	A+	20 juin 2028	2 680 000	(53 116)
Valeur totale du (des) swap(s) sur défaillance						(53 116)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	344	(88)	-	256
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	344	(88)	-	256
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(88)	88	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(53)	-	-	(53)
Total	(141)	88	-	(53)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	497	(121)	-	376
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	497	(121)	-	376
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(121)	121	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(121)	121	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	2
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 544 179	2 459 613	71 182	83 860	2 402 847	4 269 284	95 479	378 723
Parts rachetables émises	177 649	506 369	1 206	11 450	554 150	1 311 725	590	199 731
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	27 517	27 105	1 146	959	48 519	56 742	1 850	5 574
Parts rachetables rachetées	(372 120)	(1 135 547)	(39 145)	(27 356)	(765 450)	(2 414 538)	(19 392)	(423 791)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 377 225	1 857 540	34 389	68 913	2 240 066	3 223 213	78 527	160 237

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 124 044	1 755 083	65 643	76 050	102 498	94 702	485 172	525 778
Parts rachetables émises	258 133	929 114	5 442	23 416	19 803	9 398	679	8 195
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	31 141	36 234	1 527	1 474	1 613	1 397	10 622	7 869
Parts rachetables rachetées	(298 331)	(1 241 676)	(23 369)	(27 270)	(61 613)	(27 271)	(8 144)	(48 689)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 114 987	1 478 755	49 243	73 670	62 301	78 226	488 329	493 153

	Série W		Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	609 679	1 584 355	38 972	164 378	1 570 000	1 310 000	80 000	20 000
Parts rachetables émises	248 865	195 108	34 050	19 250	110 000	660 000	-	60 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	18 564	22 462	1 579	3 066	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(141 533)	(1 057 414)	(8 493)	(118 693)	(1 550 000)	(290 000)	(50 000)	(20 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	735 575	744 511	66 108	68 001	130 000	1 680 000	30 000	60 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,300	0,17
Série AH	1,300	0,17
Série F	0,800	0,17
Série FH	0,800	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,11
Série FNB en \$ CA	0,800	0,17
Série FNB en \$ US	0,800	0,17

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	18 053
Garanties (hors trésorerie)	-	18 981

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	8	24
Charges	(3)	(15)
Revenu tiré des prêts de titres	5	9
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	31,2	62,7

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
Obligations fédérales américaines et obligations garanties	31,2
Obligations étrangères	28,5
Obligations de sociétés	24,6
Autres actifs (passifs) nets	8,7
Placement(s) à court terme	5,6
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	3,3
Contrat(s) de change à terme	0,4
Obligations et garanties provinciales	0,1
Total de la (des) position(s) acheteur	102,4
Position(s) vendeur	
Obligations étrangères	(2,0)
Obligations de sociétés	(0,4)
Total de la (des) position(s) vendeur	(2,4)
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	67,9
AA/Aa/A+	0,6
A	5,7
BBB/Baa/B++	20,6
BB/Ba/B+	11,5
B	3,2
CCC/Caa/C++	1,3
C et moins	0,2
Aucune	0,3
Total	111,3

Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	35,0
AA/Aa/A+	7,1
A	6,5
BBB/Baa/B++	23,1
BB/Ba/B+	17,7
B	2,3
CCC/Caa/C++	1,0
Aucune	1,1
Total	93,8

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	38 002	(28 071)	9 931	15,2
Total	38 002	(28 071)	9 931	15,2

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	60 416	(48 376)	12 040	12,3
Total	60 416	(48 376)	12 040	12,3

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 993 000 \$ (1 204 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	10 619	30 938	13 825	15 414	70 796

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	21 756	30 764	24 430	11 955	88 905

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 603 000 \$ (636 000\$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	72 204	-	72 204
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	256	-	256
Swap(s)	-	(53)	-	(53)
Total	-	72 407	-	72 407

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	(1 408)	-	(1 408)
Total	-	(1 408)	-	(1 408)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	85 746	-	85 746
Placement(s) à court terme	-	5 479	-	5 479
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	376	-	376
Total	-	91 601	-	91 601

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	(2 320)	-	(2 320)
Total	-	(2 320)	-	(2 320)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

États financiers (non audité)

États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	1 525 645	1 150 012
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	101 372	568 541
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	5 662	5 307
Swaps, options sur swaps et options	56	2 606
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	1 310	3 704
Rabais sur frais à recevoir	2	3
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	242	122
Intérêts à recevoir	-	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	34 561
Montant à recevoir pour la souscription de parts	2 310	1 686
Autres actifs	42	43
	1 636 642	1 766 585
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	102 855	154 636
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3 699	4 109
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	7	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	9 674	18
Montant à payer pour le rachat de parts	5 170	5 345
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	28	59
Frais d'administration à payer	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
Frais de rendement à payer	-	-
	121 433	164 167
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 515 209	1 602 418

États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Série A	186 846	202 265	12,64	11,78	14 779 037	17 166 262
Série AH	2 731	2 770	9,06*	8,42*	227 659	242 985
Série F	511 921	535 224	13,18	12,22	38 839 732	43 812 920
Série FH	22 683	24 179	9,28*	8,58*	1 845 028	2 080 582
Série I	441 250	517 150	13,64	12,57	32 346 702	41 156 063
Série IH	1 639	2 392	9,50*	8,73*	130 264	202 361
Série P	9 233	9 432	11,25	10,38	820 515	908 771
Série PH	5 261	5 103	9,00*	8,28*	441 440	455 240
Série W	123 202	104 573	13,45	12,40	9 160 143	8 433 180
Série WH	300	282	8,26*	7,60*	27 377	27 377
Série FNB en \$ CA	195 596	190 041	25,32	23,46	7 725 000	8 100 000
Série FNB couverte en \$ US	14 547	9 007	18,93*	17,51*	580 000	380 000

*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des séries AH, FH, IH, PH, WH et FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	8 033	7 895
Intérêts aux fins des distributions	3 176	15
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(22 539)	(553)
Charge d'intérêts sur les swaps	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	(2 067)	(375)
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 324	(65 675)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	142 537	(455 692)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	130 464	(514 385)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(5 063)	(1 850)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	64	-
Rabais sur frais	278	283
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1 963	-
Total des autres revenus	(2 758)	(1 567)
Total des revenus	127 706	(515 952)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	5 161	7 133
Frais d'administration (note 5)	1 103	1 524
Primes de rendement (note 5)	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2 938	3 954
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	142
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	-	91
Retenues d'impôts	1 476	1 662
Taxe de vente harmonisée	661	909
Autres frais	5	-
Total des charges	11 345	15 416
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(39)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	116 361	(531 329)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	13 086	(59 726)	0,82	(3,07)	15 911 182	19 466 300
Série AH	138	(973)	0,58	(2,55)	235 034	380 368
Série F	38 206	(181 293)	0,93	(3,16)	41 226 273	57 330 701
Série FH	1 312	(9 127)	0,66	(2,61)	1 989 400	3 508 930
Série I	36 866	(179 563)	1,00	(3,07)	36 898 390	58 431 576
Série IH	104	(482)	0,69	(2,33)	151 710	206 039
Série P	730	(2 223)	0,84	(2,45)	866 519	908 912
Série PH	315	(2 637)	0,70	(2,31)	451 157	1 141 937
Série W	9 495	(29 013)	1,04	(2,98)	9 100 306	9 737 778
Série WH	18	(59)	0,65	(2,13)	27 377	27 377
Série FNB en \$ CA	15 380	(62 260)	1,83	(6,17)	8 408 011	10 088 812
Série FNB couverte en \$ US	711	(3 973)	1,53	(5,52)	462 762	719 227

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série A		Série AH		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	202 265	292 697	2 770	5 075	535 224	944 184
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 086	(59 726)	138	(973)	38 206	(181 293)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	2	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	2	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	14 061	28 805	103	1 111	68 571	137 199
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	(2)	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(42 566)	(44 190)	(280)	(1 622)	(130 080)	(279 875)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(28 505)	(15 387)	(177)	(511)	(61 509)	(142 676)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(15 419)	(75 111)	(39)	(1 484)	(23 303)	(323 969)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	186 846	217 586	2 731	3 591	511 921	620 215

	Série FH		Série I		Série IH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	24 179	50 854	517 150	1 002 064	2 392	2 497
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 312	(9 127)	36 866	(179 563)	104	(482)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	(2)	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	(2)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 177	9 262	25 509	41 908	-	460
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	2	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 985)	(17 624)	(138 275)	(254 516)	(857)	(133)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(2 808)	(8 362)	(112 766)	(212 606)	(857)	327
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 496)	(17 489)	(75 900)	(392 171)	(753)	(155)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	22 683	33 365	441 250	609 893	1 639	2 342

	Série P		Série PH		Série W	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	9 432	10 243	5 103	13 365	104 573	143 034
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	730	(2 223)	315	(2 637)	9 495	(29 013)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	457	2 661	-	2 924	22 509	24 424
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 386)	(1 921)	(157)	(4 876)	(13 375)	(19 919)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(929)	740	(157)	(1 952)	9 134	4 505
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(199)	(1 483)	158	(4 589)	18 629	(24 508)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 233	8 760	5 261	8 776	123 202	118 526

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	282	321	190 041	342 670	9 007	22 360
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18	(59)	15 380	(62 260)	711	(3 973)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	(309)	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	(1)	-	-
Remboursement de capital	-	-	(305)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(305)	(310)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	34 249	83 682	9 621	5 652
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(43 769)	(120 394)	(4 792)	(12 940)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	(9 520)	(36 712)	4 829	(7 288)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18	(59)	5 555	(99 282)	5 540	(11 261)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	300	262	195 596	243 388	14 547	11 099
	Total du Fonds					
	2023	2022				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 602 418	2 829 364				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	116 361	(531 329)				
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	(311)				
Profits nets réalisés	-	1				
Remboursement de capital	(305)	-				
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(305)	(310)				
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	176 257	338 088				
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-				
Rachat de parts rachetables	(379 522)	(758 010)				
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(203 265)	(419 922)				
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(87 209)	(951 561)				
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 515 209	1 877 803				

