

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

ÉTATS FINANCIERS

POUR LE SEMESTRE CLOS LE 30 JUIN 2026 (NON AUDITÉS)

(Exprimés en dollars canadiens)

RESPONSABILITÉ DE LA DIRECTION À L'ÉGARD DE L'INFORMATION FINANCIÈRE

Les états financiers intermédiaires non audités ci-joints ont été établis par Oak Hill Asset Management Inc., en sa qualité de gestionnaire du Fonds. Le gestionnaire du Fonds est responsable des informations et des déclarations contenues dans ces états financiers.

Le gestionnaire met en œuvre des processus appropriés pour garantir la production d'informations financières pertinentes et fiables. Les états financiers intermédiaires non audités ont été établis conformément aux normes IFRS de comptabilité et comprennent certains montants fondés sur des estimations et des jugements formulés par le gestionnaire. Les informations significatives sur les méthodes comptables que le gestionnaire estime appropriées pour le Fonds sont décrites dans la note 3 des états financiers intermédiaires non audités.

Au nom du Gestionnaire

Muneeb Ahsan

Le 26 août 2026

AVIS AUX PORTEURS DE PARTS

Les auditeurs aux comptes du Fonds n'ont pas examiné ces états financiers.

Oak Hill Asset Management Inc., le gestionnaire du Fonds, nomme un auditeur indépendant pour qu'il audite les états financiers annuels du Fonds. Lorsque l'auditeur n'a pas examiné les états financiers intermédiaires du Fonds, les lois sur les valeurs mobilières applicables exigent qu'il en soit fait mention dans un avis accompagnant le rapport financier.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Table des matières 30

juin 2026

	Page
États de la situation financière	1-2
État du résultat global (perte)	3
Tableau des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables	4
Tableau des flux de trésorerie	5
Tableau des placements.....	6-99
Notes annexes aux états financiers	100-114

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

États de la situation financière

Au 30 juin 2026 (non audité) et au 31 décembre 2025

	Note	30 juin 2026	31 décembre 2025
		\$	\$
Actifs			
Trésorerie et équivalents de trésorerie (y compris la trésorerie soumise à restrictions de 2026 - 154 215 505 \$ et de 2025 - 113 983 712 \$, respectivement)		200 488 853	175 705 634
Placements évalués à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	8	124 362 751	120 578 182
Actifs liés à des swaps sur actions, à leur juste valeur	8	68 673 141	26 322 854
Actifs de contrats de change à terme, à leur juste valeur	8	215	1 065
Créances sur les courtiers		8 365 167	2 846 202
Créances relatives aux parts émises		256 480	1 471 979
Autres créances		237 751	-
Total de l'actif		402 384 358	326 925 916
Passif			
Passifs liés aux swaps sur actions, à leur juste valeur	8	62 097 240	20 395 366
Passifs sur contrats de change à terme, à leur juste valeur	8	85 682	535 819
Dettes envers les courtiers		12 077 210	6 303 390
Intérêts à payer		1 169 407	849 225
Frais de gestion à payer	7	282 637	257 347
Charges à payer et autres passifs		191 120	105 807
Honoraires d'agent de transfert à payer		159 093	-
Honoraires professionnels à payer		118 269	105 063
Montant à payer au titre des parts rachetées		64 020	9 704
Frais administratifs à payer		44 222	154 637
Commission de performance à verser	7	2 738	83 327
Total du passif		76 291 638	28 799 685
Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables		326 092 720	298 126 231
Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par série			
Parts de série A (couvertes)		5 876 703	5 256 469
Parts de série A (en dollars américains)		207 666	309 905
Parts de série F (couvertes)		70 861 678	55 375 963
Parts de série F (en dollars américains)		19 334 510	10 055 531
Parts de série I (institutionnelles)		15 696 666	10 893 010
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)		31 680 625	31 112 160
Parts de série X (fondateurs)		165 274 402	168 600 167
Parts de série X (fondateurs en dollars américains)		17 160 470	16 523 026
Total des actifs nets attribuables aux détenteurs de parts rachetables		326 092 720	298 126 231

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

États de la situation financière (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité) et au 31 décembre 2025

	Note	30 juin 2026	31 décembre 2025
		\$	\$
Nombre de parts rachetables en circulation			
Parts de série A (couvertes)	6	580 104	505 006
Parts de série A (en dollars américains)	6	14 595	21 998
Parts de série F (couvertes)	6	6 921 796	5 298 151
Parts de série F (en dollars américains)	6	1 318 641	697 864
Parts de série I (institutionnelles)	6	1 563 948	1 060 937
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)	6	2 198 426	2 198 426
Parts de série X (fondateurs)	6	16 170 514	16 125 319
Parts de série X (fondateurs en dollars américains)	6	1 167 583	1 145 341
Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part			
Parts de série A (couvertes)		10,13	10,41
Parts de série A (en dollars américains)		14,23	14,09
Parts de série F (couvertes)		10,24	10,45
Parts de série F (en dollars américains)		14,66	14,41
Parts de la série I (institutionnelles)		10,04	10,27
Parts de la série I (institutionnelles en dollars américains)		14,41	14,15
Parts de la série X (Fondateurs)		10,22	10,46
Parts de la série X (Fondateurs en dollars américains)		14,70	14,43

Approuvées et autorisées à l'émission pour le compte du Fonds par le
Gestionnaire :

Oak Hill Asset Management Inc.

Muneeb Ahsan

FONDS OAK HILL AQR DELPHI LONG-SHORT EQUITY

État du résultat global

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

	Note	2026
		\$
Revenus		
Gain (perte) net(te) réalisé(e) sur la cession de placements, y compris les dérivés et les ajustements de change ajustements		(5 907 615)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente sur la valeur des placements, y compris les instruments dérivés et les ajustements de change		6 466 931
Gain (perte) net(te) de change		5 496 834
Produits d'intérêts aux fins de la distribution	3	312 060
Autres produits		1 492
Total des revenus		6 369 702
Charges d'exploitation		
Charges d'intérêts		7 899 969
Frais de gestion	7	1 610 643
Retenues à la source		1 223 402
Frais administratifs		233 828
Frais d'agent de transfert		121 244
Impôts indirects		119 824
Honoraires d'audit		108 254
Frais de dépôt		96 667
Frais de dépôt		69 283
Honoraires professionnels		19 486
Honoraires du comité d'examen indépendant	5	14 723
Frais bancaires		6 962
Autres dépenses		5 100
Commission de performance	7	117
Total des frais d'exploitation		11 529 502
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables		(5 159 800)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par catégorie et par série		
Parts de série A (couvertes)		(181 365)
Parts de série A (en dollars américains)		(2 401)
Parts de série F (couvertes)		(1 891 669)
Parts de série F (en dollars américains)		809 762
Parts de série I (institutionnelles)		(246 344)
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)		568 465
Parts de série X (fondateurs)		(4 464 429)
Parts de série X (fondateurs en dollars américains)		248 181
		(5 159 800)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part		
Parts de série A (couvertes)	10	(0,31)
Parts de série A (en dollars américains)	10	(0,13)
Parts de série F (couvertes)	10	(0,26)
Parts de la série F (en dollars américains)	10	0,86
Parts de la série I (institutionnelles)	10	(0,18)
Parts de la série I (institutionnelles en dollars américains)	10	0,26
Parts de la série X (Fondateurs)	10	(0,26)
Parts de la série X (Fondateurs en dollars américains)	10	0,20

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

État des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

						2026
Série	Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables, au début de la période	Produit de la vente des parts rachetables émises	Rachat de parts rachetables	Entrées / sorties	Augment ation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables	Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables, à la fin de la période
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Parts de série A (couvertes)	5 256 469	2 045 075	(1 110 788)	(132 688)	(181 365)	5 876 703
Parts de série A (en dollars américains)	309 905	34 254	(134 092)	-	(2 401)	207 666
Parts de série F (couvertes)	55 375 963	43 935 939	(26 654 413)	95 858	(1 891 669)	70 861 678
Parts de série F (en dollars américains)	10 055 531	9 894 009	(1 424 792)	-	809 762	19 334 510
Parts de série I (institutionnelles)	10 893 010	5 050 000	-	-	(246 344)	15 696 666
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)	31 112 160	-	-	-	568 465	31 680 625
Parts de la série X (Fondateurs)	168 600 167	40 173 515	(39 071 681)	36 830	(4 464 429)	165 274 402
Parts de série X (Fondateurs en dollars américains)	16 523 026	5 173 880	(4 784 617)	-	248 181	17 160 470
Total	298 126 231	106 306 672	(73 180 383)	-	(5 159 800)	326 092 720

FONDS OAK HILL AQR DELPHI LONG-SHORT EQUITY

Tableau des flux de trésorerie

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

	2026
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables	(5 159 800)
Ajustements liés aux éléments hors trésorerie :	
Variation nette de la (plus-value) moins-value latente sur les placements, y compris les instruments dérivés et les ajustements de change	(6 466 931)
(Gain) perte net(te) réalisé(e) sur la cession de placements, y compris les instruments dérivés et les ajustements de change	5 907 615
Acquisitions de placements	(115 646 845)
Produits de la cession de placements	118 839 761
Gain (perte) net(te) réalisé(e) sur les contrats de change à terme réglés	(11 010 644)
Gain (perte) net(te) réalisé(e) sur les swaps sur actions	3 494 775
Variation des soldes hors trésorerie :	
(Augmentation) diminution des créances sur les courtiers	(5 518 965)
(Augmentation) diminution des autres créances	(237 751)
(Augmentation) diminution des dettes envers les courtiers	5 773 820
Augmentation (diminution) des intérêts à payer	320 182
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	25 290
Augmentation (diminution) des charges à payer et autres passifs	85 313
Augmentation (diminution) des honoraires d'agent de transfert à payer	159 093
Augmentation (diminution) des honoraires professionnels à payer	13 206
Augmentation (diminution) des frais administratifs à payer	(110 415)
Augmentation (diminution) des commissions de performance à payer	(80 589)
Flux de trésorerie nets provenant des (utilisés dans les) activités d'exploitation	(9 612 885)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	
Produits provenant de l'émission de parts rachetables	107 522 171
Sommes versées au titre du rachat de parts rachetables	(73 126 067)
Flux de trésorerie nets provenant des (utilisés dans les) activités de financement	34 396 104
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie	24 783 219
Trésorerie et équivalents de trésorerie en début de période	175 705 634
Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de la période	200 488 853
Informations complémentaires :	
Intérêts perçus	312 060
Charges d'intérêts payées	(7 579 787)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Tableau des placements

Au 30 juin 2026 (non audité)

Valeur nominale	Description valeur liquidative	Coût	Juste valeur	% de la
		\$	\$	%
Bons du Trésor américain				
2 621 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 02/07/2026	3 526 939	3 715 815	1,14
3 036 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 23/07/2026	4 124 960	4 295 166	1,32
2 069 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 30/07/2026	2 786 760	2 925 050	0,90
7 000 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 06/08/2026	9 400 191	9 889 121	3,03
2 305 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 13/08/2026	3 069 933	3 253 924	1,00
8 077 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 20/08/2026	10 821 682	11 393 625	3,49
8 857 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 27/08/2026	11 919 590	12 485 005	3,83
6 896 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 10/09/2026	9 200 116	9 707 403	2,98
7 246 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 17/09/2026	9 733 268	10 192 707	3,13
5 294 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 24/09/2026	7 131 372	7 441 385	2,28
4 909 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 01/10/2026	6 713 367	6 893 879	2,11
2 940 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 08/10/2026	4 016 965	4 125 964	1,27
5 013 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 15/10/2026	6 785 532	7 030 452	2,16
6 683 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 22/10/2026	8 955 418	9 364 217	2,87
7 137 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 05/11/2026	9 539 334	9 985 327	3,06
4 397 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 19/11/2026	5 930 849	6 142 415	1,88
325 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 27/11/2026	440 481	453 621	0,14
3 645 000	États-Unis d'Amérique, 0,00 %, 31/12/2026	5 077 027	5 067 675	1,55
		119 173 784	124 362 751	38,14
Placements évalués à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		119 173 784	124 362 751	38,14
Gain (perte) latente sur contrats de change à terme (annexe 1)			(85 467)	(0,03)
Gain (perte) latente sur les swaps sur actions (annexe 2)			6 575 901	2,02
Autres actifs, nets			195 239 535	59,87
Actifs nets attribuables aux détenteurs de parts rachetables			326 092 720	100,00

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 1 – Contrats de change à terme

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Taux à terme Taux	Devise à recevoir	Devise à livrer	Équivalent	Non réalisé plus-value
				\$	\$
31 juillet 2026	0,7050	105 645 CAD	74 478 USD	105 496	149
31 juillet 2026	1,4160	147 773 USD	209 250 CAD	147 707	66
Gain latent sur contrats à terme					215