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	116 361	(531 329)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 324)	65 675
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1 094)	(1 312)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2 938	3 954
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(142 537)	455 692
Proceeds from sale, maturity of investments, derivatives and short sales	1 705 176	3 361 207
Purchase of investments, derivatives and cover short purchases	(1 945 664)	(2 349 493)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	2 393	(1 404)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(120)	828
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des autres actifs	-	(57)
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(31)	(16)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(11)
Augmentation (diminution) des primes de rendement à payer	-	(17 702)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	(1 974)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(263 894)	984 058
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(305)	(310)
Produit de l'émission de parts rachetables	175 634	340 281
Montant versé au rachat de parts rachetables	(379 698)	(758 642)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(204 369)	(418 671)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1 094	1 312
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(468 263)	565 387
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	568 541	232 738
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	101 372	799 437
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 437	7 060
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3 176	15
Dividendes payés*	(2 060)	(375)
Intérêts payés*	-	(91)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) ACHETEUR					
É.-U.					
USD	114 365	Airbnb Inc., catégorie A	18 887 080	19 416 885	
USD	469 030	Alphabet Inc., catégorie A	67 870 945	74 375 295	
USD	422 375	Amazon.com Inc.	64 518 202	72 941 801	
USD	131 015	Applied Materials Inc.	22 835 992	25 086 669	
USD	13 825	Chipotle Mexican Grill Inc.	29 107 308	39 175 076	
USD	249 917	Constellation Energy Corp.	24 897 151	30 310 149	
USD	66 995	Costco Wholesale Corp.	42 666 149	47 782 101	
USD	132 125	DexCom Inc.	21 816 561	22 493 439	
USD	82 590	Eli Lilly and Co.	39 518 019	51 311 619	
USD	60 745	First Solar Inc.	14 875 209	15 296 911	
USD	588 070	Liberty Media Corp., - Liberty Formula One, catégorie C	52 161 708	58 646 563	
USD	60 305	Lululemon Athletica Inc.	29 780 267	30 238 005	
USD	107 685	Mastercard Inc., catégorie A	49 944 984	56 106 488	
USD	254 260	Microsoft Corp.	93 720 800	114 704 407	
USD	55 985	Netflix Inc.	25 048 390	32 669 438	
USD	226 860	NextEra Energy Inc.	23 395 879	22 299 533	
USD	153 434	NVIDIA Corp.	53 825 175	85 983 761	
USD	308 320	ON Semiconductor Corp.	34 320 245	38 630 910	
USD	85 920	Progressive Corp. (The)	15 816 937	15 066 687	
USD	92 405	ServiceNow Inc.	57 803 648	68 792 728	
USD	74 855	Synopsys Inc.	39 874 308	43 177 067	
USD	47 445	UnitedHealth Group Inc.	30 675 804	30 209 552	
USD	204 882	Visa Inc., catégorie A	57 450 141	64 456 211	
USD	140 935	Waste Management Inc.	30 556 735	32 378 145	
			941 367 637	1 091 549 440	72,1
FRANCE					
EUR	204 430	Airbus SE	34 972 423	39 114 670	
EUR	46 320	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	41 691 885	57 785 335	
			76 664 308	96 900 005	6,4
PAYS-BAS					
EUR	77 008	ASML Holding NV	57 308 891	73 805 318	4,9
IRLANDE					
GBP	144 000	Flutter Entertainment PLC	34 469 091	38 278 705	
EUR	273 795	Kingspan Group PLC	24 744 488	24 103 554	
			59 213 579	62 382 259	4,1
SUISSE					
CHF	266 635	Compagnie Financière Richemont SA, inscrite	56 321 551	59 847 526	3,9
ALLEMAGNE					
EUR	109 500	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG, privilégiées	18 651 606	18 005 443	
EUR	84 840	Rheinmetall AG	32 181 848	30 758 594	
			50 833 454	48 764 037	3,2
TAÏWAN					
USD	257 630	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	32 442 349	34 443 526	2,3
DANEMARK					
DKK	145 135	Novo Nordisk AS, catégorie B	23 468 096	30 978 089	2,0
CORÉE DU SUD					
KRW	40 105	Samsung SDI Co., Ltd.	30 328 002	26 974 817	1,8
		Total de la (des) position(s) acheteur	1 327 947 867	1 525 645 017	100,7
POSITION(S) VENDEUR					
PAYS-BAS					
EUR	(108 325)	Randstad NV	(7 541 479)	(7 564 914)	(0,5)
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
USD	(164 500)	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	(22 299 186)	(22 432 826)	(1,5)

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
POSITION(S) VENDEUR (suite)					
É.-U.					
USD	(66 520)	American Express Co.	(14 338 509)	(15 350 917)	
USD	(160 940)	Exxon Mobil Corp.	(23 355 392)	(22 866 265)	
USD	(257 820)	Intel Corp.	(11 020 074)	(11 421 333)	
USD	(80 215)	Robert Half International Inc.	(7 736 363)	(7 993 240)	
USD	(73 120)	Walmart Inc.	(14 183 744)	(15 225 354)	
			(70 634 082)	(72 857 109)	(4,8)
Total de la (des) position(s) vendeur			(100 474 747)	(102 854 849)	(6,8)
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			1 227 473 120	1 422 790 168	93,9
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(1 350 841)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			1 226 122 279	1 422 790 168	93,9
Contrat(s) de change à terme				2 483 591	0,1
Position(s) acheteur sur option(s)				55 540	0,0
Position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)				(520 786)	0,0
Total du portefeuille de placements				1 424 808 513	94,0
Autres actifs (passifs) nets				90 400 183	6,0
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				1 515 208 696	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie ^a	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 juillet 2023	CAD	40 425 620	CHF	27 400 000	1,48	(159 756)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 juillet 2023	CAD	47 877 545	DKK	248 100 000	0,19	(308 465)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 juillet 2023	CAD	130 623 131	EUR	90 850 000	1,44	(746 058)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 juillet 2023	CAD	130 620 405	EUR	90 850 000	1,44	(748 783)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 juillet 2023	CAD	33 701 776	GBP	20 065 000	1,68	(53 955)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	60 276	USD	45 223	1,33	376
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	8 532	USD	6 387	1,34	72
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	916	USD	691	1,33	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	1	USD	1	1,32	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	926	USD	700	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	146	USD	111	1,32	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	263	USD	200	1,31	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	2 513	USD	1 912	1,31	(19)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	3 674	USD	2 797	1,31	(31)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	4 009	USD	3 051	1,31	(32)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	23 524	USD	17 853	1,32	(124)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	20 050	USD	15 263	1,31	(167)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	26 199	USD	19 907	1,32	(168)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	21 855	USD	16 631	1,31	(173)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	55 403	USD	42 017	1,32	(250)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	34 660	USD	26 385	1,31	(288)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	38 401	USD	29 222	1,31	(305)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	64 629	USD	49 198	1,31	(537)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	71 216	USD	54 192	1,31	(565)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	164 064	USD	124 846	1,31	(1 301)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	180 652	USD	137 520	1,31	(1 501)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	281 513	USD	214 300	1,31	(2 339)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	309 693	USD	235 664	1,31	(2 456)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 858 988	CAD	2 451 284	0,76	11 047
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	180 031	CAD	238 048	0,76	413
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	115 369	CAD	152 547	0,76	265

^aNote de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	41 819	CAD	55 296	0,76	96
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	21 849	CAD	28 891	0,76	50
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	13 035	CAD	17 236	0,76	30
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 455	CAD	4 552	0,76	24
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	8 000	CAD	10 580	0,76	17
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	946	CAD	1 244	0,76	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 383	CAD	3 151	0,76	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 570	CAD	4 766	0,75	(37)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	19 739	CAD	26 348	0,75	(202)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	51 817	CAD	69 164	0,75	(530)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	63 266	CAD	84 446	0,75	(647)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	144 127	CAD	192 378	0,75	(1 474)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	221 537	CAD	295 993	0,75	(2 555)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	265 649	CAD	354 584	0,75	(2 717)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	1 211 150	CAD	1 618 202	0,75	(13 967)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	2 025 146	CAD	2 705 771	0,75	(23 354)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	3 930 679	CAD	5 251 729	0,75	(45 329)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	8 901 975	CAD	11 893 810	0,75	(102 658)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	16 859 615	CAD	22 525 908	0,75	(194 426)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	19 juillet 2023	CAD	77 277 181	USD	58 650 000	1,32	(401 588)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	05 juillet 2023	CAD	123 407 912	USD	90 575 000	1,36	3 418 682
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	05 juillet 2023	CAD	37 606 321	USD	28 000 000	1,34	513 321
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	05 juillet 2023	CAD	37 450 252	USD	28 000 000	1,34	357 252
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	05 juillet 2023	CAD	52 368 279	USD	39 600 000	1,32	(91 821)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	19 juillet 2023	CAD	77 409 197	USD	58 650 000	1,32	(269 573)
RBC Dominion valeurs mobilières Inc., Toronto	A-1+	14 juillet 2023	CAD	32 033 174	KRW	30 500 000 000	0,00	1 360 087
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								2 483 591

Position(s) acheteur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
3142	CME, contrats à terme SOFR de 3 mois, (option d'achat) – 98,25	2 500	15 septembre 2023	98,25	USD	236 705	52 030
1060	Indice S&P 500, (option de vente) – 4 350,00	100	30 juin 2023	4 350,00	USD	464 765	3 510
Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur option(s)						701 470	55 540

Position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)

Contrat(s)	Nom du contrat à terme standardisé	Date d'expiration	Prix (\$)	Devise	Valeur du contrat (\$)	Juste valeur (\$)	Profit (perte) latent(e) (\$)
(78)	United States S&P 500 E-mini Future	15 septembre 2023	4 387,45	USD	(22 667 870)	(23 188 656)	(520 786)
Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur contrat(s) à terme standardisé(s)						(23 188 656)	(520 786)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	5 662	(374)	-	5 288
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	5 662	(374)	-	5 288
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3 178)	374	-	(2 804)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(3 178)	374	-	(2 804)

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	5 012	(1 489)	-	3 523
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	318	-	-	318
Total	5 330	(1 489)	-	3 841
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(4 109)	1 489	-	(2 620)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(4 109)	1 489	-	(2 620)

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	2 863	3 783
Paiements indirects [†]	308	363

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Série A		Série AH		Série F		Série FH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	17 166 262	19 875 753	242 985	382 633	43 812 920	62 534 470	2 080 582	3 802 511
Parts rachetables émises	1 175 862	2 225 417	8 726	95 062	5 513 696	10 390 020	99 991	777 265
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	(170)	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(3 563 087)	(3 474 562)	(24 052)	(143 117)	(10 486 884)	(21 426 153)	(335 545)	(1 512 584)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	14 779 037	18 626 438	227 659	334 578	38 839 732	51 498 337	1 845 028	3 067 192

	Série I		Série IH		Série P		Série PH	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	41 156 063	65 331 080	202 361	185 972	908 771	806 443	455 240	1 046 787
Parts rachetables émises	1 976 006	3 193 577	-	38 118	42 956	232 284	-	249 273
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	148	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(10 785 367)	(18 981 850)	(72 097)	(11 095)	(131 212)	(178 317)	(13 800)	(455 394)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	32 346 702	49 542 955	130 264	212 995	820 515	860 410	441 440	840 666

	Série W		Série WH		Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 433 180	9 432 216	27 377	27 377	8 100 000	11 825 000	380 000	820 000
Parts rachetables émises	1 781 722	1 821 372	-	-	1 450 000	3 425 000	400 000	240 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	(16)	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 054 759)	(1 506 357)	-	-	(1 825 000)	(4 725 000)	(200 000)	(560 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 160 143	9 747 215	27 377	27 377	7 725 000	10 525 000	580 000	500 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,900	0,22
Série AH	1,900	0,22
Série F	0,900	0,22
Série FH	0,900	0,22
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série IH	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,22
Série PH	Payés directement par les investisseurs	0,22
Série W	Payés directement par les investisseurs	0,16
Série WH	Payés directement par les investisseurs	0,16
Série FNB en \$ CA	0,900	0,19
Série FNB couverte en \$ US	0,900	0,19