Date de règlement	Taux taux	Devise à recevoir	Devise à livrer	Équivalent	Perte ou gain perte
				\$	\$
31 juillet 2026	0,7064	29 730 CAD	21 000 USD	29 746	(16)
31 juillet 2026	0,7062	76 649 CAD	54 130 USD	76 673	(24)
31 juillet 2026	0,7064	58 119 CAD	41 053 USD	58 150	(31)
31 juillet 2026	0,7064	287 982 CAD	203 418 USD	288 136	(154)
31 juillet 2026	1,4185	179 785 USD	255 020 CAD	Erreur	(358)
31 juillet 2026	0,7064	743 478 CAD	525 160 USD	743 876	(398)
31 juillet 2026	0,7062	5 711 807 CAD	4 033 773 USD	5 713 742	(1 935)
31 juillet 2026	0,7062	15 229 252 CAD	10 755 152 USD	15 234 412	(5 160)
31 juillet 2026	0,7062	68 752 433 CAD	48 554 115 USD	68 775 728	(23 295)
31 juillet 2026	0,7062	160 288 280 CAD	113 198 257 USD	160 342 591	(54 311)
Perte latente sur contrats à terme					(85 682)
Total des gains (pertes) latents sur contrats à terme					(85 467)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur
actions* Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Montant notionnel	Non réalisé
					montant	gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	AUD	AGL ENERGY LTD (ASX)	4,35	(45 277)	379 623	11 712
13/08/2030	AUD	ANZ GROUP HOLDINGS LTD (ASX)	4,35	27 377	923 551	40 554
13/08/2030	AUD	ASX LTD (ASX)	4,35	260	12 247	1 258
13/08/2030	AUD	BRAMBLES LTD	4,35	37 310	655 540	51 976
13/08/2030	AUD	CAR GROUP LTD	4,35	(25 445)	668 163	30 121
13/08/2030	AUD	COLES GROUP LTD (ASX)	4,35	12 400	290 664	4 563
13/08/2030	AUD	COMPUTERSHARE LTD	4,35	10 593	374 618	20 099
13/08/2030	AUD	DYNO NOBEL LTD	4,35	54 653	204 321	6 641
13/08/2030	AUD	EVOLUTION MINING LTD	4,35	134 662	1 417 015	124 257
13/08/2030	AUD	FORTESCUE LTD	4,35	(12 691)	243 546	7 049
13/08/2030	AUD	MEDIBANK PRIVATE LTD (ASX)	4,35	34 024	160 743	3 819
13/08/2030	AUD	MINERAL RESOURCES LTD (ASX)	4,35	(25 668)	1 608 025	57 951
13/08/2030	AUD	NEXTDC LTD	4,35	(98 973)	1 462 661	58 597
13/08/2030	AUD	ORICA LTD (ASX)	4,35	40 378	908 177	33 407
13/08/2030	AUD	ORIGIN ENERGY LTD	4,35	(37 201)	399 445	1 841
13/08/2030	AUD	PLS GROUP LTD	4,35	(190 948)	1 073 591	141 852
13/08/2030	AUD	PRO MEDICUS LTD	4,35	6 122	965 566	248 175
13/08/2030	AUD	QANTAS AIRWAYS LTD	4,35	25 643	233 284	31 920
13/08/2030	AUD	QBE INSURANCE GROUP LTD	4,35	47 176	1 086 758	71 225
13/08/2030	AUD	SCENTRE GROUP (ASX)	4,35	7 105	26 268	440
13/08/2030	AUD	STOCKLAND	4,35	3 414	13 296	776
13/08/2030	AUD	SUNCORP GROUP LTD (ASX)	4,35	39 952	712 489	37 661
13/08/2030	AUD	CENTRES DE PROXIMITÉ	4,35	5 407	13 531	52
13/08/2030	AUD	WESFARMERS LTD	4,35	7 650	622 697	50 558
13/08/2030	AUD	WESTPAC BANKING CORP	4,35	6 739	232 928	2 383
13/08/2030	AUD	WISETECH GLOBAL LTD	4,35	(27 258)	1 012 394	137 788
13/08/2030	AUD	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD (ASX)	4,35	(31 453)	952 982	89 918
13/08/2030	AUD	WOOLWORTHS GROUP LTD	4,35	39 718	1 467 106	82 018
13/08/2030	AUD	WORLEY LTD	4,35	(13 568)	161 936	15 412
13/08/2030	AUD	JB HI-FI LTD	4,35	229	17 043	958
13/08/2030	AUD	LIONTOWN LTD	4,35	(44 237)	82 259	9 913
13/08/2030	AUD	QUBE HOLDINGS LTD	4,35	9 943	49 218	142
13/08/2026	CAD	BANQUE DE MONTRÉAL (TOR)	2,31	5 060	1 190 365	73 842
13/08/2026	CAD	BANQUE DE NOUVELLE-ÉCOSSE (TOR)	2,31	8 007	940 262	43 466
13/08/2026	CAD	BCE INC (TOR)	2,31	(52 509)	1 800 767	178 600
13/08/2026	CAD	BOMBARDIER INC-B	2,31	758	241 585	5 879
13/08/2026	CAD	BROOKFIELD CORP	2,31	(21 990)	1 380 597	50 997
13/08/2026	CAD	BANQUE IMPÉRIALE DU COMMERCE DU CANADA (TOR)	2,31	2 849	452 165	14 124
13/08/2026	CAD	CAPSTONE COPPER CORP	2,31	(51 674)	744 622	73 218
13/08/2026	CAD	CCL INDUSTRIES INC - CL B(TOR)	2,31	4 556	386 230	35 187
13/08/2026	CAD	CGI INC	2,31	(5 655)	527 046	9 079
13/08/2026	CAD	EMERA INC	2,31	5 866	431 151	8 610
13/08/2026	CAD	EMPIRE CO LTD « A » (TOR)	2,31	3 464	170 879	569
13/08/2026	CAD	ENBRIDGE INC	2,31	(16 437)	1 298 194	37 222
13/08/2026	CAD	EQUINOX GOLD CORP	2,31	(42 371)	618 533	34 285
13/08/2026	CAD	FIRSTSERVICE CORP (TOR)	2,31	56	11 214	63
13/08/2026	CAD	GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT (TOR)	2,31	7 622	383 387	12 734
13/08/2026	CAD	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,31	(14 769)	1 244 660	162 986

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2026	CAD	GREAT-WEST LIFECO INC (TOR)	2,31	337	28 145	2 406
13/08/2026	CAD	IA FINANCIAL CORP INC	2,31	2 247	406 866	33 482
13/08/2026	CAD	IGM FINANCIAL INC	2,31	(2 304)	185 495	2 087
13/08/2026	CAD	INTACT FINANCIAL CORP (TOR)	2,31	3 774	1 048 719	56 947
13/08/2026	CAD	IVANHOE MINES LTD-CL A	2,31	(50 502)	594 912	35 253
13/08/2026	CAD	KEYERA CORP	2,31	(2 648)	156 258	4 359
13/08/2026	CAD	LUNDIN GOLD INC (TOR)	2,31	16 689	1 281 556	11 982
13/08/2026	CAD	LUNDIN MINING CORP	2,31	(10 966)	415 173	36 995
13/08/2026	CAD	NUTRIEN LTD (TOR)	2,31	(8 944)	846 192	42 523
13/08/2026	CAD	ONEX CORPORATION (TOR)	2,31	(1 796)	197 900	7 846
13/08/2026	CAD	POWER CORP OF CANADA	2,31	728	63 077	1 481
13/08/2026	CAD	STAGIAIRE AUPRÈS DE MARQUES DE RESTAURATION	2,31	(9 079)	951 747	11 760
13/08/2026	CAD	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	2,31	(26 331)	1 419 768	195 281
13/08/2026	CAD	BANQUE ROYALE DU CANADA	2,31	7 441	2 077 514	100 753
13/08/2026	CAD	SUN LIFE FINANCIAL INC (TOR)	2,31	6 480	693 619	30 794
13/08/2026	CAD	TFI INTERNATIONAL INC	2,31	(1 472)	330 148	29 361
13/08/2026	CAD	TOROMONT INDUSTRIES LTD (TOR)	2,31	5 400	1 140 295	117 554
13/08/2026	CAD	WHITECAP RESOURCES INC (TOR)	2,31	(58 658)	958 472	89 796
13/08/2026	CAD	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	2,31	(30 239)	1 989 731	52 221
13/08/2026	CAD	CANADIAN UTILITIES LTD-A (TOR)	2,31	1 235	64 519	544
13/08/2026	CAD	FIRST MAJESTIC SILVER CORP (TOR)	2,31	(3 276)	80 770	2 040
13/08/2026	CAD	IAMGOLD CORP (TOR)	2,31	(4 418)	102 630	3 454
13/08/2026	CAD	NEXGEN ENERGY LTD	2,31	(15 232)	209 592	7 300
13/08/2026	CAD	PEMBINA PIPELINE CORP	2,31	(1 470)	99 357	1 971
13/08/2026	CAD	TC ENERGY CORP	2,31	(2 064)	200 291	5 143
14/08/2026	DKK	ALM. BRAND A/S (CPH)	1,78	15 556	51 922	2 510
14/08/2026	DKK	AP MOLLER-MAERSK A/S-B (CPH)	1,78	(192)	726 307	81 073
14/08/2026	DKK	COLOPLAST-B (CPH)	1,78	(1 251)	103 685	3 194
14/08/2026	DKK	DANSKE BANK A/S (CPH)	1,78	17 519	1 287 047	37 990
14/08/2026	DKK	DSV A/S	1,78	(4 237)	1 476 248	58 261
14/08/2026	DKK	GENMAB A/S	1,78	708	248 115	26 155
14/08/2026	DKK	ISS A/S (CPH)	1,78	14 222	812 714	9 166
14/08/2026	DKK	JYSKE BANK-REG	1,78	1 267	254 780	3 679
14/08/2026	DKK	MATAS A/S (CPH)	1,78	(811)	16 466	687
14/08/2026	DKK	NTG NORDIC TRANSPORT GROUP A	1,78	(299)	13 106	664
14/08/2026	DKK	PANDORA A/S	1,78	3 378	470 743	76 944
14/08/2026	DKK	PER AARSLEFF HOLDING A/S	1,78	634	89 340	11 595
14/08/2026	DKK	RINGKJOEBING LANDBOBANK A/S (CPH)	1,78	369	123 404	117
14/08/2026	DKK	ROYAL UNIBREW	1,78	3 847	343 244	15 218
14/08/2026	DKK	VESTAS WIND SYSTEMS A/S (CPH)	1,78	52 256	1 878 794	204 687
14/08/2026	DKK	AMBU A/S-B (CPH)	1,78	(568)	7 758	270
14/08/2026	EUR	AALBERTS NV	2,18	(10 164)	659 414	20 062
14/08/2026	EUR	ABN AMRO BANK NV - CVA	2,18	7 829	442 950	26 997
14/08/2026	EUR	ACEA SPA	2,18	215	7 868	18
14/08/2026	EUR	ACERINOX SA (MAD)	2,18	(5 240)	143 952	14 330
14/08/2026	EUR	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,18	10 243	2 082 243	45 079
14/08/2026	EUR	ADIDAS AG (ALL)	2,18	4 836	1 379 784	18 809
14/08/2026	EUR	ADYEN NV	2,18	(347)	465 071	6 801

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	AENA SME SA	2,18	25 950	1 089 072	27 096
14/08/2026	EUR	AGEAS	2,18	6 537	704 372	33 878
14/08/2026	EUR	AIR LIQUIDE SA (PAR)	2,18	2 858	778 620	20 591
14/08/2026	EUR	ALLIANZ SE-REG (GER)	2,18	3 739	2 346 545	152 389
14/08/2026	EUR	ALTEN SA (PAR)	2,18	(421)	41 685	4 781
14/08/2026	EUR	AMG CRITICAL MATERIALS N.V.	2,18	(2 623)	153 623	15 069
14/08/2026	EUR	APERAM (EOE)	2,18	(580)	48 467	8 154
14/08/2026	EUR	ARCELORMITTAL (EOE)	2,18	(14 522)	1 423 798	189 185
14/08/2026	EUR	ARGENX SE	2,18	875	1 109 307	36 257
14/08/2026	EUR	ASM INTERNATIONAL NV	-	(685)	1 118 868	10 526
14/08/2026	EUR	ASML HOLDING NV (EOE)	2,18	1 863	4 911 828	261 776
14/08/2026	EUR	AURUBIS AG	2,18	(3 095)	984 950	78 798
14/08/2026	EUR	AUTO1 GROUP SE (ALL)	2,18	(10 464)	394 799	3 374
14/08/2026	EUR	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA (MAD)	2,18	16 436	534 226	45 789
14/08/2026	EUR	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R(LIS)	2,18	241 388	371 013	32 103
14/08/2026	EUR	BANCO DE SABADELL SA	2,18	15 297	72 910	3 576
14/08/2026	EUR	BANKINTER SA (MAD)	2,18	42 840	1 000 843	20 624
14/08/2026	EUR	BASF SE (ALL)	2,18	(8 749)	700 669	40 339
14/08/2026	EUR	BASIC-FIT NV	2,18	(171)	9 279	276
14/08/2026	EUR	BAYER AG-REG (GER)	2,18	16 761	981 381	328 058
14/08/2026	EUR	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (GER)	2,18	(11 731)	1 265 431	181 652
14/08/2026	EUR	BEIERSDORF AG	2,18	2 379	271 506	17 474
14/08/2026	EUR	BILFINGER SE	2,18	1 222	157 374	984
14/08/2026	EUR	BIOMÉRIEUX (PAR)	2,18	1 018	111 585	1 246
14/08/2026	EUR	BNP PARIBAS (PAR)	2,18	6 524	1 020 575	54 591
14/08/2026	EUR	BPOST SA (BRU)	2,18	(10 384)	28 560	2 594
14/08/2026	EUR	BREMBO N.V.	2,18	(5 663)	102 066	8 496
14/08/2026	EUR	BRUNELLO CUCINELLI SPA	2,18	(3 703)	511 756	18 075
14/08/2026	EUR	BUZZI SPA	2,18	(1 434)	107 163	3 521
14/08/2026	EUR	CAIXABANK SA (MAD)	2,18	82 959	1 601 713	56 952
14/08/2026	EUR	CELLNEX TELECOM SA (MAD)	2,18	(15 836)	739 676	71 830
14/08/2026	EUR	CIR SPA-COMPAGNIE INDUSTRIAL	2,18	18 892	21 151	28
14/08/2026	EUR	CITYCON OYJ (HEL)	2,18	1 888	8 431	387
14/08/2026	EUR	CLARIANE SE	2,18	(2 301)	15 271	3
14/08/2026	EUR	COMMERZBANK AG (GER)	2,18	4 640	279 499	133
14/08/2026	EUR	CONSTRUCTION ET ÉQUIPEMENTS FERROVIAIRES (MAD)	2,18	740	74 229	1 577
14/08/2026	EUR	CORBION NV (EOE)	2,18	(198)	6 458	21
14/08/2026	EUR	CRÉDIT AGRICOLE SA	2,18	58 784	1 590 650	78 155
14/08/2026	EUR	CREDITO EMILIANO SPA (MIL)	2,18	257	6 844	209
14/08/2026	EUR	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,18	(19 545)	409 501	8 746
14/08/2026	EUR	DANONE	2,18	14 098	1 532 310	99 707
14/08/2026	EUR	DEUTSCHE BANK AG – ENREGISTRÉE	2,18	26 151	1 215 974	33 860
14/08/2026	EUR	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG	2,18	(8 748)	49 678	4 090
14/08/2026	EUR	DEUTZ AG (ALL)	2,18	(3 776)	55 624	2 262
14/08/2026	EUR	GROUPE D'IETEREN	2,18	630	172 766	408
14/08/2026	EUR	DR ING HC F PORSCHE AG	2,18	(6 498)	516 191	47 569
14/08/2026	EUR	ECKERT & ZIEGLER SE	2,18	2 550	63 246	280
14/08/2026	EUR	EIFFAGE (PAR)	2,18	6 654	1 361 829	23 679