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	3 513
Garanties (hors trésorerie)	-	3 717

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	68	-
Charges	(4)	-
Revenu tiré des prêts de titres	64	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	5,7	-

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Position(s) acheteur	
É.-U.	54,7
Autres actifs (passifs) nets	37,7
France	5,1
Danemark	4,5
Pays-Bas	3,8
Allemagne	3,1
R.-U.	0,6
Option(s)	0,1
Contrat(s) de change à terme	0,1
Swap(s) sur rendement total	0,0
Total de la (des) position(s) acheteur	109,7

Position(s) vendeur

É.-U.	(7,7)
Japon	(0,8)
Fonds négocié(s) en bourse	(0,7)
Suède	(0,5)
Contrat(s) à terme standardisé(s)	0,0
Total de la (des) position(s) vendeur	(9,7)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 14 279 000 \$ (99 538 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	1 092 104	(356 231)	735 873	48,6
Franc suisse	41 981	(40 585)	1 396	0,1
Couronne danoise	48 393	(48 186)	207	0,0
Livre sterling	33 828	(33 756)	72	0,0
Couronne suédoise	60	-	60	0,0
Dollar de Singapour	19	-	19	0,0
Dollar australien	2	-	2	0,0
Dollar de Hong Kong	(6)	-	(6)	0,0
Euro	261 883	(262 738)	(855)	(0,1)
Yen japonais	(1 663)	-	(1 663)	(0,1)
Won coréen	27 020	(30 673)	(3 653)	(0,2)
Total	1 503 621	(772 169)	731 452	48,3

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	1 220 616	(526 779)	693 837	43,3
Couronne danoise	101 811	(101 061)	750	0,0
Yen japonais	498	-	498	0,0
Franc suisse	452	-	452	0,0
Couronne suédoise	317	-	317	0,0
Won coréen	48	-	48	0,0
Dollar de Singapour	20	-	20	0,0
Dollar australien	3	-	3	0,0
Couronne norvégienne	1	-	1	0,0
Livre sterling	32 821	(33 487)	(666)	0,0
Dollar de Hong Kong	(981)	-	(981)	(0,1)
Euro	231 171	(245 873)	(14 702)	(0,9)
Total	1 586 777	(907 200)	679 577	42,3

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 73 145 000 \$ (67 958 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	1 525 645	-	-	1 525 645
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 484	-	2 484
Option(s)	56	-	-	56
Total	1 525 701	2 484	-	1 528 185

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(80 422)	-	-	(80 422)
Fonds négocié(s) en bourse	(22 433)	-	-	(22 433)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	(521)	-	-	(521)
Total	(103 376)	-	-	(103 376)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	1 150 012	-	-	1 150 012
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	903	-	903
Option(s)	2 288	-	-	2 288
Swaps	-	318	-	318
Total	1 152 300	1 221	-	1 153 521

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	(142 467)	-	-	(142 467)
Fonds négocié(s) en bourse	(12 169)	-	-	(12 169)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	295	-	-	295
Total	(154 341)	-	-	(154 341)

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

Notes des états financiers (non audité)

1. LES FONDS

Les fonds suivants (les Fonds) sont des fiducies de fonds commun de placement à capital variable établies en vertu des lois de la province de l'Ontario par des déclarations de fiducie.

CI Investments Inc. est le gestionnaire et le fiduciaire (le « gestionnaire » et le « fiduciaire ») des Fonds. Le gestionnaire est une filiale en propriété exclusive de CI Financial Corp. (Bourse de Toronto [TSX] : CIX). La Compagnie Trust CIBC Mellon est le dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, 2^e étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 16 août 2023.

Chaque Fonds est considéré comme étant un « fonds alternatif », ce qui signifie qu'il a obtenu une dispense à l'égard du Règlement 81-102 sur les fonds d'investissement lui permettant d'avoir recours à des stratégies généralement interdites aux fonds communs de placement traditionnels, comme la capacité d'investir plus de 10 % de sa valeur liquidative (NAV) dans des titres d'un seul émetteur, la capacité d'emprunter des espèces, la capacité d'effectuer des ventes à découvert au-delà des limites prescrites pour les fonds communs de placement traditionnels et l'utilisation générale de l'effet de levier.

Les objectifs de placement du Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI sont de réaliser des gains en capital et d'offrir aux détenteurs de parts des rendements attrayants, ajustés en fonction du risque, sur un cycle d'investissement.

L'objectif de placement du Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI consiste à générer des rendements totaux positifs constants en mettant l'accent sur la préservation du capital et une faible corrélation par rapport aux marchés traditionnels des actions et des titres à revenu fixe. Le Fonds sera principalement investi dans des titres de créance de sociétés et d'institutions financières de qualité supérieure dans le monde développé.

L'objectif de placement du Fonds alternatif multistratégie CI est de fournir des rendements absolus positifs à long terme, tout en minimisant le risque de baisse, en investissant principalement dans des fonds communs de placement alternatifs et/ou des fonds négociés en Bourse.

L'objectif de placement du Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI est de générer des rendements absolus élevés à long terme, équilibrés par un esprit de préservation du capital et en investissant en premier lieu dans des actions nord-américaines orientées vers la croissance.

L'objectif de placement du FNB de produits de base généraux CI Auspice (le Fonds) vise à reproduire, dans la mesure du possible et avant les frais et les dépenses, le rendement de l'indice Auspice Broad Commodity Excess Return (l'indice), ou de tout successeur de cet indice, en investissant dans des instruments financiers, y compris des contrats à terme et des dérivés, pour obtenir une exposition à l'indice. L'indice utilise actuellement une méthodologie quantitative pour suivre un portefeuille diversifié de contrats à terme sur matières premières, ou composants, dans trois secteurs : agriculture, énergie et métaux.

L'objectif de placement du Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret est de générer des rendements absolus positifs ayant une faible volatilité au cours d'un cycle du marché, quelles que soient les conditions du marché ou l'orientation générale du marché, en investissant principalement dans des titres de créance à l'échelle de l'univers des titres de créance, notamment des liquidités, des titres de créance gouvernementaux, des titres de créance de sociétés de qualité supérieure, des titres de créance à rendement élevé, des dérivés de crédit et d'autres titres productifs de revenu provenant du monde entier.

L'objectif de placement du Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret est de générer un revenu ayant une faible volatilité au cours d'un cycle du marché, quelles que soient les conditions du marché ou l'orientation générale du marché, en investissant principalement dans des titres de créance à l'échelle de l'univers des titres de créance et dans la trésorerie et les équivalents de trésorerie. Le Fonds cherche à dégager un revenu tout en ciblant une faible corrélation avec les actions et les instruments de revenu traditionnels.

L'objectif de placement du Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro est de générer des rendements absolus rajustés en fonction du risque en investissant dans des actions mondiales de croissance à moyen et à long terme, tout en mettant l'accent sur la préservation du capital.

Lors de la conversion, les séries de catégories F suivantes : catégorie F série 0121, catégorie F série 0221, catégorie F série 0319, catégorie F série 0321, catégorie F série 0420, catégorie F série 0421, catégorie F série 0521, catégorie F série 060820, catégorie F série 0618, catégorie F série 0620, catégorie F série 0621, catégorie F série 0720, catégorie F série 0721, catégorie F série 0818, catégorie F série 0918, catégorie F série 0920, catégorie F série 1018, catégorie F série 1020, catégorie F série 1118, catégorie F série 1119, les catégories F série 1120 et catégorie F série 1220 ont été consolidées dans la catégorie F, qui a ensuite été renommée catégorie Y le 6 août 2021. Lors de la conversion, les catégories F - série \$ US suivantes : catégorie F - \$ US série 0319, catégorie F - \$ US série 0321, catégorie F - \$ US série 0420, catégorie F - \$ US série 060820, catégorie F - \$ US série 0620, catégorie F - \$ US série 0918 et catégorie F - \$ US série 1120 ont été regroupées dans la catégorie F - \$ US série 0818, qui a alors été renommée catégorie YH le 6 août 2021.

Les séries suivantes ont commencé leurs activités aux dates suivantes :

Fonds	Série A	Série AH	Série F
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	12 août 2021	12 août 2021	12 août 2021
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	7 nov. 2018	9 nov. 2020	7 nov. 2018
Fonds alternatif multistratégie CI	13 sept. 2022	13 sept. 2022	13 sept. 2022
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	8 juill. 2021	8 juill. 2021	8 juill. 2021
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	16 mai 2023	-	16 mai 2023
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	7 nov. 2018	2 août 2019	7 nov. 2018
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	14 mai 2020	14 mai 2020	14 mai 2020
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	7 nov. 2018	9 nov. 2020	7 nov. 2018
Fonds (suite)	Série FH	Série I	Série IH
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	12 août 2021	12 août 2021	12 août 2021
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	9 nov. 2020	7 nov. 2018	9 nov. 2020
Fonds alternatif multistratégie CI	13 sept. 2022	13 sept. 2022	13 sept. 2022
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	8 juill. 2021	8 juill. 2021	8 juill. 2021
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	-	16 mai 2023	-
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	2 août 2019	7 nov. 2018	2 août 2019
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	14 mai 2020	14 mai 2020	14 mai 2020
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	9 nov. 2020	7 nov. 2018	9 nov. 2020

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Série P	Série PH	Série W
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	12 août 2021	12 août 2021	12 août 2021*
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	19 mai 2020	9 nov. 2020	27 sept. 2019*
Fonds alternatif multistratégie CI	13 sept. 2022	13 sept. 2022	4 nov. 2022*
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	8 juill. 2021	8 juill. 2021	12 août 2021*
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	16 mai 2023	-	16 mai 2023*
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	19 mai 2020	19 mai 2020	27 sept. 2019*
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	14 mai 2020	14 mai 2020	14 mai 2020*
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	19 mai 2020	9 nov. 2020	27 sept. 2019*

Fonds (suite)	Série WH	Série Y	Série YH
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	12 août 2021*	8 juin 2018	31 août 2018
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	12 août 2021*	-	-
Fonds alternatif multistratégie CI	4 nov. 2022*	-	-
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	12 août 2021*	-	-
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	-	-	-
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	22 juin 2020*	-	-
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	22 juin 2020*	-	-
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	12 août 2021*	-	-

Fonds (suite)	Parts ordinaires couvertes	Série FNB couverte en \$ CA	Série FNB couverte en \$ US
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	-	12 août 2021	12 août 2021
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	-	23 janv. 2020	23 janv. 2020
Fonds alternatif multistratégie CI	-	-	-
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	-	8 juill. 2021	8 juill. 2021
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	22 sept. 2022	-	-
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	-	23 janv. 2020	23 janv. 2020
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	-	14 mai 2020	14 mai 2020
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	-	23 janv. 2020	18 janv. 2021

*Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les Fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., une société affiliée de CI Conseil privé S.E.C.