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	GROUPE ELIOR	2,18	(1 980)	6 404	142
14/08/2026	EUR	ENAV SPA	2,18	20 429	178 646	688
14/08/2026	EUR	ENCE ENERGIA Y CELULOSA SA (MAD)	2,18	(3 889)	15 315	844
14/08/2026	EUR	ENDESA SA (MAD)	2,18	19 644	1 214 457	49 533
14/08/2026	EUR	ENEL SPA (MIL)	2,18	201 105	3 188 188	73 851
14/08/2026	EUR	ENERGIEKONTOR AG (GER)	2,18	(2 383)	158 266	7 086
14/08/2026	EUR	ERAMET (PAR)	2,18	(599)	53 447	9 334
14/08/2026	EUR	ERG SPA (MIL)	2,18	(3 404)	132 506	1 137
14/08/2026	EUR	ESSILORLUXOTTICA (PAR)	2,18	(1 995)	589 699	61 461
14/08/2026	EUR	EVONIK INDUSTRIES AG	2,18	(5 050)	129 663	226
14/08/2026	EUR	FINANCIÈRE DE TUBIZE (BRU)	2,18	(595)	232 768	10 916
14/08/2026	EUR	FINNAIR OYJ	2,18	6 757	49 916	7 837
14/08/2026	EUR	FLATEXDEGIRO SE	2,18	2 624	153 342	5 432
14/08/2026	EUR	FORTUM OYJ	2,18	(5 511)	181 445	959
14/08/2026	EUR	FREENET AG (ALL)	2,18	(3 356)	137 357	15 146
14/08/2026	EUR	FRESENIUS SE & CO KGAA (GER)	2,18	577	35 220	1 991
14/08/2026	EUR	FUGRO NV	2,18	(2 800)	54 044	11 369
14/08/2026	EUR	GALP ENERGIA SGPS SA (LIS)	2,18	(14 879)	460 268	12 610
14/08/2026	EUR	GEA GROUP AG (GER)	2,18	8 809	796 687	56 875
14/08/2026	EUR	GENERALI	2,18	8 747	584 355	17 192
14/08/2026	EUR	GETLINK SE	2,18	2 637	78 544	584
14/08/2026	EUR	GFT TECHNOLOGIES SE (ALL)	2,18	(1 141)	40 335	1 447
14/08/2026	EUR	GREENERGY RENOVABLES	2,18	(513)	99 597	4 560
14/08/2026	EUR	HANNOVER RUECK SE	2,18	1 328	490 301	29 040
14/08/2026	EUR	HEIDELBERG MATERIALS AG	2,18	(1 862)	538 213	35 989
14/08/2026	EUR	HEINEKEN HOLDING NV (EOE)	2,18	162	16 822	624
14/08/2026	EUR	HEINEKEN NV	2,18	8 179	933 172	38 077
14/08/2026	EUR	HELLOFRESH SE	2,18	(7 578)	50 881	2 532
14/08/2026	EUR	HENKEL AG & CO KGAA	2,18	123	12 893	839
14/08/2026	EUR	HENSOLDT AG	2,18	(5 139)	628 731	63 925
14/08/2026	EUR	IBERDROLA SA (MAD)	2,18	68 476	2 251 186	161 917
14/08/2026	EUR	INDRA SISTEMAS SA	2,18	(19 048)	1 727 018	254 047
14/08/2026	EUR	INFRASTRUCTURE SANS FIL ITALIE (MIL)	2,18	(53 463)	569 152	36 884
14/08/2026	EUR	ING GROEP NV (EOE)	2,18	3 952	166 003	10 428
14/08/2026	EUR	INTERCOS SPA	2,18	446	8 904	421
14/08/2026	EUR	INDICE CONSOLIDÉ INTERNATIONAL DES COMPAGNIES AÉRIENNES-DI	2,18	32 705	267 211	27 585
14/08/2026	EUR	IONOS GROUP SE	2,18	1 185	51 074	991
14/08/2026	EUR	IPSEN (PAR)	2,18	3 837	982 428	62 895
14/08/2026	EUR	JCDECAUX SE	2,18	5 672	169 952	6 154
14/08/2026	EUR	JENOPTIK AG	2,18	1 211	86 443	5 268
14/08/2026	EUR	KBC GROUP NV	2,18	5 696	1 056 097	40 124
14/08/2026	EUR	KINEPOLIS	2,18	914	49 242	3 041
14/08/2026	EUR	KOJAMO OYJ	2,18	820	9 585	231
14/08/2026	EUR	KONE OYJ-B	2,18	18 361	1 447 281	26 671
14/08/2026	EUR	KONECRANES OYJ (HEL)	2,18	5 056	213 990	5 268
14/08/2026	EUR	KONINKLIJKE BAM GROEP NV (EOE)	2,18	3 954	72 608	5 684
14/08/2026	EUR	KONINKLIJKE HEIJMANS N.V	2,18	229	41 236	912
14/08/2026	EUR	KONTRON AG	2,18	(1 185)	45 169	474

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	KRONES AG (ALL)	2,18	324	58 291	344
14/08/2026	EUR	LABORATORIOS FARMACEUTICOS R	2,18	(91)	8 657	161
14/08/2026	EUR	LANXESS AG (GER)	2,18	(6 648)	172 845	10 059
14/08/2026	EUR	LEGRAND SA (PAR)	2,18	1 144	247 183	25 288
14/08/2026	EUR	L'ORÉAL (PAR)	2,18	(1 363)	860 574	16 501
14/08/2026	EUR	LOTUS BAKERIES (BRU)	2,18	(11)	208 223	1 960
14/08/2026	EUR	MARR SPA (MIL)	2,18	(1 859)	20 783	957
14/08/2026	EUR	MAUREL ET PROM	2,18	(832)	12 128	1 673
14/08/2026	EUR	MELIA HOTELS INTERNATIONAL (MAD)	2,18	474	8 880	411
14/08/2026	EUR	MERCEDES-BENZ GROUP AG	-	(1 923)	139 611	2 871
14/08/2026	EUR	MERSEN	2,18	(693)	49 176	2 579
14/08/2026	EUR	METSA BOARD OYJ-B	2,18	(19 709)	88 901	2 225
14/08/2026	EUR	MUENCHENER RUECKVER AG-REG (GER)	2,18	256	190 067	11 699
14/08/2026	EUR	MUTARES SE & CO KGAA	2,18	(1 252)	58 236	2 348
14/08/2026	EUR	NAGARRO SE	2,18	382	21 903	24 711
14/08/2026	EUR	NN GROUP NV (EOE)	2,18	15 814	1 874 893	80 465
14/08/2026	EUR	NORDEA BANK ABP	2,18	28 768	760 986	9 431
14/08/2026	EUR	NORDEX SE	2,18	13 405	877 667	122 020
14/08/2026	EUR	OPMOBILITY	2,18	(359)	8 840	940
14/08/2026	EUR	PFEIFFER VACUUM TECHNOLOGY	2,18	39	10 689	150
14/08/2026	EUR	PIAGGIO & C. S.P.A.	2,18	(10 849)	29 699	1 472
14/08/2026	EUR	PIRELLI & C SPA (MIL)	2,18	38 272	390 405	18 061
14/08/2026	EUR	POSTE ITALIANE SPA	2,18	34 149	1 559 689	57 203
14/08/2026	EUR	PROXIMUS (BRU)	2,18	(8 426)	89 019	9 489
14/08/2026	EUR	PUIILO OYJ	2,18	1 846	50 414	3 098
14/08/2026	EUR	QIAGEN N.V. (GER)	2,18	1 282	66 331	3 739
14/08/2026	EUR	QT GROUP OYJ	2,18	(1 814)	72 315	4 427
14/08/2026	EUR	QUADIENT SA	2,18	(348)	7 004	377
14/08/2026	EUR	RÉSEAUX ÉNERGÉTIQUES NATIONAUX	2,18	1 514	8 683	543
14/08/2026	EUR	REMY COINTREAU (PAR)	2,18	(4 946)	356 413	11 921
14/08/2026	EUR	RENK GROUP AG	2,18	(11 807)	882 724	63 892
14/08/2026	EUR	RUBIS (PAR)	2,18	(113)	6 571	637
14/08/2026	EUR	SAF-HOLLAND SE	2,18	(590)	19 664	366
14/08/2026	EUR	SAFRAN SA	2,18	5 417	2 682 696	331 919
14/08/2026	EUR	SALZGITTER AG	2,18	(252)	23 994	5 572
14/08/2026	EUR	SAMPO OYJ-A SHS	2,18	101 005	1 473 023	25 109
14/08/2026	EUR	SANLORENZO SPA/AMEGLIA	2,18	(1 665)	101 179	4 883
14/08/2026	EUR	SARTORIUS AG-VORZUG (GER)	2,18	(3 375)	1 262 440	11 792
14/08/2026	EUR	SES	2,18	(8 606)	114 869	15 395
14/08/2026	EUR	SESA SPA (MIL)	2,18	(367)	58 664	5 484
14/08/2026	EUR	SIEMENS HEALTHINEERS AG	2,18	(11 230)	628 054	7 742
14/08/2026	EUR	SIGNIFY NV	2,18	(20 546)	678 785	125 893
14/08/2026	EUR	SIXT SE	2,18	(1 063)	128 212	14 154
14/08/2026	EUR	SNAM SPA	2,18	137 417	1 428 734	3 955
14/08/2026	EUR	SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBI	2,18	(2 497)	91 261	11 084
14/08/2026	EUR	GROUPE SOPRA STERIA	2,18	(32)	7 595	386
14/08/2026	EUR	STABILUS SE	2,18	(2 330)	61 295	4 291
14/08/2026	EUR	STMICROELECTRONICS NV (PAR)	2,18	(14 241)	1 560 986	79 020

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	SUSS MICROTEC SE	2,18	(656)	101 358	2 798
14/08/2026	EUR	TALANX AG	2,18	3 509	576 911	49 432
14/08/2026	EUR	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS	2,18	(2 907)	43 552	1 397
14/08/2026	EUR	TEAMVIEWER SE	2,18	(29 239)	255 686	24 220
14/08/2026	EUR	TECHNOPROBE SPA	2,18	5 745	308 773	14 808
14/08/2026	EUR	TELECOM ITALIA SPA (MIL)	2,18	2 330	29 756	218
14/08/2026	EUR	TELEPERFORMANCE (PAR)	2,18	(3 390)	305 385	53 677
14/08/2026	EUR	TENARIS SA (MIL)	2,18	(11 499)	504 544	55 320
14/08/2026	EUR	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE (MIL)	2,18	49 269	819 564	11 944
14/08/2026	EUR	GROUPE TESSENDERLO	2,18	(258)	8 494	438
14/08/2026	EUR	THYSSENKRUPP NUCERA AG & CO	2,18	(4 847)	62 579	4 673
14/08/2026	EUR	TIETOEVR Y OYJ	2,18	(479)	15 763	1 620
14/08/2026	EUR	TKH GROUP NV - CERTIFICAT NÉERLANDAIS	2,18	(163)	11 604	118
14/08/2026	EUR	TOKMANNI GROUP CORP	2,18	(5 057)	59 522	1 501
14/08/2026	EUR	TRIGANO SA	2,18	(381)	91 106	4 726
14/08/2026	EUR	UMICORE	2,18	(22 904)	838 952	91 184
14/08/2026	EUR	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,18	147	23 963	332
14/08/2026	EUR	UNICREDIT SPA	2,18	8 849	1 052 085	65 991
14/08/2026	EUR	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	2,18	22 676	887 833	5 222
14/08/2026	EUR	UPM-KYMMENE OYJ (HEL)	2,18	(9 980)	394 992	21 038
14/08/2026	EUR	VICAT (PAR)	2,18	252	25 563	250
14/08/2026	EUR	VIDRALA SA	2,18	50	6 415	354
14/08/2026	EUR	VINCI SA (PAR)	2,18	3 375	687 462	8 328
14/08/2026	EUR	VISCOFAN SA	2,18	1 109	105 860	1 420
14/08/2026	EUR	VOLKSWAGEN AG-PREF(GER)	2,18	(11 042)	1 546 942	228 017
14/08/2026	EUR	VONOVIA SE (GER)	2,18	994	32 850	1 771
14/08/2026	EUR	WARTSILA OYJ ABP (HEL)	2,18	39 983	2 138 590	13 919
14/08/2026	EUR	WAVESTONE	2,18	(105)	6 957	331
14/08/2026	EUR	WEBUILD SPA	2,18	(8 374)	33 166	2 357
14/08/2026	EUR	X-FAB SILICON FOUNDRIES SE	2,18	(3 615)	59 832	13 520
14/08/2026	EUR	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,18	(406)	17 505	273
14/08/2026	EUR	ZIGNAGO VETRO SPA	2,18	(743)	9 521	882
14/08/2026	EUR	ALZCHEM GROUP AG	2,18	(222)	68 027	5 828
14/08/2026	EUR	ARKEMA (PAR)	2,18	(565)	51 145	709
14/08/2026	EUR	AZELIS GROUP NV	2,18	(2 834)	47 823	4 365
14/08/2026	EUR	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,18	(535)	259 747	11 167
14/08/2026	EUR	BRENTAG SE	2,18	(1 405)	125 217	4 378
14/08/2026	EUR	CAPGEMINI SE	2,18	(468)	73 234	6 815
14/08/2026	EUR	CMB TECH NV	2,18	(3 691)	79 542	5 598
14/08/2026	EUR	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	2,18	(6 408)	56 357	157
14/08/2026	EUR	DOUGLAS AG	2,18	(1 076)	15 041	1 424
14/08/2026	EUR	ELECNOR SA	2,18	756	47 335	1 171
14/08/2026	EUR	ELMOS SEMICONDUCTOR SE	2,18	506	142 937	4 319
14/08/2026	EUR	EMEIS SA	2,18	(450)	10 316	87
14/08/2026	EUR	EXAIL TECHNOLOGIES	2,18	55	8 952	1 713
14/08/2026	EUR	FERRETTI SPA (MIL)	2,18	(4 656)	23 668	488
14/08/2026	EUR	FINECOBANK SPA (MIL)	2,18	9 026	320 108	1
14/08/2026	EUR	FORVIA	2,18	(2 929)	44 111	2 728