Les parts de série A sont offertes à tous les investisseurs et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série AH sont offertes à tous les investisseurs et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série F sont offertes aux investisseurs qui participent à des programmes à

honoraires et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série FH sont offertes aux investisseurs qui participent à des programmes à honoraires et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série I ne sont offertes qu'aux investisseurs institutionnels et aux investisseurs qui ont été approuvés par le gestionnaire et qui ont contracté avec lui un engagement relatif aux comptes de série I, et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série IH ne sont offertes qu'aux investisseurs institutionnels et aux investisseurs qui ont été approuvés par le gestionnaire et qui ont contracté avec lui un engagement relatif aux comptes de série I, et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série P sont offertes à tous les investisseurs et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série PH sont offertes à tous les investisseurs et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série Y ne sont offertes qu'à certains investisseurs dans le cadre de la réorganisation du Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série YH ne sont offertes qu'à certains investisseurs dans le cadre de la réorganisation du Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série W sont offertes aux investisseurs qui participent à un programme Portefeuilles gérés de Clientèle privée et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série WH sont offertes aux investisseurs qui participent à un programme Portefeuilles gérés de Clientèle privée et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts de série FNB en \$ CA sont cotées à la TSX et ne peuvent être souscrites qu'en dollars canadiens. Les parts de série FNB couverte en \$ US sont cotées à la TSX et ne peuvent être souscrites qu'en dollars américains. Les parts ordinaires couvertes sont cotées à la cote de la TSX et ne peuvent être achetées qu'en dollars canadiens.

Les Fonds offrent des séries couvertes pour permettre aux investisseurs d'obtenir une couverture contre les fluctuations de change entre la monnaie de la série couverte et la monnaie fonctionnelle de chacun des Fonds. Les parts des séries couvertes sont les parts de série AH, de série FH, de série IH, de série PH, de série YH, de série WH, de série FNB couverte en \$ US et parts ordinaires couvertes (les « séries couvertes »).

Les parts de série A, de série AH, de série F, de série FH, de série I, de série IH, de série P, de série PH, de série Y, de série YH, de série W et de série WH sont appelées les parts des séries de fonds communs de placement (les « séries de fonds communs de placement »).

Les parts de série FNB en \$ CA, de série FNB couverte en \$ US et parts ordinaires couvertes sont appelées parts des séries FNB.

Les états de la situation financière sont au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le cas échéant. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, sauf dans le cas des Fonds lancés au cours de l'une ou l'autre de ces périodes; pour ceux-ci, les données fournies couvrent la période allant de la date de création aux 30 juin 2023 et 2022, le cas échéant.

2. RÉSUMÉ DES PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Les présents états financiers ont été établis conformément aux *Normes internationales d'information financière* (« IFRS ») publiées par l'International Accounting Standards Board.

Les principales méthodes comptables des Fonds sont résumées ci-après :

a. Classement et comptabilisation des instruments financiers

Les Fonds classent et évaluent leurs placements, entre autres dans des titres à revenu fixe, des titres de capitaux propres, des fonds de placement, des fonds négociés en Bourse et des dérivés, selon le modèle économique des Fonds pour la gestion de ces actifs financiers et les caractéristiques de flux de trésorerie contractuels des actifs financiers. Les portefeuilles d'actifs financiers des Fonds sont gérés et leur rendement est évalué selon la juste valeur. Les Fonds mettent surtout l'accent sur les informations sur la

Notes des états financiers (non audité) (suite)

juste valeur et utilisent celles-ci pour évaluer le rendement des actifs et pour prendre des décisions. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance des Fonds correspondent uniquement à du capital et à des intérêts. Ces titres ne sont pas détenus aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels ni aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels et de la vente de ces titres. La perception de flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à la réalisation de l'objectif du modèle économique des Fonds. Par conséquent, tous les placements et les dérivés sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »). Les ventes à découvert sont comptabilisées en tant que passifs financiers à la JVRN. Les contrats de dérivés dont la juste valeur est négative sont présentés en tant que passifs à la JVRN.

Les obligations des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables correspondent au montant du rachat, qui se rapproche de la juste valeur. Tous les autres actifs et passifs financiers sont évalués au coût amorti, qui se rapproche de la juste valeur. Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisé s'il y a lieu, selon le taux d'intérêt effectif.

Les actifs financiers et passifs financiers sont compensés et les soldes nets sont présentés dans les états de la situation financière si, et seulement si, les Fonds ont un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et s'ils ont l'intention soit de régler les montants nets, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les Fonds concluent, dans le cadre normal de leurs activités, diverses conventions-cadres de compensation ou autres accords similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans les états de la situation financière, mais qui permettent néanmoins d'opérer compensation des montants dans certaines circonstances, comme la faillite ou la résiliation des contrats.

b. Juste valeur des instruments financiers

À la clôture, les titres cotés sont évalués au dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des conditions actuelles du marché. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. Les bons de souscription non cotés, le cas échéant, sont évalués en fonction d'un modèle de tarification prenant en compte des facteurs comme la valeur de marché du titre sous-jacent, le prix d'exercice et les modalités du bon de souscription. Les titres à revenu fixe, les débentures et les autres instruments de créance, y compris les placements à court terme, sont évalués au cours fourni par des courtiers en valeurs mobilières reconnus. Les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable selon la valeur liquidative présentée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

La juste valeur des titres pour lesquels il n'existe aucun prix sur le marché est établie à l'aide de modèles d'évaluation fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire afin de garantir qu'elles sont raisonnables. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres pour lesquels il n'existe aucun prix sur le marché.

c. Trésorerie

La trésorerie comprend les dépôts en espèces et le découvert bancaire.

d. Coût des placements

Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est déterminé selon le coût moyen, commissions et coûts de transaction non compris. Le coût moyen n'inclut pas l'amortissement des primes ou des escomptes sur les titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro.

e. Opérations de placement et comptabilisation des revenus

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération, c'est-à-dire à la date où un fonds s'engage à acheter ou à vendre le placement. Les intérêts aux fins des distributions présentés dans les états du résultat global correspondent à l'intérêt nominal reçu par les Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire. Les intérêts gagnés en espèces sont inclus dans les états du résultat global sous « Intérêts aux fins des distributions ».

Les dividendes et les distributions tirés des placements sont comptabilisés à la date ex-dividende/ex-distribution.

Les distributions des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents sont traitées à titre de revenu, gains en capital ou remboursement de capital, selon les meilleurs renseignements dont dispose le gestionnaire. En raison de la nature de ces placements, la répartition effectuée au cours de l'exercice considéré pourrait être différente de cette information. Les distributions de fiducies de revenu et de fonds sous-jacents qui sont traitées comme un remboursement de capital aux fins de l'impôt sur le revenu réduisent le coût moyen des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents.

f. Conversion de devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds. Pour les Fonds qui offrent des parts des séries AH, FH, IH, PH, YH, WH et de séries couvertes en \$ US, toutes les données sont en dollars canadiens, sauf la valeur liquidative par part des séries libellées en dollars américains, qui est en dollars américains.

Les montants en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle comme suit : les placements, les contrats de change à terme et les autres actifs et passifs à la juste valeur, au cours du change de clôture chaque jour ouvrable; les revenus et les charges, les achats, les ventes et les règlements de placements, au cours du change en vigueur à la date des opérations en cause. Les profits et pertes de change sur la trésorerie sont présentés à titre de « Profit (perte) de change sur la trésorerie » et les profits et pertes de change se rapportant à d'autres actifs et passifs financiers sont présentés sous les postes « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés » et « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global.

g. Évaluation des parts

Séries de fonds communs de placement

La valeur liquidative par part des séries A, F, I, P et W est établie en dollars canadiens et la valeur liquidative par part des séries AH, FH, IH, PH, YH et WH est établie en dollars américains.

Séries de FNB

La valeur liquidative par part des parts de série FNB en \$ CA est établie en dollars canadiens et la valeur liquidative par part de série FNB couverte en \$ US est établie en dollars américains.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

La valeur liquidative par part de chaque série est calculée à la fin de chaque jour ouvrable complet du bureau du gestionnaire en divisant la valeur liquidative totale de chaque série d'un fonds par le nombre de parts en circulation de cette série.

La valeur liquidative de chaque série est basée sur le calcul de la quote-part des actifs du Fonds revenant à cette série, moins la quote-part du passif collectif du Fonds revenant à cette série et le passif attribuable à cette série. Les charges attribuables directement à une série sont imputées à cette série. Les autres revenus et charges ainsi que les profits et les pertes sont imputés proportionnellement à chaque série en fonction de la valeur liquidative relative de chaque série. La valeur liquidative par part de chacune des séries couvertes tient compte de l'utilisation d'instruments dérivés, comme des contrats de change à terme, le cas échéant, et les coûts et gains ou pertes liés aux opérations de couverture effectuées par une série couverte sont affectés à la série couverte en question.

Au 30 juin 2023, au 31 décembre 2022 et au 30 juin 2022, le cas échéant, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables utilisé aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

h. Classement des parts

Les parts du Fonds sont classées comme passifs financiers conformément à la norme IAS 32, *Instruments financiers : Présentation* (IAS 32), car elles ne répondent pas à la définition des instruments remboursables au gré du porteur devant être classés en capitaux propres conformément à l'IAS 32 aux fins de la présentation de l'information financière.

i. Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille

Les coûts de transaction, notamment les commissions de courtage, engagés lors de l'achat et de la vente de titres, sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille ».

j. Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

« L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part » dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque série de Fonds par le nombre moyen pondéré de parts de cette série en circulation au cours de la période.

k. Contrats de change à terme

Les Fonds sont autorisés à conclure des contrats de change à terme de temps à autre. Les contrats de change à terme sont évalués chaque jour d'évaluation selon la différence entre le taux prévu aux termes du contrat et le taux à terme en vigueur à la date d'évaluation, appliquée au montant notionnel du contrat et ajustée en fonction du risque de contrepartie. Tout profit (perte) latent découlant des contrats de change à terme est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

l. Contrats à terme standardisés

Les contrats à terme standardisés sont évalués à chaque date d'évaluation en utilisant le cours de clôture affiché à la Bourse pertinente. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont détenus à titre de marge sur les contrats à terme standardisés qui sont présentés dans les états de la situation financière sous « Marge de variation quotidienne sur les dérivés ». Tout profit (perte) latent découlant des contrats à terme

standardisés est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

m. Contrats d'options

Les options négociées hors cote sont évaluées en se servant du modèle Black-Scholes, alors que les options négociées en Bourse sont évaluées au dernier cours de la Bourse. Les contrats d'options sont évalués chaque jour selon le profit ou la perte qui seraient réalisés si les contrats étaient liquidés. Tout profit (perte) latent découlant des contrats d'option est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». Toutes les primes liées aux options arrivées à échéance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ».

n. Swaps sur défaillance

Les swaps sur défaillance sont des ententes qui aident à atténuer l'exposition au risque de crédit à l'égard d'une entité émettrice (l'« entité de référence ») ou à augmenter l'exposition au risque de crédit de l'entité de référence en créant une position de placement théorique pour le Fonds. Lorsqu'une position de placement théorique est créée, le risque de crédit auquel est exposé le Fonds est comparable au risque qui aurait découlé d'un placement direct du Fonds dans l'entité de référence. En vertu des swaps sur défaillance, l'acheteur de protection, dont l'intention est de réduire son exposition au risque de crédit à l'égard de l'entité de référence, verse une prime au vendeur de protection qui assume le risque de crédit en cas de défaillance. Cette prime est payée à intervalles réguliers sur la durée du swap. En échange de la prime versée, l'acheteur de protection a le droit de recevoir du vendeur de protection le remboursement complet d'une perte attribuable à un cas de défaillance de l'entité de référence. Un cas de défaillance peut être déclenché par une faillite, un défaut de paiement ou une restructuration de l'entité de référence. En cas de défaillance, le swap peut être réglé par la livraison physique de l'obligation pour un produit correspondant à la valeur nominale ou par le versement d'un paiement comptant correspondant au montant de la perte. Les swaps sur défaillance sont évalués en fonction des évaluations fournies par les courtiers.

Les variations dans la valeur des swaps sur défaillance sont inscrites au poste « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés », dans les états du résultat global. Les primes versées ou reçues au titre des swaps sur défaillance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ». Si un swap sur défaillance vient à échéance ou est résilié, les profits ou les pertes sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

o. Titres adossés à des créances hypothécaires et à des crédits mobiliers

Certains Fonds investissent dans des titres adossés à des créances hypothécaires et des titres adossés à des crédits mobiliers. Ces titres peuvent comprendre : des titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques, des titres adossés à des actifs avec flux groupés, des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales, des titres adossés à des crédits mobiliers, des titres garantis par des créances et autres titres qui représentent directement ou indirectement une participation dans un prêt hypothécaire sur biens immobiliers ou sont garantis par un tel prêt ou payable à partir d'un tel prêt. Les titres de créance et de capitaux propres émis par ces titres peuvent inclure des tranches avec différents niveaux de subordination. Ces titres peuvent fournir un paiement mensuel composé de paiements d'intérêts et de capital.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les titres liés aux créances hypothécaires sont créés à partir de portefeuilles de prêts hypothécaires résidentiels ou commerciaux, notamment des prêts hypothécaires consentis par des institutions d'épargne et de crédit, des banquiers hypothécaires, des banques commerciales et autres. Les titres adossés à des crédits mobiliers sont créés à partir de plusieurs types d'actifs, notamment des prêts automobiles, des créances sur cartes de crédit, des prêts sur valeur domiciliaire et des prêts étudiants.

Les titres liés aux créances hypothécaires et adossés à des crédits mobiliers sont émis par tranches distinctes, ou par catégories de titres pour chaque opération. Les titres sont également évalués de manière générale par un service d'évaluation des cours qui utilise les cotes des sociétés de courtage ou les estimations de leurs modèles internes d'évaluation. Les modèles d'évaluation pour ces titres considèrent généralement les caractéristiques au niveau des tranches, les données actuelles du marché, les flux de trésorerie estimés et les taux de rendement fondés sur le marché pour chaque tranche, et intègrent l'exécution de la garantie, le cas échéant. Les valeurs comptables des titres liés à des créances hypothécaires et adossés à des crédits mobiliers sont incluses au poste « Placements » dans les états de la situation financière. La variation de la juste valeur des titres liés à des créances hypothécaires et adossés à des crédits mobiliers est comprise au poste « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » des états du résultat global.

p. Vente à découvert

Lorsqu'un Fonds vend un titre à découvert, il emprunte ce titre d'un courtier afin de conclure la vente. Puisque le Fonds emprunte un titre du courtier, il doit avoir un compte sur marge auprès de ce dernier contenant des liquidités ou des titres liquides. Les liquidités détenues dans le compte sur marge pour les ventes à découvert sont incluses dans les états de la situation financière au poste « Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert ». La perte maximale sur les titres vendus à découvert peut être illimitée. Le résultat d'une vente à découvert pour un Fonds est une perte si le prix du titre emprunté augmente entre la date de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds dénoue sa position vendeur en achetant ce titre. Le Fonds réalise un profit si le prix du titre baisse entre ces dates. Le profit ou la perte qui seraient réalisés si la position était fermée à la date d'évaluation sont indiqués dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés ». Lorsque la position vendeur est liquidée, les profits et les pertes sont réalisés et inclus au poste « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés », dans les états du résultat global. Les frais versés à un courtier pour l'emprunt de titres sont inclus dans les états du résultat global au poste « Frais d'emprunt de titres ».

q. Compensation des instruments financiers

Les informations présentées dans les tableaux « Compensation des instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant, comprennent les actifs et passifs des contrats de change à terme qui sont assujettis à un accord de compensation exécutoire. Les transactions avec des contreparties individuelles sont régies par des accords de compensation distincts. Chaque accord prévoit un règlement net de certains contrats ouverts pour lesquels les Fonds et la contrepartie concernée choisissent de régler leurs contrats sur une base nette. En l'absence d'un tel choix, les contrats seront réglés sur une base brute. Cependant, chaque partie à l'accord de compensation aura la possibilité de régler tous les contrats ouverts sur une base nette en cas de défaillance de l'autre partie.

Les accords de compensation de l'International Swaps and Derivatives Association Inc. (« accord de compensation ISDA ») régissent les opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré conclus par les Fonds et des contreparties choisies. Les accords de compensation ISDA prévoient des dispositions pour les obligations générales, les représentations, les accords, les garanties et les cas de défaillance ou de résiliation. Les clauses de résiliation comprennent des dispositions qui peuvent permettre aux contreparties de choisir une résiliation anticipée et de provoquer un règlement de toutes les opérations

en cours en vertu de l'accord de compensation ISDA applicable. Tout choix de résiliation anticipée pourrait avoir une incidence importante sur les états financiers. La juste valeur des opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré, nette de la garantie reçue ou des biens donnés en garantie par la contrepartie est décrite dans les notes annexes propres au Fonds.

Les Fonds peuvent être assujettis à plusieurs accords-cadres ou accords de compensation, avec certaines contreparties. Ces accords-cadres réduisent le risque de contrepartie lié aux opérations pertinentes en spécifiant les mécanismes de protection de crédit et en fournissant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Puisque les opérations ont des mécanismes différents et sont parfois négociées par différentes entités juridiques d'une contrepartie, chaque type d'opération peut être couvert par un accord-cadre différent, d'où la nécessité d'avoir plusieurs accords avec une seule contrepartie. Comme les accords-cadres sont propres aux opérations uniques visant différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de dénouer et de régler leur exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance à l'égard des opérations régies par un accord unique avec une contrepartie.

r. Placements dans des entreprises associées, des coentreprises, des filiales et des entités structurées non consolidées

Les filiales sont des entités, y compris les investissements dans d'autres entités d'investissement, sur lesquelles un Fonds exerce un contrôle. Un Fonds contrôle une entité lorsqu'il est exposé ou qu'il a droit à des rendements variables en raison de ses liens avec l'entité, et qu'il a la capacité d'influer sur ces rendements du fait du pouvoir qu'il détient sur celle-ci. Les entreprises associées et les coentreprises sont des participations dans des entités sur lesquelles un Fonds exerce une influence notable ou un contrôle conjoint. Une entité structurée est une entité qui a été conçue de telle sorte que les droits de vote ou droits similaires ne sont pas les facteurs dominants pour déterminer qui contrôle l'entité, ou de telle sorte que les droits de vote sont uniquement liés à des tâches administratives et que les activités pertinentes sont régies par des dispositions contractuelles.

Le gestionnaire a déterminé que le ou les fonds sous-jacents ou le ou les fonds négociés en Bourse (« FNB ») détenus par les Fonds répondent généralement à la définition d'une entité structurée non consolidée. Les titres adossés à des créances hypothécaires et les titres adossés à des crédits mobiliers sont également considérés comme des entités structurées non consolidées. Les Fonds comptabilisent leurs placements dans des entités structurées non consolidées à la JVRN.

Les Fonds qui investissent dans un ou des fonds sous-jacents sont assujettis aux modalités des documents de placement du ou des fonds sous-jacents concernés et sont sensibles au risque de prix du marché découlant des incertitudes entourant les valeurs futures du ou des fonds sous-jacents en question. Le ou les fonds sous-jacents du portefeuille de placements sont gérés par des gestionnaires de portefeuille qui sont rémunérés pour leurs services par le fonds sous-jacent concerné. Cette rémunération est généralement constituée de frais calculés en fonction de l'actif et est reflétée dans l'évaluation du ou des fonds sous-jacents, sauf lorsque les Fonds investissent dans certaines catégories/séries du ou des fonds sous-jacents pour lesquelles la rémunération des gestionnaires de portefeuille est négociée et payée à l'extérieur du fonds sous-jacent concerné. Le ou les fonds sous-jacents financent leurs activités en émettant des parts rachetables qui donnent droit aux porteurs à une participation égale du fonds sous-jacent concerné. Les Fonds peuvent demander le rachat de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents sur une base quotidienne.

Les placements des Fonds dans le ou les fonds sous-jacents ou le ou les FNB sont comptabilisés à la JVRN et inclus au poste « Placements » dans les états de la situation financière. Tout profit (perte) latent découlant de ces placements est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global, jusqu'au moment où ces placements sont vendus. À ce

Notes des états financiers (non audité) (suite)

moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les FNB, le ou les fonds sous-jacents et les titres adossés à des créances hypothécaires ou à des actifs est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans ces entités structurées non consolidées.

Des renseignements supplémentaires se rapportant à la participation de chaque Fonds dans des entités structurées non consolidées figurent dans les notes annexes propres au Fonds, le cas échéant.

s. Retenues d'impôts

Un Fonds peut, de temps à autre, être assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées séparément dans les états du résultat global.

t. Taxe de vente harmonisée

Certaines provinces, y compris l'Ontario, l'Île-du-Prince-Édouard, la Nouvelle-Écosse, le Nouveau-Brunswick et Terre-Neuve-et-Labrador (chacune, une juridiction fiscale participante), ont harmonisé leur taxe de vente provinciale (« TVP ») avec la taxe fédérale sur les produits et services (« TPS »). La taxe de vente harmonisée (« TVH ») correspond au taux de 5 % de la TPS fédérale combiné à celui de la TVP des provinces concernées. La province de Québec perçoit également la taxe de vente du Québec (« TVQ »). La TVH à verser ou à recevoir est calculée selon le lieu de résidence des porteurs de parts et la valeur de leur participation dans le Fonds à une date donnée, et non en fonction du territoire dont relève le Fonds. Le taux effectif des taxes de vente applicable à chaque série du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts entre les provinces. Il est calculé selon le taux de TVH ou, si la province concernée n'applique pas la TVH, selon le taux de TPS ou de la TVQ. Tous les montants à ce titre sont inscrits au poste « Taxe de vente harmonisée » des états du résultat global.

u. Opérations autres qu'en espèces

Le « produit de l'émission de parts rachetables » et les « montants versés lors du rachat de parts rachetables » dans les états des flux de trésorerie excluent les transactions hors trésorerie.