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	FRIEDRICH VORWERK GROUP SE	2,18	1 030	107 985	4 090
14/08/2026	EUR	GL EVENTS	2,18	180	9 698	51
14/08/2026	EUR	GVS SPA (MIL)	2,18	(1 702)	11 758	61
14/08/2026	EUR	HBX GROUP INTERNATIONAL PLC	2,18	(7 109)	79 246	487
14/08/2026	EUR	HERMES INTERNATIONAL (PAR)	2,18	(172)	472 236	28 677
14/08/2026	EUR	HOCHTIEF AG (GER)	2,18	939	740 039	32 931
14/08/2026	EUR	IMCD NV	2,18	(179)	25 665	2 849
14/08/2026	EUR	INDUSTRIE DE NORA SPA	2,18	(1 756)	20 356	1 468
14/08/2026	EUR	INPOST SA	2,18	339	8 403	25
14/08/2026	EUR	INTERPUMP GROUP SPA (MIL)	2,18	(1 337)	75 307	2 247
14/08/2026	EUR	ITALMOBILIARE SPA (MIL)	2,18	(239)	11 310	522
14/08/2026	EUR	KERING (PAR)	2,18	(588)	255 287	20 907
14/08/2026	EUR	KESKO OYJ-B SHS	2,18	(314)	10 872	961
14/08/2026	EUR	KSB SE & CO KGAA-VORZUG	2,18	12	15 823	808
14/08/2026	EUR	MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	2,18	(8 305)	207 003	2 574
14/08/2026	EUR	MFE-MEDIAFOREUROPE NV-CL A	2,18	(40 851)	199 731	14 051
14/08/2026	EUR	MONCLER SPA (MIL)	2,18	(568)	49 495	2 952
14/08/2026	EUR	NESTE OYJ (HEL)	2,18	13 600	611 462	17 469
14/08/2026	EUR	NOKIA OYJ (HEL)	2,18	(59 013)	1 237 854	137 320
14/08/2026	EUR	NORMA GROUP SE	2,18	2 238	61 482	1 845
14/08/2026	EUR	PHARMANUTRA SPA	2,18	(163)	24 156	1 085
14/08/2026	EUR	PUMA SE	2,18	(1 175)	53 324	2 873
14/08/2026	EUR	RANDSTAD NV	2,18	(392)	17 314	1 336
14/08/2026	EUR	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	2,18	142	11 671	78
14/08/2026	EUR	REDEIA CORP SA	-	(2 395)	57 829	54
14/08/2026	EUR	RTL GROUP (GER)	2,18	(2 407)	126 369	5 170
14/08/2026	EUR	SBM OFFSHORE NV (EOE)	2,18	(3 035)	162 528	13 775
14/08/2026	EUR	SEB SA (PAR)	2,18	(366)	31 327	4 078
14/08/2026	EUR	SEMAPA-SOCIEDADE DE INVESTIM(LIS)	2,18	(305)	11 818	1 561
14/08/2026	EUR	SIEMENS ENERGY AG	2,18	20 927	5 199 851	398 237
14/08/2026	EUR	S.O.I.T.E.C. (PAR)	2,18	(435)	96 665	14 365
14/08/2026	EUR	STELLANTIS NV	2,18	(77 412)	703 634	81 030
14/08/2026	EUR	STORA ENSO OYJ-R SHS(HEL)	2,18	(936)	14 616	530
14/08/2026	EUR	TIKEHAU CAPITAL	2,18	(335)	9 615	641
14/08/2026	EUR	VALMET OYJ	2,18	(1 614)	56 091	948
14/08/2026	EUR	VIRIDIEN	2,18	(164)	26 281	4 117
13/08/2030	HKD	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,84	1 000	10 134	477
13/08/2030	HKD	CLP HOLDINGS LTD	3,84	6 000	77 993	694
13/08/2030	HKD	HENDERSON LAND DEVELOPMENT (HKG)	3,84	(111 000)	530 130	26 608
13/08/2030	HKD	HKT TRUST ET HKT LTD-SS	3,84	38 000	80 216	1 516
13/08/2030	HKD	HONG KONG & CHINA GAS	3,84	(123 000)	149 194	3 189
13/08/2030	HKD	LINK REIT	3,84	3 500	23 342	116
13/08/2030	HKD	MTR CORP (HKG)	3,84	(104 500)	583 401	2 637
13/08/2030	HKD	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	3,84	67 000	669 419	11 382
13/08/2030	HKD	SANDS CHINA LTD	3,84	(126 000)	333 849	42 401
13/08/2030	HKD	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,84	(35 000)	208 489	13 574
13/08/2030	HKD	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	3,84	(5 000)	72 646	71
13/08/2030	HKD	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	3,84	9 000	182 411	27 144

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	HKD	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	3,84	(36 000)	142 726	6 079
14/08/2026	JPY	ABC-MART INC	0,98	20 500	489 892	10 458
14/08/2026	JPY	ACOM CO LTD (TYO)	0,98	1 900	7 481	213
14/08/2026	JPY	ACTIVIA PROPERTIES INC	0,98	51	59 825	2 382
14/08/2026	JPY	ADEKA CORP	0,98	1 300	44 932	3 218
14/08/2026	JPY	ADVANTEST CORP	0,98	4 100	977 815	177 497
14/08/2026	JPY	AEON REIT INVESTMENT CORP (TYO)	0,98	65	69 553	124
14/08/2026	JPY	AGC INC	0,98	28 100	1 722 430	7 848
14/08/2026	JPY	AICA KOGYO CO LTD (TYO)	0,98	5 200	158 440	11 909
14/08/2026	JPY	AIDA ENGINEERING LTD	0,98	600	5 750	1 698
14/08/2026	JPY	AIN HOLDINGS INC	0,98	(2 700)	133 711	2 765
14/08/2026	JPY	AJINOMOTO CO INC	-	(2 600)	132 993	1 568
14/08/2026	JPY	ALPS ALPINE CO LTD	0,98	4 100	72 160	1 936
14/08/2026	JPY	AMANO CORP (TYO)	0,98	200	6 263	278
14/08/2026	JPY	AMVIS HOLDINGS INC	0,98	(10 000)	30 635	1 576
14/08/2026	JPY	ANA HOLDINGS INC (TYO)	0,98	66 500	1 647 782	106 260
14/08/2026	JPY	AND ST HD CO LTD	0,98	2 000	60 048	350
14/08/2026	JPY	AOKI HOLDINGS INC	0,98	4 400	61 790	1 097
14/08/2026	JPY	AOYAMA TRADING CO LTD (TYO)	0,98	2 100	12 757	280
14/08/2026	JPY	ARATA CORP	0,98	800	17 323	92
14/08/2026	JPY	ARCLANDS CORP	0,98	2 900	48 116	461
14/08/2026	JPY	ARCS CO LTD	0,98	1 100	32 067	483
14/08/2026	JPY	ARE HOLDINGS INC	0,98	(6 100)	163 182	7 457
14/08/2026	JPY	ARGO GRAPHICS INC (TYO)	0,98	5 000	53 197	2 396
14/08/2026	JPY	ARIAKE JAPAN CO LTD	0,98	800	35 680	72
14/08/2026	JPY	ARTIENCE CO LTD	0,98	200	7 113	502
14/08/2026	JPY	AS ONE CORP	0,98	700	13 246	573
14/08/2026	JPY	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD (TYO)	0,98	102 400	1 337 486	64 991
14/08/2026	JPY	ASAHI INTECC CO LTD	0,98	57 600	1 829 344	98 675
14/08/2026	JPY	ASTELLAS PHARMA INC (TYO)	0,98	111 000	2 073 239	30 727
14/08/2026	JPY	AUTOBACS SEVEN CO LTD	0,98	(4 900)	63 081	270
14/08/2026	JPY	AXIAL RETAILING INC	0,98	1 600	15 543	207
14/08/2026	JPY	AZBIL CORP	0,98	25 700	346 220	42 741
14/08/2026	JPY	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	0,98	68 900	2 207 312	90 798
14/08/2026	JPY	BAYCURRENT INC	0,98	8 600	416 210	36 013
14/08/2026	JPY	BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC	0,98	(4 200)	50 771	1 205
14/08/2026	JPY	BRIDGESTONE CORP	0,98	72 000	2 134 091	39 509
14/08/2026	JPY	BUNKA SHUTTER CO LTD	0,98	4 600	75 198	3 030
14/08/2026	JPY	C UYEMURA & CO LTD	0,98	600	126 521	18 791
14/08/2026	JPY	CALBEE INC	0,98	1 700	42 235	2 411
14/08/2026	JPY	CANON MARKETING JAPAN INC (TYO)	0,98	4 500	132 752	2 229
14/08/2026	JPY	CASIO COMPUTER CO LTD	0,98	8 900	135 938	14 443
14/08/2026	JPY	CENTRAL AUTOMOTIVE PRODUCTS	0,98	2 600	46 066	504
14/08/2026	JPY	CENTRAL GLASS CO LTD (TYO)	0,98	1 700	60 315	5 173
14/08/2026	JPY	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO (TYO)	0,98	51 200	1 503 723	51 375
14/08/2026	JPY	CHIYODA CORP	0,98	(7 100)	43 874	2 286
14/08/2026	JPY	CHUBU ELECTRIC POWER CO INC (TYO)	0,98	43 300	1 061 579	104 457
14/08/2026	JPY	CHUDENKO CORP	0,98	400	17 945	1 135

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	CHUGOKU MARINE PAINTS LTD	0,98	(400)	11 765	8
14/08/2026	JPY	CITIZEN WATCH CO LTD	0,98	4 500	85 582	9 659
14/08/2026	JPY	COCA-COLA BOTTLERS JAPAN HOL	0,98	2 700	86 415	15 327
14/08/2026	JPY	COMSYS HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	200	9 264	347
14/08/2026	JPY	CREATE RESTAURANTS HOLDINGS	0,98	4 100	25 514	785
14/08/2026	JPY	CREATE SD HOLDINGS CO	0,98	1 100	31 394	151
14/08/2026	JPY	CURVES HOLDINGS CO LTD	0,98	4 000	30 583	1 405
14/08/2026	JPY	DAI NIPPON PRINTING CO LTD (TYO)	0,98	39 000	875 484	136 171
14/08/2026	JPY	DAICEL CORP	0,98	800	9 070	607
14/08/2026	JPY	DAI-DAN CO LTD	0,98	6 100	131 664	22 917
14/08/2026	JPY	DAIDO STEEL CO LTD (TYO)	0,98	2 400	48 074	10 118
14/08/2026	JPY	DAIHEN CORP (TYO)	-	700	91 460	18 498
14/08/2026	JPY	DAI-CHI LIFE HOLDINGS INC	0,98	57 800	884 599	25 864
14/08/2026	JPY	DAI-CHIKOSHO CO LTD	0,98	1 800	26 598	810
14/08/2026	JPY	DAIKIN INDUSTRIES LTD (TYO)	0,98	1 500	301 507	23 247
14/08/2026	JPY	DAIKOKUTENBUSSAN CO LTD	0,98	(1 600)	61 166	1 389
14/08/2026	JPY	DAISHI HOKUETSU FINANCIAL GR	0,98	400	7 345	80
14/08/2026	JPY	DAITO TRUST CONSTRUCT CO LTD (TYO)	0,98	400	10 725	96
14/08/2026	JPY	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD (TYO)	0,98	800	30 123	1 932
14/08/2026	JPY	DAIWA HOUSE REIT INVESTMENT	0,98	92	95 955	660
14/08/2026	JPY	DAIWA OFFICE INVESTMENT CORP	0,98	30	83 919	3 358
14/08/2026	JPY	DAIWA SECURITIES LIVING INVE	0,98	60	52 577	690
14/08/2026	JPY	DENA CO LTD	0,98	(5 200)	121 202	9 451
14/08/2026	JPY	DENKA CO LTD	0,98	300	10 549	905
14/08/2026	JPY	DENSO CORP	0,98	47 000	762 754	5 770
14/08/2026	JPY	DENTSU GROUP INC	0,98	66 300	1 776 498	13 020
14/08/2026	JPY	DENTSU SOKEN INC	0,98	3 500	61 707	4 217
14/08/2026	JPY	DIGITAL ARTS INC (TYO)	0,98	2 500	77 788	3 138
14/08/2026	JPY	DIP CORP	0,98	5 600	84 947	6 024
14/08/2026	JPY	DOUTOR NICHIRE HOLDINGS CO	0,98	1 200	28 038	335
14/08/2026	JPY	DOWA HOLDINGS CO LTD	0,98	(1 200)	98 210	7 509
14/08/2026	JPY	DTS CORP	0,98	3 900	33 392	1 003
14/08/2026	JPY	DUSKIN CO LTD	0,98	1 400	52 359	1 575
14/08/2026	JPY	DYDO GROUP HOLDINGS INC	0,98	4 200	93 183	4 445
14/08/2026	JPY	EAST JAPAN RAILWAY CO (TYO)	0,98	52 400	1 556 803	14 845
14/08/2026	JPY	EIKEN CHEMICAL CO LTD	0,98	(2 800)	65 983	3 805
14/08/2026	JPY	ELECOM CO LTD (TYO)	0,98	5 200	79 424	3 061
14/08/2026	JPY	EXEO GROUP INC	0,98	600	14 139	468
14/08/2026	JPY	FANUC CORP (TYO)	0,98	32 700	1 983 560	127 795
14/08/2026	JPY	FCC CO LTD	0,98	600	17 753	572
14/08/2026	JPY	FINANCIAL PARTNERS GROUP	0,98	4 000	52 333	1 526
14/08/2026	JPY	FP CORP	0,98	3 300	72 726	1 910
14/08/2026	JPY	FREEE KK	0,98	500	8 086	610
14/08/2026	JPY	FUJII ELECTRIC CO LTD (TYO)	0,98	(9 900)	1 167 788	972
14/08/2026	JPY	FUJII KYUKO CO LTD	0,98	2 200	46 084	3 385
14/08/2026	JPY	FUJII MEDIA HOLDINGS INC	0,98	(1 600)	56 487	1 636
14/08/2026	JPY	FUJII SEAL INTERNATIONAL INC	0,98	300	6 999	403
14/08/2026	JPY	FUJITA KANKO INC	0,98	2 700	41 405	3 327