3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

La préparation d'états financiers conformes aux IFRS exige que la direction émette des jugements, fasse des estimations et pose des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables ainsi que sur les montants présentés au titre de l'actif et du passif à la date de clôture et sur les montants présentés des revenus et des dépenses pour la période. Le paragraphe suivant présente une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation de leurs états financiers :

Évaluation à la juste valeur des investissements et des dérivés non cotés sur un marché actif

De temps à autre, les Fonds peuvent détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, notamment des titres non cotés, des titres privés ou des dérivés. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. La juste valeur des titres privés est établie à l'aide de modèles d'évaluation fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles.

Ces valeurs ont été examinées de façon indépendante par le gestionnaire selon les hypothèses et les estimations disponibles à la date de l'état de la situation financière. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres privés.

Dans la mesure du possible, les modèles d'évaluation font appel à des données observables. Toutefois, le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre à l'entité que le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités, les corrélations et les hypothèses clés au sujet d'événements futurs. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers.

Les Fonds considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question.

La juste valeur des placements dans un ou des fonds sous-jacents qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs est évaluée principalement selon la dernière valeur liquidative de chaque part disponible pour chaque fonds sous-jacent, telle qu'elle est déterminée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

IFRS 10, États financiers consolidés (IFRS 10)

Conformément à l'IFRS 10, le gestionnaire a déterminé que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement, à savoir une entité qui obtient des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion de placements, qui déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital ou de revenus de placement ou les deux, et qui évalue et mesure la performance de ses placements sur la base de la juste valeur. Par conséquent, les Fonds ne consolident pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent plutôt à la JVRN, comme l'exige la norme comptable.

4. PARTS RACHETABLES

Les parts rachetables émises et en circulation représentent le capital de chaque Fonds.

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts rachetables et cessibles de chaque série. En général, il n'existe aucune restriction ni exigence de capital particulière pour les Fonds, sauf en ce qui a trait au montant minimal des souscriptions/rachats. Les variations pertinentes relatives aux souscriptions et aux rachats de parts de chaque Fonds sont présentées dans les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Conformément aux politiques et aux objectifs de gestion des risques décrits aux notes 1 et 10, les Fonds s'efforcent d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant une liquidité suffisante pour régler les rachats en utilisant une facilité d'emprunt à court terme ou en cédant des placements au besoin.

L'information se rapportant aux transactions sur parts rachetables figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

Afin d'établir chacune des séries, le gestionnaire a effectué des placements initiaux dans certains Fonds.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Au 30 juin, le gestionnaire détenait des placements dans les fonds suivants :

Fonds	2023 (en \$)	2022 (en \$)
Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI	70 652	65 422
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	68 975	64 555
Fonds alternatif multistratégie CI	195 712	-
Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI	78 373	56 477
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (auparavant FNB de produits de base généraux CI Auspice)	154 718	-
Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret	54 666	51 809
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret	74 100	69 135
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	64 999	57 259

5. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

Frais de gestion

The Manager of each Fund, in consideration of management fees, provides management services required. Le gestionnaire de chaque Fonds, en contrepartie des frais de gestion qu'il reçoit, fournit les services de gestion requis pour les activités quotidiennes des Fonds, y compris la gestion du portefeuille de placements des Fonds et le détachement de personnel de direction clé.

Les frais de gestion sont calculés selon un pourcentage de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds (autre que les séries I, IH, P, PH, W et WH) (les parts des séries W et WH sont offertes aux investisseurs uniquement dans le cadre du programme Portefeuilles gérés de clientèle privée) à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes applicables, comme la TVH, la TPS et la TVQ.

Des frais de gestion négociés entre l'investisseur et le gestionnaire sont imputés directement aux investisseurs dans les parts des séries I, IH, P, PH, W et WH.

Frais d'administration

Le gestionnaire absorbe tous les frais d'exploitation des Fonds (à part certaines taxes, certains coûts d'emprunt et certains nouveaux droits gouvernementaux) en échange de frais d'administration annuels. Les frais d'administration sont calculés selon un pourcentage annuel de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds (autre que la série I et la série IH) à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes applicables, comme la TVH, la TPS et la TVQ.

Des frais d'administration négociés entre l'investisseur et le gestionnaire sont imputés directement aux investisseurs dans les parts des séries I et IH.

Absorption

La décision de renoncer et/ou d'absorber les frais de gestion est à la discrétion du gestionnaire. La pratique de renonciation et/ou d'absorption des frais de gestion peut se poursuivre indéfiniment ou peut être résiliée à tout moment sans préavis aux porteurs de parts. Les frais de gestion auxquels le gestionnaire renonce sont présentés dans les états du résultat global.

Rabais sur frais

Le gestionnaire peut réduire les frais de gestion et/ou d'administration en fonction de la taille d'un investissement des porteurs de parts ou de la participation à un programme offert par le gestionnaire pour les comptes plus importants. Le gestionnaire peut également réduire les frais de gestion si une commission

de suivi réduite a été négociée entre un porteur de parts et le représentant du porteur de parts sur la base des documents pertinents fournis au gestionnaire. À la fin de chaque trimestre, le montant de toute réduction des frais de gestion ou d'administration est distribué aux porteurs de parts admissibles par le Fonds sous forme de réinvestissement dans des parts supplémentaires de la série respective du Fonds. Les rabais sur les frais de gestion ou d'administration, le cas échéant, sont inclus dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, le cas échéant, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ».

Placements dans le ou les fonds sous-jacent(s)

Un fonds qui investit dans des parts de fonds sous-jacent(s) ne paiera pas de frais de gestion et d'administration en double sur la partie des actifs qui sont investis dans des parts de fonds sous-jacent(s). Au cours de la période, un Fonds peut avoir reçu une remise sur les frais de gestion ou d'administration du gestionnaire du ou des fonds sous-jacents relativement à son investissement dans un fonds sous-jacent. Les rabais sur les frais de gestion ou d'administration, le cas échéant, sont inclus dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, le cas échéant, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ».

Voir le tableau des frais de gestion et d'administration dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir les ratios des frais de gestion/d'administration de chaque série de chaque Fonds.

Primes de rendement

Le gestionnaire reçoit des primes de rendement relativement à chacune des séries de parts du Fonds alternatif multistratégie CI et Fonds de produits de base généraux CI Auspice. Chacune des séries de titres d'un fonds versera au gestionnaire des primes de rendement à la fin de chaque année civile correspondant à : i) 10 % (dans le cas du Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI, du Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret et du Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret) ou 15 % (dans le cas du Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI, du Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI et du Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro) de l'excédent de la valeur liquidative par part à la fin de l'année civile en question (avant toute distribution effectuée par le fonds depuis que le point culminant [défini ci-dessous]) a été établi et rajusté afin d'exclure le cumul des primes de rendement durant l'année civile) sur le point culminant multiplié par un plus le taux critique (défini ci-dessous); multiplié par le nombre de titres en circulation de cette série à la fin de l'année civile en question. Pour chacune des séries d'un Fonds, le « point culminant » signifie : i) la valeur liquidative par part initiale, ou ii) la valeur liquidative à la fin de la plus récente année civile pour laquelle des primes de rendement ont été versées après toute distribution effectuée au cours de cette année civile et tout paiement de primes de rendement versées en lien avec ceux-ci, ou iii) en date du 1^{er} janvier 2021, la valeur liquidative la plus élevée calculée à la fin d'une précédente période de calcul des primes de rendement, compte tenu de toutes les distributions de cette période, qui étaient supérieurs à un point culminant précédemment fixé, mais inférieur à leur taux critique au moment du calcul. Le seuil de performance sera réduit du montant de toute distribution versée relativement aux parts d'un Fonds qui représente un remboursement de capital.

Le taux critique de chaque Fonds est calculé comme suit :

Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI : le rendement des obligations du gouvernement du Canada sur 10 ans plus 2,00 %.

Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI : le rendement de l'indice des obligations de toutes les sociétés FTSE Canada calculé à la dernière des dates suivantes à se produire : a) le dernier jour ouvrable de la dernière année où des primes de rendement ont été versées (sauf lorsque le taux critique est négatif, comme il est décrit dans le paragraphe ci-après), ou b) le jour où le point culminant a été rajusté comme il est décrit au point iii) de la définition de point culminant.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI a changé pour correspondre au plus élevé des six montants suivants : le rendement obligataire du gouvernement du Canada de 6 % ou 10 ans plus 3,50 %.

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret : le taux de rendement de l'obligation du gouvernement du Canada à 10 ans plus 1,00 %.

Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret : le taux de rendement de l'indice des obligations gouvernementales à court terme FTSE Canada plus 1,00 %.

Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro le plus élevé des six montants suivants : le rendement obligataire du gouvernement du Canada de 6 % ou 10 ans plus 3,50 %

Si le taux critique d'un Fonds établi conformément aux dispositions ci-dessus est négatif, le taux critique sera considéré comme étant nul aux fins du calcul de la prime de rendement. Si le taux critique du Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI est négatif, le taux critique de l'année suivante sera calculé selon le rendement de l'indice des obligations de toutes les sociétés FTSE Canada à partir du dernier jour ouvrable de l'année civile où le taux critique était positif et que des primes de rendement ont été versées. Si des titres d'un Fonds sont rachetés avant la fin d'une année civile, une prime de rendement sera payable à la date de rachat relativement à chacun des titres, comme si la date de rachat était la fin de l'année civile, comme décrit ci-dessus.

Plus précisément, le taux critique du Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret, du Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret et du Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro fera l'objet d'une répartition proportionnelle dans le cadre du calcul des primes de rendement en lien avec un titre racheté au cours de l'année civile. Les primes de rendement seront calculées et comptabilisées pour chaque série quotidiennement durant chaque année civile. Les primes de rendement sont assujetties aux taxes applicables, dont la TPS, la TVH et toute taxe de vente provinciale applicable. Le gestionnaire se réserve le droit, à sa discrétion, d'annuler ou de réduire la prime de rendement payable à l'égard d'un Fonds à tout moment, ou de renoncer à celle-ci.

6. PRÊT DE TITRES

Certains Fonds ont conclu un programme de prêt de titres avec la Bank of New York Mellon, qui agit comme agent de prêt de titres. La valeur de marché totale de tous les titres prêtés par un Fonds ne pourra pas dépasser 50 % de ses actifs. Un Fonds recevra une garantie correspondant à au moins 102 % de la valeur des titres prêtés. La garantie se composera généralement de liquidités et d'obligations émises ou garanties par le gouvernement du Canada ou une province, par le gouvernement des États-Unis ou une de ses agences officielles, mais peut aussi comprendre des obligations d'autres gouvernements bénéficiant d'une cote de crédit convenable. La valeur des titres prêtés et des garanties reçues de même qu'un rapprochement entre le revenu brut tiré des prêts de titres et le revenu tiré des prêts de titres figurent dans les notes annexes propres au Fonds. Les revenus tirés des prêts de titres figurent au poste « Revenu tiré des prêts de titres » des états du résultat global.

7. IMPOSITION

Les Fonds, à l'exception du Fonds alternatif multistratégie CI, sont considérés comme un fonds commun de placement en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du résultat net des Fonds aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours de tout exercice doivent être distribués aux porteurs de parts de manière à ce que chaque Fonds n'ait aucun impôt à payer. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. L'impôt sur le montant net des gains en capital réalisés qui ne sont ni payés ni payables

peut, en général, être recouvré en vertu des dispositions de remboursement contenues dans la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et dans les lois provinciales de l'impôt sur le revenu, lorsque des rachats sont effectués. À l'occasion, un Fonds pourra verser des distributions supérieures à ses revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

Le Fonds alternatif multistratégie CI est considéré comme un fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et n'est pas soumis à l'impôt sur son revenu net, y compris les gains en capital nets réalisés pour l'année d'imposition, qui est payé ou payable à ses détenteurs de parts à la fin de l'année d'imposition. Toutefois, toute partie du revenu imposable du Fonds et du montant net des gains en capital réalisés qui n'est pas ainsi versée ou payable sera imposable pour ce Fonds. Le Fonds a l'intention de verser la totalité du revenu net imposable et une partie suffisante du montant net des gains en capital réalisés de manière à ne pas devoir payer l'impôt sur le revenu. Le Fonds ne comptabilise donc pas d'impôts sur le revenu. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. À l'occasion, le Fonds pourra verser des distributions supérieures à ses revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

8. RÉINVESTISSEMENT DES DISTRIBUTIONS

Lorsqu'une distribution est versée au porteur de parts, elle l'est dans la même monnaie que les parts. Les distributions sont réinvesties automatiquement sans frais dans le même Fonds ou versées en trésorerie aux porteurs de parts. Le gestionnaire peut modifier la politique de distributions à son gré.

9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp. ou ses filiales ou dans d'autres fonds de placement gérés par le gestionnaire indiqués dans l'inventaire du portefeuille et les notes annexes propres au Fonds, le cas échéant.

Le gestionnaire des Fonds peut, à l'occasion, effectuer des placements initiaux dans certaines séries de certains Fonds pour favoriser l'établissement d'une série ou d'un Fonds. Les détails des placements effectués par le gestionnaire sont présentés à la note 4.

Opérations entre fonds

Ces opérations entre fonds surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète un titre d'un émetteur auprès d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le Comité d'examen indépendant (CEI) passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours des périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, certains Fonds ont effectué des opérations entre fonds.

10. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Conflit entre l'Ukraine et la Russie

Le conflit entre l'Ukraine et la Russie a entraîné une volatilité et une incertitude importantes sur les marchés des capitaux. Les pays membres de l'OTAN, de l'UE et du G7, y compris le Canada, ont imposé des sanctions sévères et coordonnées contre la Russie. Des mesures restrictives ont également été imposées par la Russie et certains titres ont subi une baisse importante de leur valeur ou pourraient ne plus être négociables. Ces actions ont entraîné des perturbations importantes des activités d'investissement et des entreprises ayant des activités en Russie. L'impact à plus long terme sur les normes géopolitiques, les chaînes d'approvisionnement et les évaluations des investissements est incertain.

À mesure que la situation évolue, le gestionnaire continue de surveiller les événements en cours et leur incidence sur les stratégies de placement.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Transition du taux interbancaire offert

À compter du 31 décembre 2021, la publication du taux interbancaire offert à Londres (LIBOR) en livre sterling, en yen japonais, en franc suisse et en euro a cessé pour toutes les échéances, ainsi que pour les échéances des titres à 1 semaine et à 2 mois. En outre, le taux LIBOR en dollar américain pour les titres à un mois, à trois mois, à six mois et à douze mois ne sera plus publié après le 30 juin 2023.

Le 16 mai 2022, Refinitiv Benchmark Services (UK) Limited, l'administrateur du taux offert en dollars canadiens (CDOR), a annoncé que le CDOR pour toutes les échéances cessera d'être calculé après sa publication finale le 28 juin 2024.

La réforme des taux de référence à l'échelle mondiale visant à passer du LIBOR ou CDOR à des taux de référence alternatifs peut avoir une incidence sur un Fonds qui détient des placements indexés au LIBOR ou au CDOR. Les risques de marché découlent du fait que les nouveaux taux de référence sont susceptibles de différer du taux LIBOR en dollar américain ou du CDOR, ce qui peut se répercuter sur la volatilité ou la liquidité des marchés pour les instruments actuellement indexés sur le LIBOR en dollar américain ou le CDOR. Afin de gérer ces risques, le gestionnaire continue de suivre de près l'évolution du secteur et prend toutes les mesures nécessaires pour identifier, mesurer et gérer les risques liés à l'exposition des Fonds au LIBOR en dollar américain ou au CDOR découlant des titres en portefeuille.

Gestion des risques

Les Fonds sont exposés à divers risques associés aux instruments financiers, à savoir le risque lié à l'effet de levier et à la vente à découvert, le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque de marché (y compris l'autre risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt). Le niveau de risque auquel chaque Fonds est exposé est fonction de l'objectif de placement et du type de placements que détient le Fonds. La valeur des placements dans un portefeuille peut changer de jour en jour en raison des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur, des conditions du marché, de la conjoncture économique et des nouvelles propres aux sociétés dans lesquelles le Fonds a investi. Le gestionnaire des Fonds peut atténuer les effets négatifs de ces risques sur la performance des Fonds à l'aide des mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions des Fonds et des événements du marché; la diversification du portefeuille de placements par catégorie d'actifs, pays, secteur et durée jusqu'à l'échéance, tout en respectant les objectifs établis; et par l'entremise des dérivés à titre de couverture de certains risques.

Risque lié à l'effet de levier et à la vente à découvert

Lorsqu'un Fonds investit dans des produits dérivés, emprunte des espèces à des fins de placement ou a recours à la vente à découvert physique d'actions ou d'autres actifs du portefeuille, un effet de levier peut survenir dans le Fonds. Un effet de levier survient lorsque l'exposition théorique du Fonds aux actifs sous-jacents est supérieure au montant investi. Il s'agit d'une technique de placement qui amplifie les profits et les pertes. Par conséquent, toute détérioration de la valeur ou du niveau de l'actif sous-jacent, du taux ou de l'indice peut amplifier les pertes comparativement à celles qui auraient été subies si l'actif sous-jacent avait été détenu directement par le Fonds et cela peut entraîner des pertes supérieures au montant investi dans l'instrument dérivé lui-même. L'effet de levier peut accroître la volatilité, nuire à la liquidité du fonds et contraindre celui-ci à liquider des positions à des moments défavorables.

Le Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI, le Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI, Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI, le Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret, le Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret et le Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro exercent un effet de levier en effectuant des opérations à découvert, lesquelles exposent les fonds au risque lié à la vente à découvert.

Le risque lié à la vente à découvert représente le risque de perte lié à la vente à découvert. Rien ne garantit que la valeur des titres baissera durant la période de la vente à découvert pour que les Fonds réalisent un profit, et la valeur des titres vendus à découvert pourrait même s'apprécier, générant une perte pour les Fonds. Les Fonds pourraient avoir des difficultés à racheter et à rendre les titres empruntés s'il n'existe pas de marché liquide pour ceux-ci. Le prêteur peut également rappeler les titres empruntés en tout temps. Le prêteur peut faire faillite, et les Fonds pourraient perdre les biens en garantie déposés auprès du prêteur. Les Fonds atténuent ce risque en déposant les biens en garantie seulement auprès d'institutions financières réglementées ou de courtiers réglementés.

L'effet de levier cumulé de chaque Fonds ne peut dépasser trois fois la valeur liquidative du Fonds.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI a été de 35,7 millions \$ (5,0 % de la valeur liquidative) (16,7 millions \$ au 31 décembre 2022, 3,8 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier exercé au cours des périodes a été de 53,8 millions \$ (6,3 % de la valeur liquidative) (33,3 millions \$ au 31 décembre 2022, 4,9 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif d'occasions diversifiées CI avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant à 249 324 323 millions \$ (102 376 150 au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI a été de 527,9 millions \$ (122,2 % de la valeur liquidative) (479,5 millions \$ au 31 décembre 2022, 104,1 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier utilisé au cours des périodes a été de 732,5 millions \$ (123,8 % de la valeur liquidative) (735,6 millions \$ au 31 décembre 2022, 182,6 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant à 1 343 082 millions \$ (5 321 536 \$ au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret a été de 26,0 millions \$ (5,2 % de la valeur liquidative) (11,6 millions \$ au 31 décembre 2022, 1,4 % de la valeur liquidative) et la valeur la valeur totale maximale de l'effet de levier exercé au cours des périodes a été de 32,5 millions \$ (6,3 % de la valeur liquidative) (50,0 millions \$ au 31 décembre 2022, 6,9 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant à 186 755 630 \$ (151 826 396 \$ au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret a été de 1,41 millions \$ (2,2 % de la valeur liquidative) (2,32 millions \$ au 31 décembre 2022, 2,4 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier exercé au cours des périodes a été de 2,4 millions \$ (2,9 % de la valeur liquidative) (7,1 millions \$ au 31 décembre 2022, 4,5 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant à 13 931 833 \$ (1 114 410 \$ au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro a été de 74,0 millions \$ (4,9 % de la valeur liquidative) (16,8 millions \$ au 31 décembre 2022, 0,7 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier utilisé au cours des périodes a été de 147,2 millions \$ (9,8 % de la valeur liquidative) (232,2 millions \$ au 31 décembre 2022, 13,1 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant à néant (néant au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Au 30 juin 2023, le Fonds alternatif d'occasions nord-américaines CI avait donné en garantie des titres auprès du courtier principal correspondant de 2 328 259 \$ (néant au 31 décembre 2022) relativement aux ventes à découvert.

Risque de concentration

Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie, que ce soit un emplacement géographique, un type d'actif, un secteur d'activité ou un type de contrepartie.

Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque que l'émetteur du titre ou la contrepartie à un instrument financier ne puisse pas respecter ses obligations financières. La juste valeur d'un titre de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur. La valeur comptable des titres de créance telle que présentée dans l'inventaire du portefeuille représente l'exposition au risque de crédit de chaque Fonds. L'exposition au risque de crédit pour les dérivés se fonde sur le profit latent de chaque Fonds sur les obligations contractuelles envers la contrepartie à la date de clôture. La note de crédit d'une contrepartie à un dérivé est indiquée dans l'inventaire du portefeuille ou dans les notes annexes propres au Fonds des états financiers de chaque Fonds, le cas échéant. L'exposition au risque de crédit des autres actifs du Fonds correspond à leur valeur comptable présentée dans les états de la situation financière.

Les notes de crédit des titres de créance, des titres privilégiés et des dérivés proviennent de S&P Global Ratings, le cas échéant, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement. Les notes de crédit peuvent être à long terme ou à court terme. Les notes de crédit à court terme sont généralement attribuées aux obligations et instruments dérivés à court terme.