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	0,98	7 000	419 544	1 590
14/08/2026	JPY	FUKUYAMA TRANSPORTING CO LTD	0,98	(300)	16 470	1 999
14/08/2026	JPY	FUNAI SOKEN HOLDINGS INC	0,98	16 500	155 532	863
14/08/2026	JPY	FURUKAWA CO LTD (TYO)	0,98	(1 200)	39 014	1 466
14/08/2026	JPY	FUSO CHEMICAL CO LTD	0,98	4 400	151 116	21 477
14/08/2026	JPY	GENKY DRUGSTORES CO LTD	0,98	(900)	26 747	205
14/08/2026	JPY	GLOBAL ONE REIT	0,98	101	96 968	2 068
14/08/2026	JPY	GLORY LTD	0,98	1 900	65 072	488
14/08/2026	JPY	GLP J-REIT (TYO)	0,98	36	42 009	1 099
14/08/2026	JPY	GOLDCREST CO LTD (TYO)	0,98	(3 800)	111 273	2 100
14/08/2026	JPY	GUNZE LTD (TYO)	0,98	1 500	50 339	2 732
14/08/2026	JPY	H.U. GROUP HOLDINGS INC	0,98	(2 800)	82 895	2 419
14/08/2026	JPY	H2O RETAILING CORP	0,98	1 600	36 685	3 121
14/08/2026	JPY	HAMAKYOREX CO LTD (TYO)	0,98	(1 500)	24 259	214
14/08/2026	JPY	HANWA CO LTD (TYO)	0,98	7 900	117 561	230
14/08/2026	JPY	HAZAMA ANDO CORP	0,98	1 100	16 734	814
14/08/2026	JPY	HEIWA CORP	0,98	(2 800)	51 027	1 327
14/08/2026	JPY	HEIWA REAL ESTATE CO LTD (TYO)	0,98	(400)	8 431	30
14/08/2026	JPY	HEIWA REAL ESTATE REIT INC (TYO)	0,98	49	57 693	1 194
14/08/2026	JPY	HIKARI TSUSHIN INC	0,98	(1 700)	537 736	8 744
14/08/2026	JPY	HIOKI E E CORP	0,98	600	63 417	835
14/08/2026	JPY	HIROGIN HOLDINGS INC	0,98	1 300	23 617	172
14/08/2026	JPY	HITACHI CONSTRUCTION MACHINE	0,98	(2 000)	92 569	916
14/08/2026	JPY	HOKURIKU ELECTRIC POWER CO	0,98	3 200	24 137	478
14/08/2026	JPY	HOKUTO CORP	0,98	3 000	49 697	61
14/08/2026	JPY	HORIBA LTD (TYO)	0,98	300	66 625	5 391
14/08/2026	JPY	HOSHIZAKI CORP	0,98	9 700	440 662	11 328
14/08/2026	JPY	HOUSE FOODS GROUP INC	0,98	3 700	113 867	8 299
14/08/2026	JPY	HULIC REIT INC (TYO)	0,98	30	40 349	254
14/08/2026	JPY	ICHIGO INC	0,98	(18 100)	69 667	190
14/08/2026	JPY	ICHIGO OFFICE REIT INVESTMEN	0,98	70	57 063	1 044
14/08/2026	JPY	IIDA GROUP HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	16 200	306 681	7 318
14/08/2026	JPY	IINO KAIUN KAISHA LTD	0,98	(2 300)	29 027	396
14/08/2026	JPY	INABA DENKI SANGYO CO LTD	0,98	3 700	86 999	2 225
14/08/2026	JPY	INABATA & CO LTD	0,98	800	26 847	204
14/08/2026	JPY	INFOMART CORP (TYO)	0,98	14 300	45 431	2 790
14/08/2026	JPY	INFRONEER HOLDINGS INC	0,98	1 500	33 600	1 434
14/08/2026	JPY	INPEX CORP	0,98	(11 500)	357 222	24 573
14/08/2026	JPY	INTERNET INITIATIVE JAPAN (TYO)	0,98	2 200	57 057	4 576
14/08/2026	JPY	ITOCHU ENEX CO LTD	0,98	700	12 219	144
14/08/2026	JPY	IZUMI CO LTD (TYO)	0,98	7 000	57 797	834
14/08/2026	JPY	J FRONT RETAILING CO LTD	0,98	300	6 270	3 194
14/08/2026	JPY	JAC RECRUITMENT CO LTD	0,98	13 500	101 096	1 392
14/08/2026	JPY	JAFCO GROUP CO LTD	0,98	1 000	19 524	1 139
14/08/2026	JPY	JAPAN AIRLINES CO LTD	0,98	59 500	1 363 717	137 156
14/08/2026	JPY	JAPAN ELEVATOR SERVICE HOLDI	0,98	3 600	50 807	4 343
14/08/2026	JPY	JAPAN HOTEL REIT INVESTMENT (TYO)	0,98	114	76 714	2 074
14/08/2026	JPY	JAPAN LIFELINE CO LTD	0,98	600	6 949	77

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	JAPAN LOGISTICS FUND INC (TYO)	0,98	22	17 857	338
14/08/2026	JPY	JAPAN MATERIAL CO LTD	0,98	5 300	104 867	15 418
14/08/2026	JPY	FONDS MÉTROPOLITAIN DU JAPON INVE	0,98	131	127 828	154
14/08/2026	JPY	JAPAN PETROLEUM EXPLORATION	0,98	(4 200)	60 778	2 107
14/08/2026	JPY	JAPAN POST INSURANCE CO LTD	0,98	18 000	242 021	116
14/08/2026	JPY	JAPAN PRIME REALTY INVESTMEN(TYO)	0,98	129	106 511	545
14/08/2026	JPY	JINS HOLDINGS INC	0,98	(700)	53 642	4 489
14/08/2026	JPY	JOYFUL HONDA CO LTD	0,98	400	7 852	169
14/08/2026	JPY	KAGA ELECTRONICS CO LTD	0,98	(1 400)	54 681	3 332
14/08/2026	JPY	KAJIMA CORP	0,98	24 300	1 170 946	87 686
14/08/2026	JPY	KAKEN PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	(3 200)	107 808	489
14/08/2026	JPY	KAMEDA SEIKA CO LTD	0,98	(3 900)	42 855	703
14/08/2026	JPY	KAMIGUMI CO LTD	0,98	2 500	104 125	9 012
14/08/2026	JPY	KANDENKO CO LTD	0,98	5 500	277 126	45 312
14/08/2026	JPY	KANEKA CORP	0,98	200	9 719	211
14/08/2026	JPY	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	0,98	19 100	386 087	1 095
14/08/2026	JPY	KAO CORP (TYO)	0,98	61 200	1 614 205	123 630
14/08/2026	JPY	KATAKURA INDUSTRIES CO LTD	0,98	1 900	39 186	878
14/08/2026	JPY	KDDI CORP (TYO)	0,98	33 700	814 452	12 855
14/08/2026	JPY	KDX REALTY INVESTMENT CORP	0,98	5	6 878	36
14/08/2026	JPY	KEIKYU CORP	0,98	5 900	76 624	154
14/08/2026	JPY	KEIYO BANK LTD/THE	0,98	(2 900)	63 885	677
14/08/2026	JPY	KEWPIE CORP (TYO)	0,98	3 700	135 116	6 605
14/08/2026	JPY	KINDEN CORP (TYO)	0,98	6 800	411 674	60 508
14/08/2026	JPY	KIRIN HOLDINGS CO LTD	0,98	111 000	2 635 630	116 309
14/08/2026	JPY	KISSEI PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	3 800	129 514	8 918
14/08/2026	JPY	KIYO BANK LTD/THE (TYO)	0,98	(500)	19 703	231
14/08/2026	JPY	KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD	0,98	1 600	20 430	1 517
14/08/2026	JPY	KOMEDA HOLDINGS CO LTD	0,98	1 600	38 263	461
14/08/2026	JPY	KOMERI CO LTD	0,98	1 000	31 028	175
14/08/2026	JPY	KONAMI GROUP CORP	0,98	(5 100)	843 514	57 665
14/08/2026	JPY	KONOIKE TRANSPORT CO LTD	0,98	3 200	73 455	3 419
14/08/2026	JPY	KOTOBUKI SPIRITS CO LTD	0,98	600	12 267	914
14/08/2026	JPY	KUREHA CORP	0,98	2 100	69 008	1 602
14/08/2026	JPY	KUSURI NO AOKI HOLDINGS CO L	0,98	(200)	6 652	282
14/08/2026	JPY	KYB CORP	0,98	200	6 738	117
14/08/2026	JPY	KYORIN PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	2 800	28 104	102
14/08/2026	JPY	KYOTO FINANCIAL GROUP INC	0,98	8 100	315 448	1 794
14/08/2026	JPY	KYOWA KIRIN CO LTD	0,98	35 100	735 396	65 626
14/08/2026	JPY	KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	0,98	25 200	360 159	3 564
14/08/2026	JPY	LASALLE LOGIPORT REIT	0,98	48	60 998	77
14/08/2026	JPY	LEOPALACE21 CORP (TYO)	0,98	8 000	43 151	2 621
14/08/2026	JPY	LIFE CORP (TYO)	0,98	4 600	105 270	451
14/08/2026	JPY	LIFENET INSURANCE CO (TYO)	0,98	(3 600)	51 310	2 457
14/08/2026	JPY	LINTEC CORP	0,98	1 400	70 138	16 375
14/08/2026	JPY	LION CORP	0,98	3 000	43 766	1 462
14/08/2026	JPY	LITALICO INC	0,98	(1 500)	20 685	21
14/08/2026	JPY	LY CORP	0,98	51 200	179 776	13 747

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	MABUCHI MOTOR CO LTD	0,98	13 200	175 521	7 926
14/08/2026	JPY	MAKITA CORP (TYO)	0,98	7 500	358 785	27 380
14/08/2026	JPY	MANI INC	0,98	1 800	26 472	573
14/08/2026	JPY	MARUHA NICHIRO CORP	0,98	2 400	27 074	812
14/08/2026	JPY	MARUICHI STEEL TUBE LTD (TYO)	0,98	6 600	93 118	15 954
14/08/2026	JPY	MARUZEN SHOWA UNYU CO LTD	0,98	400	25 660	249
14/08/2026	JPY	MATSUDA SANGYO CO LTD	0,98	(900)	47 524	2 251
14/08/2026	JPY	MATSUKIYOCOCOKARA & CO	0,98	22 800	464 460	16 033
14/08/2026	JPY	MAX CO LTD (TYO)	0,98	3 100	44 562	2 063
14/08/2026	JPY	MEBUKI FINANCIAL GROUP INC	-	14 400	176 656	626
14/08/2026	JPY	MEIJI HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	17 500	569 259	7 862
14/08/2026	JPY	MEITEC GROUP HOLDINGS INC	0,98	2 700	71 804	3 636
14/08/2026	JPY	METAWATER CO LTD	0,98	3 600	98 818	5 492
14/08/2026	JPY	MIRAIT ONE CORP	0,98	300	9 890	292
14/08/2026	JPY	MIRARTH REAL ESTATE INVESTME	0,98	(86)	62 525	490
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI CHEMICAL GROUP CO	0,98	112 600	1 061 881	45 621
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES	-	49 400	1 526 600	52 523
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI LOGISTICS CORP	0,98	1 200	14 920	1 411
14/08/2026	JPY	mitsui & co ltd	0,98	(16 900)	720 697	57 827
14/08/2026	JPY	mitsui chemicals inc	0,98	66 200	1 190 312	56 921
14/08/2026	JPY	mitsui dm sugar co ltd	0,98	900	25 372	304
14/08/2026	JPY	mitsui e&s co ltd	0,98	(1 200)	43 539	185
14/08/2026	JPY	mitsui fudosan logistics par	0,98	7	6 470	106
14/08/2026	JPY	mitsui kinzoku co ltd	0,98	(2 200)	842 946	22 663
14/08/2026	JPY	mitsui osk lines ltd	0,98	(51 200)	2 576 214	199 328
14/08/2026	JPY	MIURA CO LTD	0,98	4 500	122 462	2 318
14/08/2026	JPY	MIZUNO CORP	0,98	900	26 393	130
14/08/2026	JPY	MOCHIDA PHARMACEUTICAL CO	0,98	1 800	50 273	332
14/08/2026	JPY	MONEX GROUP INC	0,98	(9 100)	50 514	985
14/08/2026	JPY	MONEY FORWARD INC	0,98	1 000	33 760	4 339
14/08/2026	JPY	MONOTARO CO LTD	0,98	13 700	216 906	6 565
14/08/2026	JPY	MORI HILLS REIT INVESTMENT C	0,98	7	7 808	37
14/08/2026	JPY	MORI TRUST REIT INC	0,98	51	32 672	352
14/08/2026	JPY	MORITA HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	2 000	42 191	41
14/08/2026	JPY	MOS FOOD SERVICES INC	0,98	1 800	57 186	263
14/08/2026	JPY	MURATA MANUFACTURING CO LTD (TYO)	0,98	18 200	1 377 979	431 325
14/08/2026	JPY	MUSASHI SEIMITSU INDUSTRY CO	0,98	(1 300)	55 427	11 055
14/08/2026	JPY	NABTESCO CORP	0,98	2 200	91 572	7 700
14/08/2026	JPY	NACHI-FUJIKOSHI CORP	0,98	200	9 618	717
14/08/2026	JPY	NAGASE & CO LTD (TYO)	0,98	10 200	102 958	695
14/08/2026	JPY	NAGAWA CO LTD	0,98	200	8 292	554
14/08/2026	JPY	NAGOYA RAILROAD CO LTD	0,98	1 500	24 063	534
14/08/2026	JPY	NAMURA SHIPBUILDING CO LTD	0,98	1 000	30 941	83
14/08/2026	JPY	NICHIAS CORP	0,98	300	9 573	824
14/08/2026	JPY	NICHICON CORP (TYO)	0,98	2 000	67 991	4 438
14/08/2026	JPY	NICHIHA CORP (TYO)	0,98	1 200	31 326	1 056
14/08/2026	JPY	NICHIREI CORP (TYO)	0,98	6 400	119 007	3 302
14/08/2026	JPY	NIFCO INC	0,98	600	22 377	3 231

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	NIHON KOHDEN CORP	0,98	1 200	14 150	934
14/08/2026	JPY	NIHON PARKERIZING CO LTD	0,98	(500)	7 816	320
14/08/2026	JPY	NIPPON BUILDING FUND INC (TYO)	0,98	10	10 788	378
14/08/2026	JPY	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	0,98	1 500	79 416	7 106
14/08/2026	JPY	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	0,98	25 100	1 109 818	3 396
14/08/2026	JPY	NIPPON GAS CO LTD (TYO)	0,98	1 100	26 690	1 230
14/08/2026	JPY	NIPPON KANZAI HOLDINGS CO LTD	0,98	(1 300)	30 420	211
14/08/2026	JPY	NIPPON PAPER INDUSTRIES CO L	0,98	12 200	129 694	6 768
14/08/2026	JPY	NIPPON SHOKUBAI CO LTD	0,98	2 000	36 204	1 101
14/08/2026	JPY	NISHIMATSU CONSTRUCTION CO	0,98	(1 900)	88 985	157
14/08/2026	JPY	NISHI-NIPPON FINANCIAL HOLDI	0,98	400	14 555	96
14/08/2026	JPY	NISHI-NIPPON RAILROAD CO LTD	0,98	1 500	37 109	1 535
14/08/2026	JPY	NISHIO HOLDINGS CO LTD	0,98	2 500	85 098	310
14/08/2026	JPY	NISSAN CHEMICAL CORP	0,98	26 300	1 725 951	240 248
14/08/2026	JPY	NISSAN SHATAI CO LTD	0,98	1 500	12 293	191
14/08/2026	JPY	NISSHINBO HOLDINGS INC (TYO)	0,98	4 700	86 494	15 545
14/08/2026	JPY	NISSUI CORP	0,98	3 200	35 764	44
14/08/2026	JPY	NITTETSU MINING CO LTD	0,98	(4 500)	91 513	778
14/08/2026	JPY	NOEVIR HOLDING CO	0,98	700	26 424	358
14/08/2026	JPY	NOK CORP	0,98	900	22 595	559
14/08/2026	JPY	NOMURA REAL ESTATE MASTER FU	0,98	59	77 603	450
14/08/2026	JPY	NORITSU KOKI CO LTD	0,98	3 500	59 507	2 999
14/08/2026	JPY	NORITZ CORP	0,98	1 000	19 498	775
14/08/2026	JPY	NTT UD REIT INVESTMENT CORP	0,98	37	42 530	2 303
14/08/2026	JPY	OBAYASHI CORP	0,98	39 900	1 080 112	63 714
14/08/2026	JPY	OBIC BUSINESS CONSULTANTS (TYO)	0,98	1 600	81 694	3 842
14/08/2026	JPY	OGAKI KYORITSU BANK LTD/THE (TYO)	0,98	(1 100)	70 758	630
14/08/2026	JPY	OHSHO FOOD SERVICE CORP	0,98	2 200	52 823	2 305
14/08/2026	JPY	OJI HOLDINGS CORP	0,98	76 500	528 181	2 170
14/08/2026	JPY	OKAMOTO INDUSTRIES INC	0,98	(200)	9 950	674
14/08/2026	JPY	OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD (TYO)	0,98	1 800	46 691	8 370
14/08/2026	JPY	OKUMURA CORP	0,98	300	14 768	366
14/08/2026	JPY	OLYMPUS CORP	0,98	(94 200)	1 400 162	4 200
14/08/2026	JPY	OMRON CORP (TYO)	0,98	3 100	148 541	9 048
14/08/2026	JPY	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	24 000	466 836	36 619
14/08/2026	JPY	ORACLE CORP JAPAN	-	(2 100)	154 973	791
14/08/2026	JPY	ORIENTAL LAND CO LTD	0,98	41 300	816 272	81 858
14/08/2026	JPY	ORIX CORP	0,98	23 000	1 222 927	9 602
14/08/2026	JPY	ORIX JREIT INC	0,98	72	59 825	1 355
14/08/2026	JPY	OSAKA STEEL CO LTD	0,98	(1 000)	20 389	421
14/08/2026	JPY	OSG CORP (TYO)	0,98	1 400	41 203	3 540
14/08/2026	JPY	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	0,98	5 200	462 931	29 921
14/08/2026	JPY	PAL GROUP HOLDINGS CO LTD	0,98	4 300	53 443	1 721
14/08/2026	JPY	PANASONIC HOLDINGS CORP	0,98	49 200	1 691 518	239 547
14/08/2026	JPY	PARK24 CO LTD	0,98	5 200	82 148	9 078
14/08/2026	JPY	PIGEON CORP	0,98	2 200	38 269	2 088
14/08/2026	JPY	POLA ORBIS HOLDINGS INC	0,98	4 500	49 527	844
14/08/2026	JPY	RAKUS CO LTD	0,98	2 700	20 926	1 463

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	RAKUTEN BANK LTD	0,98	(32 000)	1 469 090	26 103
14/08/2026	JPY	RAKUTEN GROUP INC	0,98	378 900	2 448 455	39 523
14/08/2026	JPY	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	0,98	18 200	1 713 979	84 686
14/08/2026	JPY	RELO GROUP INC	0,98	5 300	84 005	11 062
14/08/2026	JPY	RESONAC HOLDINGS CORP	0,98	4 400	656 730	22 531
14/08/2026	JPY	RESORTTRUST INC (TYO)	0,98	7 200	108 056	2 084
14/08/2026	JPY	RICOH CO LTD	0,98	(19 600)	245 996	2 387
14/08/2026	JPY	RICOH LEASING CO LTD	0,98	500	27 057	59
14/08/2026	JPY	ROHM CO LTD	0,98	34 100	1 499 021	102 532
14/08/2026	JPY	RORZE CORP (TYO)	0,98	800	29 103	4 645
14/08/2026	JPY	RS TECHNOLOGIES CO LTD	0,98	600	34 563	3 504
14/08/2026	JPY	S FOODS INC	0,98	300	6 873	34
14/08/2026	JPY	SAKAI MOVING SERVICE CO LTD (TYO)	0,98	2 000	49 173	2 598
14/08/2026	JPY	SAMTY RESIDENTIAL INVESTMENT (TYO)	0,98	(44)	37 059	102
14/08/2026	JPY	SAN-AI OBBLI CO LTD	0,98	2 700	49 087	1 151
14/08/2026	JPY	SANGETSU CORP	0,98	3 700	93 296	4 628
14/08/2026	JPY	SANKI ENGINEERING CO LTD	0,98	3 000	64 674	13 655
14/08/2026	JPY	SANKYO CO LTD	0,98	1 600	22 302	266
14/08/2026	JPY	SANKYU INC	0,98	400	29 930	545
14/08/2026	JPY	SANSAN INC	0,98	10 200	127 751	10 513
14/08/2026	JPY	SANWA HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	26 300	830 495	50 272
14/08/2026	JPY	SANYO DENKI CO LTD	0,98	1 300	71 255	3 320
14/08/2026	JPY	SBS HOLDINGS INC (TYO)	0,98	(200)	7 899	363
14/08/2026	JPY	SCSK CORP	0,98	(13 000)	644 473	428
14/08/2026	JPY	SEIBU HOLDINGS INC	0,98	23 300	608 864	39 790
14/08/2026	JPY	SEIKO GROUP CORP	0,98	2 000	122 191	19 129
14/08/2026	JPY	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	0,98	15 100	313 863	31 927
14/08/2026	JPY	SEKISUI HOUSE LTD (TYO)	0,98	29 500	846 835	22 672
14/08/2026	JPY	SENSHU ELECTRIC CO LTD	0,98	900	53 886	1 648
14/08/2026	JPY	SEPTENI HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	(6 200)	25 974	1 409
14/08/2026	JPY	SERIA CO LTD	0,98	2 100	65 159	2 025
14/08/2026	JPY	SHIFT INC	0,98	4 100	23 092	991
14/08/2026	JPY	SHIMANO INC (TYO)	0,98	3 300	483 014	20 530
14/08/2026	JPY	SHIMIZU CORP (TYO)	0,98	79 900	1 716 213	86 481
14/08/2026	JPY	SHIN NIPPON AIR TECHNOLOGIES	0,98	800	23 007	3 263
14/08/2026	JPY	SHIP HEALTHCARE HOLDINGS INC (TYO)	0,98	4 400	81 510	3 622
14/08/2026	JPY	SHISEIDO CO LTD	0,98	17 500	398 191	5 195
14/08/2026	JPY	SHO-BOND HOLDINGS CO LTD	0,98	2 400	26 592	2
14/08/2026	JPY	SHOCHIKU CO LTD (TYO)	0,98	800	72 756	591
14/08/2026	JPY	SHOWA SANGYO CO LTD	0,98	2 100	60 760	2 357
14/08/2026	JPY	SKYLARK HOLDINGS CO LTD	0,98	21 400	514 201	10 259
14/08/2026	JPY	SMC CORP	0,98	600	343 061	31 925
14/08/2026	JPY	SMS CO LTD (TYO)	-	3 700	65 168	5 526
14/08/2026	JPY	SOFTBANK GROUP CORP (TYO)	0,98	(20 700)	1 169 288	91 036
14/08/2026	JPY	SONY FINANCIAL GROUP INC	0,98	524 800	648 131	5 448
14/08/2026	JPY	STAR ASIA INVESTMENT CORPORA	0,98	39	18 653	41
14/08/2026	JPY	STARTS CORP INC	0,98	1 100	43 347	775
14/08/2026	JPY	SUMITOMO BAKELITE CO LTD	0,98	1 300	73 524	11 538

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	0,98	32 800	785 115	57 582
14/08/2026	JPY	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	0,98	(13 700)	1 032 872	129 114
14/08/2026	JPY	GROUPE SUMITOMO MITSUI TRUST	0,98	51 500	2 679 409	81 687
14/08/2026	JPY	SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD	0,98	1 500	73 590	6 486
14/08/2026	JPY	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMENT	0,98	800	24 920	1 488
14/08/2026	JPY	SUN CORP	0,98	(1 000)	76 631	1 382
14/08/2026	JPY	SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD	0,98	15 300	572 877	33 969
14/08/2026	JPY	TADANO LTD	0,98	1 500	16 601	163
14/08/2026	JPY	TAIKISHA LTD	0,98	2 200	86 599	9 033
14/08/2026	JPY	TAKARA STANDARD CO LTD	0,98	1 900	49 202	3 114
14/08/2026	JPY	TAKASAGO INTERNATIONAL CORP	0,98	1 900	18 557	456
14/08/2026	JPY	TAKASAGO THERMAL ENGINEERING	0,98	700	28 000	3 399
14/08/2026	JPY	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	38 900	1 725 429	53 533
14/08/2026	JPY	TAKEUCHI MFG CO LTD (TYO)	0,98	(1 100)	70 854	3 020
14/08/2026	JPY	TAKUMA CO LTD (TYO)	0,98	1 500	45 691	2 270
14/08/2026	JPY	TBS HOLDINGS INC	0,98	2 200	111 119	9 186
14/08/2026	JPY	TERUMO CORP	0,98	54 100	1 038 566	21 362
14/08/2026	JPY	THK CO LTD	0,98	600	37 050	1 667
14/08/2026	JPY	TOAGOSEI CO LTD (TYO)	0,98	500	7 541	180
14/08/2026	JPY	TOTALO CO LTD	0,98	300	7 986	611
14/08/2026	JPY	TODA CORP	0,98	2 400	32 049	2 181
14/08/2026	JPY	TOEI CO LTD	0,98	2 100	104 657	1 438
14/08/2026	JPY	TOENEC CORP	0,98	1 300	23 600	2 335
14/08/2026	JPY	TOKAI HOLDINGS CORP	0,98	7 100	69 653	2 504
14/08/2026	JPY	TOKAI RIKA CO LTD	0,98	1 300	32 791	722
14/08/2026	JPY	TOKEN CORP	0,98	900	95 912	6 090
14/08/2026	JPY	TOKIO MARINE HOLDINGS INC (TYO)	-	(13 300)	841 763	13 415
14/08/2026	JPY	TOKUYAMA CORP	0,98	2 400	98 451	5 024
14/08/2026	JPY	TOKYO CENTURY CORP	0,98	5 400	112 915	5 999
14/08/2026	JPY	TOKYO ELECTRIC POWER COMPANY	0,98	(139 900)	621 876	58 987
14/08/2026	JPY	TOKYO SEIMITSU CO LTD	0,98	200	32 564	2 763
14/08/2026	JPY	TOKYU CONSTRUCTION CO LTD	0,98	5 800	57 811	2 385
14/08/2026	JPY	TOKYU REIT INC	0,98	15	23 893	279
14/08/2026	JPY	TOMY COMPANY LTD (TYO)	0,98	1 900	48 514	4 720
14/08/2026	JPY	TOPRE CORP	0,98	1 800	42 245	64
14/08/2026	JPY	TORIDOLL HOLDINGS CORP	0,98	1 100	36 684	177
14/08/2026	JPY	TOSOH CORP	0,98	16 900	422 078	9 042
14/08/2026	JPY	TOTECH CORP (TYO)	0,98	200	6 651	712
14/08/2026	JPY	TOTETSU KOGYO CO LTD (TYO)	0,98	800	28 872	1 016
14/08/2026	JPY	TOTO LTD (TYO)	0,98	16 000	1 090 005	110 968
14/08/2026	JPY	TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS L	0,98	1 800	61 789	3 322
14/08/2026	JPY	TOYO SUISAN KAISHA LTD	0,98	2 600	226 078	11 461
14/08/2026	JPY	TOYO TANSO CO LTD	0,98	(3 900)	272 653	22 260
14/08/2026	JPY	TOYO TIRE CORP	0,98	200	6 457	143
14/08/2026	JPY	TOYODA GOSEI CO LTD	0,98	1 000	39 948	4 612
14/08/2026	JPY	TOYOTA MOTOR CORP	0,98	(119 400)	2 875 921	38 184
14/08/2026	JPY	TREND MICRO INC (TYO)	0,98	33 800	1 741 302	20 867
14/08/2026	JPY	TRI CHEMICAL LABORATORIES A	0,98	(4 400)	134 987	1 240