Le tableau ci-dessous permet de comparer les cotes de crédit à long terme présentées dans le tableau des cotes de crédit et les cotes de crédit à court terme présentées à l'annexe des dérivés de l'inventaire du portefeuille de placement.

Notes de crédit selon le tableau des risques de crédit	Notes de crédit selon les tableaux des dérivés
AAA/Aaa/A++	A-1+
AA/Aa/A+	A-1, A-2, A-3
A	B,B-1
BBB/Baa/B++	B-2
BB/Ba/B+	B-3
B	C
CCC/Caa/C++	-
CC/Ca/C+	-
C et moins	D
Aucune	AN

Les soldes de trésorerie, à l'exception des soldes de la trésorerie soumise à restriction et des comptes sur marge, présentés dans les états de la situation financière sont conservés par le dépositaire. Le gestionnaire surveille régulièrement la solvabilité du dépositaire. La note de crédit du dépositaire au 30 juin 2023 était de AA (AA au 31 décembre 2022).

Toutes les opérations sont effectuées par l'entremise de courtiers approuvés et réglées sur livraison par l'entremise des courtiers principaux de chacun des Fonds, soit Scotia Capitaux Inc., la Banque Canadienne Impériale de Commerce, TD Waterhouse Canada Inc., BMO Marchés des capitaux and Goldman Sachs. Le risque de défaillance est considéré comme minime, étant donné que la livraison des placements vendus n'est effectuée qu'au moment de la réception du paiement par chaque Fonds. Le paiement est effectué lorsque les placements ont été reçus par chaque Fonds. Si une des parties ne respecte pas son obligation, l'opération échouera.

Au 30 juin 2022, les notes de crédit de Scotia Capitaux Inc., de la Banque Canadienne Impériale de Commerce, de TD Waterhouse Canada Inc. et de BMO Marchés des capitaux et Goldman Sachs étaient respectivement de Aa2, AA, A-1+, A+ et A+ (31 décembre 2022 – étaient Aa2, AA, A-1+, A+ et A+, respectivement).

Toutes les opérations effectuées par un Fonds portant sur des titres cotés sont réglées ou payées à la livraison en utilisant des courtiers approuvés. Le risque de défaillance est considéré comme minime, étant donné que la livraison des titres vendus n'est effectuée qu'au moment de la réception du paiement par le courtier. Le paiement est effectué lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une ou l'autre des parties manque à son obligation.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque qu'un Fonds ne puisse pas respecter ses engagements à temps ou à un prix raisonnable. Les Fonds sont exposés à des rachats en trésorerie quotidiens de parts rachetables. Par conséquent, les Fonds investissent la majorité de leur actif dans des placements qui sont négociés sur des marchés actifs et qui peuvent être vendus facilement. De plus, les Fonds conservent des positions en trésorerie et en équivalents de trésorerie assez élevées afin de maintenir leur niveau de liquidités. De temps à autre, les Fonds pourraient conclure un contrat dérivé ou investir dans des titres non cotés qui pourraient ne pas se négocier sur un marché organisé ou encore être illiquides. Tous les passifs financiers arrivent à échéance dans trois mois ou moins.

Risque de marché

Les placements des Fonds sont exposés au risque de marché, qui est le risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des conditions du marché.

Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt). La valeur de chaque placement est influencée par les perspectives de l'émetteur et par les conditions économiques et politiques générales, de même que par les tendances du secteur et du marché. Les titres présentent tous un risque de perte de capital. Sauf pour les options vendues, les contrats à terme standardisés vendus à découvert et les placements vendus à découvert, le risque maximal provenant des instruments financiers est équivalent à leur juste valeur. Sur les options d'achat vendues, les positions vendeur à terme et les titres de capitaux propres et titres de créance vendus à découvert, la perte maximale du capital peut être illimitée.

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme et, par conséquent, leur exposition à l'autre risque de prix est minime.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Risque de change

Le risque de change provient d'instruments financiers qui sont libellés en devises autres que la monnaie fonctionnelle des Fonds. Par conséquent, les Fonds peuvent être exposés au risque que la valeur des titres libellés dans d'autres devises varie à cause de fluctuations des taux de change.

L'inventaire du portefeuille indique toutes les obligations et tous les dérivés qui sont libellés en devises. Les actions négociées sur des marchés étrangers sont aussi exposées à des risques de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle des Fonds afin de déterminer leur juste valeur.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt varie en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur des Fonds qui investissent dans des titres de créance ou des titres de fiducies de revenu sera influencée par des fluctuations du taux d'intérêt applicable. Si les taux d'intérêt diminuent, la juste valeur des titres de créance existants pourrait augmenter en raison du rendement plus élevé. Par contre, si les taux d'intérêt augmentent, la réduction du rendement des titres de créance existants pourrait entraîner une baisse de leur juste valeur. En général, la baisse est plus importante pour les titres de créance à long terme que pour les titres de créance à court terme.

Le risque de taux d'intérêt s'applique également aux Fonds qui investissent dans des titres convertibles. La juste valeur de ces titres varie de façon inverse aux taux d'intérêt, tout comme d'autres titres de créance. Toutefois, étant donné qu'ils peuvent être convertis en parts ordinaires, les titres convertibles sont généralement moins touchés par les fluctuations de taux d'intérêt que d'autres titres de créance.

Hiérarchie des justes valeurs

Les Fonds doivent classer les instruments financiers évalués selon la juste valeur en utilisant une hiérarchie des justes valeurs. Les placements évalués selon des cours cotés sur des marchés actifs sont classés au niveau 1. Il s'agit notamment d'actions cotées en Bourse, de fonds communs de placement négociés en Bourse et de fonds communs de placement de détail, de bons de souscription négociés en Bourse, de contrats à terme et d'options négociées.

Les instruments financiers qui sont négociés sur les marchés qui ne sont pas considérés comme étant actifs, mais qui sont évalués selon les cours du marché, les cotations de courtiers ou d'autres sources d'évaluations étayées par des données observables sont classés au niveau 2. Il s'agit notamment de titres à revenu fixe, de titres adossés à des créances hypothécaires, d'instruments à court terme, de bons de souscription non négociés, d'options négociées hors bourse, d'obligations structurées de titres indexés, de contrats à terme de devises, d'instruments d'échange, de certificats américains de dépôt et de certificats de dépôt mondiaux, si le cours du marché n'est pas disponible.

L'évaluation des placements classés au niveau 3 repose sur des données non observables importantes. Les placements du niveau 3 comprennent les actions de sociétés fermées, les prêts à terme privés, les fonds d'actions privés et certains dérivés. Des cours observables n'étant pas disponibles pour ces titres, les Fonds pourraient utiliser une variété de techniques d'évaluation pour calculer la juste valeur.

La politique des Fonds consiste à comptabiliser les transferts d'un niveau à l'autre de la hiérarchie à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

11. LÉGENDE DES DEVISES

Voici une liste des abréviations qui peuvent être utilisées dans les états financiers :

AUD	Dollar australien
MXN	Peso mexicain
BMD	Dollar des Bermudes
MYR	Ringgit malaisien
BRL	Réal brésilien
NOK	Couronne norvégienne
CAD	Dollar canadien
NZD	Dollar néo-zélandais
CHF	Franc suisse
PEN	Nouveau sol péruvien
DKK	Couronne danoise
PHP	Peso philippin
EUR	Euro
PKR	Roupie pakistanaise
GBP	Livre sterling
PLN	Zloty polonais
HKD	Dollar de Hong Kong
SEK	Couronne suédoise
IDR	Rupiah indonésienne
SGD	Dollar de Singapour
ILS	Shekel israélien
THB	Baht thaï
INR	Roupie indienne
TWD	Nouveau dollar de Taiwan
JPY	Yen japonais
USD	Dollar américain
KRW	Won sud-coréen
ZAR	Rand sud-africain

Avis juridique

Certains noms, mots, phrases, graphismes ou conceptions graphiques figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Gestion mondiale d'actifs CI.

Fonds CI, Financière CI, Placements CI et le logo Placements CI sont des marques déposées de Gestion mondiale d'actifs CI. Les marques et noms des logos CI et icône CI sont la propriété de Gestion mondiale d'actifs CI et sont utilisés sous licence. Gestion mondiale d'actifs CI est le nom d'une société enregistrée de CI Investments Inc.

Auspice Capital Advisors Ltd. (« Auspice ») CI Investments Inc., a obtenu une licence d'utilisation. Le Fonds de produits de base généraux CI Auspice n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Auspice, et Auspice ne fait aucune déclaration concernant l'opportunité d'investir dans le Fonds de produits de base généraux CI Auspice.

Le Fonds de produits de base généraux CI Auspice n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Auspice Capital Advisors Ltd. et ses sociétés affiliées (« Auspice »). Auspice ne fait aucune déclaration, ne pose aucune condition et ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires du Fonds de produits de base généraux CI Auspice ou à tout membre du public quant à la pertinence d'investir dans des titres en général ou dans le Fonds de produits de base généraux CI Auspice en particulier ou quant à la capacité de l'indice Auspice Broad Commodity Excess Return (l'« indice Auspice ») de suivre le rendement du marché des produits de base. Le seul lien entre Auspice et CI Investments Inc. est l'octroi de licences pour certaines marques de commerce et certains noms commerciaux et pour l'indice Auspice, qui sont déterminés, composés et calculés par Auspice sans égard à CI Investments Inc. ou au Fonds de produits de base généraux CI Auspice. Auspice n'a aucune obligation de prendre en considération les besoins de CI Investments Inc. ou des propriétaires du Fonds de produits de base généraux CI Auspice dans la détermination, la composition ou le calcul de l'indice Auspice. Auspice n'a aucune obligation ou responsabilité en rapport avec l'administration, la commercialisation ou la négociation des parts.

Auspice ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'indice Auspice ou de toute donnée qui y est incluse et Auspice n'est pas responsable des erreurs, omissions ou interruptions qui y figurent. Auspice ne donne aucune garantie ni ne pose aucune condition, expresse ou implicite, quant aux résultats qui seront obtenus par CI Investments Inc, les propriétaires du Fonds de produits de base généraux CI Auspice, ou toute autre personne ou entité, suite à l'utilisation de l'indice Auspice ou de toute donnée incluse dans celui-ci. Auspice ne donne aucune garantie ni ne pose aucune condition, expresse ou implicite, et rejette expressément toute garantie ou condition de qualité marchande ou d'adéquation à un usage ou à un but particulier en ce qui concerne l'indice Auspice ou toute donnée incluse dans celui-ci. Sans limiter la portée de ce qui précède, Auspice ne sera en aucun cas responsable des dommages spéciaux, punitifs, indirects ou consécutifs (y compris les pertes de profits) résultant de l'utilisation de l'indice Auspice ou de toute donnée incluse dans celui-ci, même si elle a été informée de la possibilité de tels dommages.

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires des présents états financiers en composant le 1 800 792-9355, en écrivant à servicefrancais@ci.com ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet du Fonds, est disponible à l'adresse www.ci.com ou à l'adresse www.sedar.com.

Pour plus d'informations, veuillez visit www.ci.com.

SA_F 08/23