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	TSUBAKIMOTO CHAIN CO	0,98	400	8 847	182
14/08/2026	JPY	TSUGAMI CORP	0,98	1 300	75 340	15 672
14/08/2026	JPY	ULVAC INC	0,98	100	7 704	1 431
14/08/2026	JPY	U-NEXT HOLDINGS CO LTD	0,98	2 300	32 099	936
14/08/2026	JPY	UNICHARM CORP	0,98	51 900	414 478	17 029
14/08/2026	JPY	UNION TOOL CO (TYO)	0,98	(500)	107 005	8 517
14/08/2026	JPY	UNITED URBAN INVESTMENT CORP (TYO)	0,98	7	9 800	339
14/08/2026	JPY	USHIO INC	0,98	3 300	117 744	13 144
14/08/2026	JPY	USS CO LTD (TYO)	0,98	57 500	941 987	24 130
14/08/2026	JPY	VISIONAL INC	0,98	800	51 607	2 719
14/08/2026	JPY	WACOM CO LTD (TYO)	0,98	(2 300)	17 224	1 756
14/08/2026	JPY	WAKITA & CO LTD	0,98	3 100	45 401	1 311
14/08/2026	JPY	WEST JAPAN RAILWAY CO	0,98	15 300	344 194	25 465
14/08/2026	JPY	YAKULT HONSHA CO LTD (TYO)	0,98	15 700	365 456	10 187
14/08/2026	JPY	YAMAGUCHI FINANCIAL GROUP Å	0,98	(2 900)	73 908	1 681
14/08/2026	JPY	YAMATO HOLDINGS CO LTD	0,98	43 600	679 899	17 227
14/08/2026	JPY	YAMAZAKI BAKING CO LTD (TYO)	0,98	29 600	808 969	18 379
14/08/2026	JPY	YODOKO LTD	0,98	800	8 993	252
14/08/2026	JPY	YOKOGAWA ELECTRIC CORP (TYO)	0,98	23 300	985 896	166 732
14/08/2026	JPY	YOKOHAMA FINANCIAL GROUP INC	0,98	49 900	749 103	4 403
14/08/2026	JPY	YONEX CO LTD	0,98	(1 700)	34 571	122
14/08/2026	JPY	ZENKOKU HOSHO CO LTD	0,98	4 200	105 060	8 796
14/08/2026	JPY	ZENSHO HOLDINGS CO LTD	0,98	8 500	588 086	9 371
14/08/2026	JPY	ZEON CORP	0,98	3 400	67 184	3 667
14/08/2026	JPY	ZOZO INC	0,98	60 500	574 509	31 350
14/08/2026	JPY	ZUKEN INC	0,98	1 200	47 236	2 231
14/08/2026	JPY	AICHI STEEL CORP (TYO)	0,98	2 300	59 982	156
14/08/2026	JPY	AIR WATER INC	0,98	2 200	46 871	6 185
14/08/2026	JPY	AOZORA BANK LTD	0,98	(2 200)	52 699	604
14/08/2026	JPY	ARCHION CORP	0,98	9 200	22 804	362
14/08/2026	JPY	AWA BANK LTD/THE (TYO)	0,98	200	12 202	428
14/08/2026	JPY	COSMO ENERGY HOLDINGS CO LTD	0,98	2 900	90 386	5 363
14/08/2026	JPY	DAIEI KANKYO CO LTD	0,98	(3 500)	117 151	1 320
14/08/2026	JPY	DAIWABO HOLDINGS CO LTD	0,98	900	26 794	281
14/08/2026	JPY	DIC CORP	0,98	2 900	121 949	1 265
14/08/2026	JPY	HANKYU HANSHIN REIT INC	0,98	25	30 592	291
14/08/2026	JPY	HASEKO CORP	0,98	600	14 092	789
14/08/2026	JPY	HONDA MOTOR CO LTD (TYO)	0,98	27 500	338 667	15 924
14/08/2026	JPY	HYAKUJUSHI BANK LTD/THE	0,98	2 200	48 407	584
14/08/2026	JPY	INTEGRAL CORP	0,98	(2 200)	56 932	3 702
14/08/2026	JPY	ITO EN LTD	0,98	300	7 427	320
14/08/2026	JPY	JUOKU FINANCIAL GROUP INC	0,98	3 500	67 114	4 026
14/08/2026	JPY	JX ADVANCED METALS CORP	0,98	800	24 836	5 823
14/08/2026	JPY	KATITAS CO LTD	0,98	(1 900)	55 885	1 115
14/08/2026	JPY	KIOXIA HOLDINGS CORP	-	700	546 269	1 256
14/08/2026	JPY	KOSE HOLDINGS CORP	0,98	(4 200)	192 012	5 564
14/08/2026	JPY	KURITA WATER INDUSTRIES LTD (TYO)	0,98	700	51 217	4 611
14/08/2026	JPY	LIXIL CORP	0,98	1 300	19 527	924

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	MIRAI INDUSTRY CO LTD (TYO)	0,98	300	7 986	86
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO	0,98	1 100	47 073	1 550
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI MOTORS CORP (TYO)	0,98	(12 000)	33 819	1 096
14/08/2026	JPY	MITSUMI HIGH-TEC INC	0,98	3 000	21 157	3 758
14/08/2026	JPY	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDING (TYO)	0,98	(9 400)	377 151	29 496
14/08/2026	JPY	NGK CORP	0,98	18 400	1 013 452	196 604
14/08/2026	JPY	NIHON DENGKI CO LTD (TYO)	0,98	1 400	26 980	1 413
14/08/2026	JPY	NIKKON HOLDINGS CO LTD	0,98	(600)	31 159	293
14/08/2026	JPY	NITTO KOGYO CORP (TYO)	0,98	500	18 983	1 796
14/08/2026	JPY	OKAMURA CORP	0,98	1 500	29 457	452
14/08/2026	JPY	PERSOL HOLDINGS CO LTD	0,98	2 800	5 968	74
14/08/2026	JPY	RESONA HOLDINGS INC	0,98	(39 600)	738 556	11 061
14/08/2026	JPY	RIGAKU HOLDINGS CORP	0,98	(2 000)	43 867	102
14/08/2026	JPY	SANBIO CO LTD	0,98	(1 200)	12 579	1 975
14/08/2026	JPY	SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	800	13 431	1 453
14/08/2026	JPY	SENSHU IKEDA HOLDINGS INC	0,98	(2 000)	17 613	552
14/08/2026	JPY	SHINNIHON CORP	0,98	(1 100)	21 515	1 713
14/08/2026	JPY	SUMCO CORP (TYO)	0,98	2 900	92 461	9 599
14/08/2026	JPY	SYNSPECTIVE INC	0,98	(4 800)	65 020	12 092
14/08/2026	JPY	TAIHEI DENGYO KAISHA LTD	0,98	(1 800)	41 271	1 210
14/08/2026	JPY	TAIHEIYO CEMENT CORP (TYO)	0,98	(1 000)	36 666	2 017
14/08/2026	JPY	TAIYO YUDEN CO LTD	0,98	1 000	137 247	38 363
14/08/2026	JPY	TAMA HOME CO LTD	0,98	300	7 766	354
14/08/2026	JPY	TECHNO RYOWA LTD	0,98	1 200	57 709	2 108
14/08/2026	JPY	TKC CORP	0,98	2 100	62 867	135
14/08/2026	JPY	TOA CORP	0,98	(500)	9 212	181
14/08/2026	JPY	TOKYO ELECTRON LTD	0,98	1 300	862 503	11 256
14/08/2026	JPY	TOKYO STEEL MFG CO LTD	0,98	(1 600)	23 977	462
14/08/2026	JPY	TOSEI CORP (TYO)	0,98	4 600	62 873	5 039
14/08/2026	JPY	TOYO ENGINEERING CORP	0,98	1 300	21 762	1 108
14/08/2026	JPY	TSURUHA HOLDINGS INC	0,98	(4 500)	81 654	875
14/08/2026	JPY	VALOR HOLDINGS CO LTD	0,98	400	12 813	771
14/08/2026	JPY	WACOAL HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	(1 700)	68 460	3 215
14/08/2026	JPY	YAMAHA CORP	0,98	3 000	28 868	1 023
05/03/2027	NOK	ATEA ASA	4,25	4 428	107 218	4 571
05/03/2027	NOK	BAKKAFROST P/F (OSL)	4,25	(4 061)	252 818	13 475
05/03/2027	NOK	CADELER A/S	4,25	6 259	49 213	391
05/03/2027	NOK	DNO ASA (OSL)	4,25	(48 769)	134 229	17 186
05/03/2027	NOK	ELKEM ASA	4,25	(7 102)	34 602	1 326
05/03/2027	NOK	ENTRA ASA (OSL)	4,25	1 348	20 544	265
05/03/2027	NOK	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,25	10 000	380 415	10 947
05/03/2027	NOK	HOEGH AUTOLINERS ASA	4,25	(2 687)	63 086	5 829
05/03/2027	NOK	KONGSBERG GRUPPEN ASA (OSL)	4,25	37 339	1 615 976	11 704
05/03/2027	NOK	LEROY SEAFOOD GROUP ASA	4,25	(3 494)	21 423	1 808
05/03/2027	NOK	MPC CONTAINER SHIPS AS	4,25	(7 320)	28 729	1 133
05/03/2027	NOK	NEL ASA	4,25	(76 084)	29 660	1 643
05/03/2027	NOK	NORWEGIAN AIR SHUTTLE AS	4,25	(43 852)	97 634	2 954
05/03/2027	NOK	ORKLA ASA (OSL)	4,25	18 971	278 377	10 321

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
05/03/2027	NOK	SPAREBANK 1 NORD-NORGE (OSL)	4,25	4 496	100 332	257
05/03/2027	NOK	STOREBRAND ASA (OSL)	4,25	4 446	113 148	7 445
05/03/2027	NOK	TOMRA SYSTEMS ASA (OSL)	4,25	(13 787)	193 891	2 170
05/03/2027	NOK	VEND MARKETPLACES ASA CL	4,25	(2 111)	74 445	994
05/03/2027	NOK	AKER BP ASA	4,25	(8 352)	409 662	39 227
05/03/2027	NOK	BW OFFSHORE LTD	4,25	(924)	6 436	483
05/03/2027	NOK	ODFJELL SE-A SHS	4,25	(535)	9 003	790
05/03/2027	NOK	SALMAR ASA (OSL)	-	(259)	17 335	150
13/08/2030	SGD	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,27	8 300	20 970	326
13/08/2030	SGD	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP (SES)	1,27	43 700	1 109 545	65 599
13/08/2030	SGD	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,27	42 500	330 621	24 244
13/08/2030	SGD	SINGAPORE EXCHANGE LTD (SES)	1,27	1 100	25 850	2 842
13/08/2030	SGD	SINGAPORE TECH ENGINEERING (SES)	1,27	(15 700)	179 542	3 028
13/08/2030	SGD	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,27	288 500	1 334 063	42 953
13/08/2030	SGD	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,27	29 100	1 203 319	51 337
13/08/2030	SGD	WILMAR INTERNATIONAL LTD (SES)	1,27	73 300	278 544	8 006
13/08/2030	SGD	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,27	(107 800)	298 290	7 233
13/08/2030	GBP	3I GROUP PLC (LSE)	3,73	1 336	54 717	8 319
13/08/2030	GBP	4IMPRINT GROUP PLC	3,73	98	6 634	73
13/08/2030	GBP	ADMIRAL GROUP PLC	3,73	6 730	430 216	15 523
13/08/2030	GBP	AJ BELL PLC	3,73	5 531	62 194	1 233
13/08/2030	GBP	ASTRAZENCA PLC (LSE)	3,73	4 632	1 162 982	52 178
13/08/2030	GBP	ATALAYA MINING COPPER SA	3,73	10 824	152 898	11 547
13/08/2030	GBP	BABCOCK INTL GROUP PLC	3,73	(13 275)	251 017	16 354
13/08/2030	GBP	BAE SYSTEMS PLC (LSE)	3,73	(36 010)	1 302 733	68 002
13/08/2030	GBP	BALFOUR BEATTY PLC (LSE)	3,73	17 776	266 183	24 056
13/08/2030	GBP	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC (LSE)	3,73	5 080	432 544	9 412
13/08/2030	GBP	BT GROUP PLC (LSE)	3,73	(22 522)	85 132	5 654
13/08/2030	GBP	CHEMRING GROUP PLC (LSE)	3,73	(759)	7 459	231
13/08/2030	GBP	CLOSE BROTHERS GROUP PLC	3,73	(5 242)	43 734	4 265
13/08/2030	GBP	COCA-COLA HBC AG-DI (LSE)	3,73	6 478	546 263	46 941
13/08/2030	GBP	COMPUTACENTER PLC	3,73	1 251	96 347	3 691
13/08/2030	GBP	CRODA INTERNATIONAL PLC (LSE)	3,73	(16 192)	917 315	6 566
13/08/2030	GBP	CURRYS PLC	3,73	3 437	9 640	567
13/08/2030	GBP	CVS GROUP PLC (LSE)	3,73	(2 775)	64 064	3 541
13/08/2030	GBP	DOMINO'S PIZZA GROUP PLC	3,73	(13 861)	50 067	3 402
13/08/2030	GBP	DUNELM GROUP PLC (LSE)	3,73	2 382	34 514	328
13/08/2030	GBP	EASYJET PLC (LSE)	3,73	91 065	810 029	136 708
13/08/2030	GBP	ELEMENTIS PLC (LSE)	3,73	18 008	51 379	127
13/08/2030	GBP	ENDEAVOUR MINING PLC	3,73	19 050	1 298 555	14 326
13/08/2030	GBP	EXPERIAN PLC	3,73	2 184	104 098	650
13/08/2030	GBP	FIRSTGROUP PLC (LSE)	3,73	38 938	124 674	11 429
13/08/2030	GBP	FRASERS GROUP PLC	3,73	(7 644)	109 902	7 729
13/08/2030	GBP	FUTURE PLC (LSE)	3,73	(7 832)	44 954	920
13/08/2030	GBP	GAMES WORKSHOP GROUP PLC (LSE)	3,73	2 647	938 847	125 641
13/08/2030	GBP	GB GROUP PLC (LSE)	3,73	(36 610)	138 930	1 496
13/08/2030	GBP	GENUIT GROUP PLC	3,73	2 169	10 476	704
13/08/2030	GBP	GRAFTON GROUP PLC-UTS -CDI (LSE)	3,73	419	6 539	484

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	GBP	GRENCORE GROUP PLC	3,73	(15 026)	56 433	842
13/08/2030	GBP	GREGGS PLC	3,73	(1 427)	45 398	2 930
13/08/2030	GBP	GSK PLC	3,73	52 433	1 878 778	71 836
13/08/2030	GBP	HAYS PLC	3,73	(29 656)	19 555	2 377
13/08/2030	GBP	HILL & SMITH PLC	3,73	204	10 500	47
13/08/2030	GBP	HILTON FOOD GROUP PLC (LSE)	3,73	825	8 108	178
13/08/2030	GBP	HOWDEN JOINERY GROUP PLC	3,73	21 928	319 565	22 158
13/08/2030	GBP	IBSTOCK PLC	3,73	(36 667)	63 864	1 223
13/08/2030	GBP	ICG PLC	3,73	(9 993)	333 290	9 822
13/08/2030	GBP	IMPERIAL BRANDS PLC (LSE)	3,73	11 534	602 884	4 363
13/08/2030	GBP	INCHCAPE PLC (LSE)	3,73	(22 885)	347 808	9 979
13/08/2030	GBP	INTEGRAFIN HOLDINGS PLC	3,73	5 199	34 272	375
13/08/2030	GBP	INTERNATIONAL WORKPLACE GROUP	3,73	2 713	9 021	316
13/08/2030	GBP	IP GROUP PLC (LSE)	3,73	(23 831)	29 064	25
13/08/2030	GBP	ITV PLC	3,73	(302 011)	465 193	12 510
13/08/2030	GBP	JET2 PLC	3,73	8 068	187 914	5 983
13/08/2030	GBP	JOHNSON SERVICE GROUP PLC	3,73	3 507	9 954	803
13/08/2030	GBP	JUPITER FUND MANAGEMENT (LSE)	3,73	(2 969)	9 335	302
13/08/2030	GBP	KELLER GROUP PLC (LSE)	3,73	922	43 568	2 860
13/08/2030	GBP	KIER GROUP PLC (LSE)	3,73	12 333	45 307	4 785
13/08/2030	GBP	KINGFISHER PLC	3,73	46 220	240 903	10 014
13/08/2030	GBP	LANCASHIRE HOLDINGS LTD	3,73	2 618	30 049	1 392
13/08/2030	GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC (LSE)	3,73	408 840	741 207	104 508
13/08/2030	GBP	MARKS & SPENCER GROUP PLC (LSE)	3,73	10 159	68 674	2 263
13/08/2030	GBP	MITCHELLS & BUTLERS PLC	3,73	3 866	17 338	206
13/08/2030	GBP	MITIE GROUP PLC	3,73	(5 502)	16 478	1 197
13/08/2030	GBP	MOLTEN VENTURES PLC	3,73	(13 753)	163 625	15 241
13/08/2030	GBP	MOONPIG GROUP PLC	3,73	4 330	17 716	1 579
13/08/2030	GBP	MORGAN ADVANCED MATERIALS PL	3,73	(4 899)	20 281	878
13/08/2030	GBP	MORGAN SINDALL GROUP PLC	3,73	91	7 555	772
13/08/2030	GBP	NATWEST GROUP PLC	3,73	85 598	935 707	127 281
13/08/2030	GBP	NEXT 15 GROUP PLC	3,73	(7 880)	38 279	993
13/08/2030	GBP	NEXT PLC (LSE)	3,73	2 511	654 144	25 303
13/08/2030	GBP	OSB GROUP PLC	3,73	678	6 347	199
13/08/2030	GBP	OXFORD NANOPORE TECHNOLOGIES	3,73	(2 823)	6 533	11
13/08/2030	GBP	PAGEGROUP PLC (LSE)	3,73	(6 842)	15 617	2 107
13/08/2030	GBP	PARAGON BANKING GROUP PLC (LSE)	3,73	1 015	13 978	514
13/08/2030	GBP	PEARSON PLC (LSE)	3,73	5 695	122 024	4 698
13/08/2030	GBP	PETS AT HOME GROUP PLC (LSE)	3,73	(12 568)	43 756	1 661
13/08/2030	GBP	PLAYTECH PLC (LSE)	3,73	(4 800)	31 203	2 778
13/08/2030	GBP	POLAR CAPITAL HOLDINGS PLC (LSE)	3,73	720	11 131	808
13/08/2030	GBP	PREMIER FOODS PLC	3,73	1 692	6 506	26
13/08/2030	GBP	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	3,73	33 453	57 112	2 451
13/08/2030	GBP	QUILTER PLC	3,73	24 363	84 594	2 554
13/08/2030	GBP	RHI MAGNESITA NV	3,73	(240)	12 308	94
13/08/2030	GBP	RIGHTMOVE PLC	3,73	66 880	542 146	2 930
13/08/2030	GBP	RIO TINTO PLC (LSE)	3,73	(9 963)	1 389 518	70 264
13/08/2030	GBP	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,73	164 298	3 781 555	638 883

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	GBP	RS GROUP PLC	3,73	(12 041)	141 685	7 511
13/08/2030	GBP	SAFESTORE HOLDINGS PLC (LSE)	3,73	(6 753)	79 587	2 597
13/08/2030	GBP	SAVILLS PLC	3,73	508	8 062	6
13/08/2030	GBP	SCHRODERS PLC	3,73	1 089	11 849	59
13/08/2030	GBP	SEGRO PLC (LSE)	3,73	1 652	22 615	4 327
13/08/2030	GBP	SERICA ENERGY PLC (LSE)	3,73	(8 484)	42 843	7 082
13/08/2030	GBP	SEVERN TRENT PLC	3,73	1 287	70 183	2 386
13/08/2030	GBP	SIRIUS REAL ESTATE LTD (LSE)	3,73	(5 930)	10 776	110
13/08/2030	GBP	SSP GROUP PLC	3,73	6 060	18 375	2 987
13/08/2030	GBP	ST JAMES'S PLACE PLC (LSE)	3,73	13 859	291 781	20 671
13/08/2030	GBP	STHREE PLC	3,73	(15 050)	47 037	2 715
13/08/2030	GBP	TRUSTPILOT GROUP PLC	3,73	46 150	211 708	11 226
13/08/2030	GBP	UNILEVER PLC	3,73	18 345	1 505 736	45 327
13/08/2030	GBP	UNITE GROUP PLC/THE	3,73	(13 281)	130 023	4 432
13/08/2030	GBP	UNITED UTILITIES GROUP PLC (LSE)	3,73	18 464	451 397	10 497
13/08/2030	GBP	VOLEX PLC (LSE)	3,73	(8 628)	91 227	866
13/08/2030	GBP	WH SMITH PLC	3,73	(4 743)	36 493	1 836
13/08/2030	GBP	YELLOW CAKE PLC	3,73	(690)	6 903	140
13/08/2030	GBP	YOUGOV PLC (LSE)	3,73	(4 576)	18 330	10
13/08/2030	GBP	ZIGUP PLC	3,73	(9 314)	78 680	19
13/08/2030	GBP	B&M EUROPEAN VALUE RETAIL PL	3,73	(204 303)	760 441	13 380
13/08/2030	GBP	BELLWAY PLC	3,73	(571)	20 930	118
13/08/2030	GBP	COATS GROUP PLC	3,73	(21 243)	31 196	395
13/08/2030	GBP	COHORT PLC (LSE)	3,73	(360)	8 647	361
13/08/2030	GBP	CRANEWARE PLC (LSE)	3,73	(2 826)	77 784	6 981
13/08/2030	GBP	GAMMA COMMUNICATIONS PLC (LSE)	3,73	(4 649)	84 527	10 650
13/08/2030	GBP	GEORGIA CAPITAL PLC	3,73	366	27 266	1 196
13/08/2030	GBP	GLOBALDATA PLC	3,73	(11 688)	20 248	3 957
13/08/2030	GBP	HARBOUR ENERGY PLC	3,73	(4 210)	20 946	4 147
13/08/2030	GBP	INVESTEC PLC (LSE)	3,73	(4 000)	45 214	39
13/08/2030	GBP	JOHNSON MATTHEY PLC	3,73	(1 308)	48 326	1 939
13/08/2030	GBP	LION FINANCE GROUP PLC	3,73	508	98 237	9 659
13/08/2030	GBP	MONDI PLC (LSE)	3,73	(18)	239	9
13/08/2030	GBP	M P EVANS GROUP PLC	3,73	697	19 002	626
13/08/2030	GBP	OCADO GROUP PLC	3,73	(1 478)	5 453	508
13/08/2030	GBP	OXFORD BIOMEDICA PLC (LSE)	3,73	4 376	48 962	1 839
13/08/2030	GBP	PENNON GROUP PLC (LSE)	3,73	(3 160)	27 966	349
13/08/2030	GBP	ROTORK PLC	3,73	(17 356)	97 800	2 191
13/08/2030	GBP	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	3,73	(15 274)	1 726 971	165 729
13/08/2030	GBP	THG PLC	3,73	(80 080)	46 622	1 716
13/08/2030	GBP	WISE GROUP PLC-CL A	3,73	16 192	239 444	33 167
15/07/2027	SEK	AAK AB (STO)	1,76	(14 670)	517 272	19 992
15/07/2027	SEK	ACADEMEDIA AB	1,76	1 227	17 991	295
15/07/2027	SEK	ADDLIFE AB-B(STO)	1,76	830	19 806	248
15/07/2027	SEK	ADDNODE GROUP AB (STO)	1,76	(10 953)	69 976	3 417
15/07/2027	SEK	AFRY AB	1,76	(1 152)	19 438	1 618
15/07/2027	SEK	ALFA LAVAL AB (STO)	1,76	6 123	482 323	39 577
15/07/2027	SEK	ARJO AB - ACTIONS DE CATÉGORIE B	1,76	1 840	6 663	25

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
15/07/2027	SEK	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,76	1 993	48 565	2 007
15/07/2027	SEK	ATRIUM LJUNGBERG AB-B SHS (STO)	1,76	(2 863)	11 302	155
15/07/2027	SEK	ATTENDO AB	1,76	504	8 773	368
15/07/2027	SEK	AVANZA BANK HOLDING AB	1,76	767	43 162	842
15/07/2027	SEK	BETTER COLLECTIVE A/S	1,76	(3 885)	71 376	3 618
15/07/2027	SEK	BILIA AB-A SHS	1,76	(3 412)	76 054	2 839
15/07/2027	SEK	BILLERUD AB	1,76	3 689	33 559	581
15/07/2027	SEK	BIOARCTIC AB	1,76	1 810	81 228	6 811
15/07/2027	SEK	BOLIDEN AB (STO)	1,76	20 818	1 649 838	31 906
15/07/2027	SEK	BRAVIDA HOLDING AB	1,76	(1 479)	27 370	309
15/07/2027	SEK	CAMURUS AB	1,76	2 145	171 577	7 739
15/07/2027	SEK	CLAS OHLSON AB-B SHS	1,76	2 697	166 661	3 997
15/07/2027	SEK	COREM PROPERTY GROUP - ACTION DE SÉRIE B	1,76	(27 568)	10 604	934
15/07/2027	SEK	DOMETIC GROUP AB	1,76	(1 233)	5 522	917
15/07/2027	SEK	ELECTROLUX PROFESSIONAL AB-B	1,76	(850)	5 790	457
15/07/2027	SEK	ELEKTA AB-B SHS (STO)	1,76	(23 618)	183 661	10 857
15/07/2027	SEK	EQT AB	1,76	(42 814)	1 826 697	89 891
15/07/2027	SEK	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,76	12 246	481 778	14 794
15/07/2027	SEK	FABEGE AB (STO)	1,76	(1 480)	16 725	446
15/07/2027	SEK	HEMNET GROUP AB	1,76	(1 040)	12 177	834
15/07/2027	SEK	HMS NETWORKS AB (STO)	1,76	(1 019)	77 728	1 749
15/07/2027	SEK	HUSQVARNA AB-B SHS(STO)	1,76	(7 594)	45 342	2 977
15/07/2027	SEK	INSTALCO AB	1,76	(3 969)	23 961	1 470
15/07/2027	SEK	INVESTOR AB-B SHS (STO)	1,76	2 331	131 141	7 517
15/07/2027	SEK	INWIDO AB (STO)	1,76	(275)	5 893	27
15/07/2027	SEK	LINDAB INTERNATIONAL AB	1,76	(410)	8 506	589
15/07/2027	SEK	LOOMIS AB (STO)	1,76	1 599	110 533	1 813
15/07/2027	SEK	MEDICOVER AB - ACTION B	1,76	291	9 242	649
15/07/2027	SEK	MUNTERS GROUP AB	1,76	(336)	9 666	1 080
15/07/2027	SEK	MYCRONIC AB (STO)	1,76	264	11 996	537
15/07/2027	SEK	NEW WAVE GROUP AB -B SHS	1,76	(5 040)	72 252	4 182
15/07/2027	SEK	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,76	(88 622)	477 278	5 018
15/07/2027	SEK	NORDNET AB PUBL	1,76	2 205	117 017	3 087
15/07/2027	SEK	NYFOSA AB	1,76	(661)	6 906	144
15/07/2027	SEK	PANDOX AB	1,76	288	7 189	176
15/07/2027	SEK	PEAB AB-CLASS B(STO)	1,76	7 144	94 463	1 757
15/07/2027	SEK	PLATZER FASTIGHETER HOLD-B(STO)	1,76	(1 583)	16 092	39
15/07/2027	SEK	SANDVIK AB (STO)	1,76	27 019	1 524 250	71 087
15/07/2027	SEK	SCANDIC HOTELS GROUP AB	1,76	2 316	30 504	399
15/07/2027	SEK	SDIPTTECH AB - B	1,76	(1 246)	47 448	2 540
15/07/2027	SEK	SECURITAS AB - Actions de catégorie B	1,76	5 994	139 746	1 344
15/07/2027	SEK	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A (STO)	1,76	15 785	442 506	7 689
15/07/2027	SEK	SKANSKA AB-B SHS	1,76	14 600	520 438	38 671
15/07/2027	SEK	SKISTAR AB	1,76	2 144	47 345	3 073
15/07/2027	SEK	SSAB AB - ACTIONS DE CATÉGORIE B	1,76	(43 597)	653 463	74 504
15/07/2027	SEK	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B(STO)	1,76	(41 152)	611 014	7 478
15/07/2027	SEK	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS(STO)	1,76	20 667	424 326	11 363
15/07/2027	SEK	SWEDBANK AB - ACTIONS A (STO)	1,76	40 002	2 065 280	75 285

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
15/07/2027	SEK	SWEDENCARE AB	1,76	(6 238)	25 643	2 386
15/07/2027	SEK	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	1,76	10 371	675 968	32 172
15/07/2027	SEK	THULE GROUP AB/THE(STO)	1,76	(3 453)	109 559	4 237
15/07/2027	SEK	TRELLEBORG AB-B SHS(STO)	1,76	(10 368)	626 345	7 094
15/07/2027	SEK	TRUECALLER AB-B	1,76	16 695	28 381	6 321
15/07/2027	SEK	VIMIAN GROUP AB	1,76	(8 015)	35 684	963
15/07/2027	SEK	VITEC SOFTWARE GROUP AB-B SH	1,76	(1 844)	65 349	2 778
15/07/2027	SEK	VITROLIFE AB	1,76	(601)	8 540	726
15/07/2027	SEK	WALLENSTAM AB-B SHS (STO)	1,76	(1 483)	8 693	47
15/07/2027	SEK	XVIVO PERFUSION AB (STO)	1,76	(2 439)	98 814	4 821
15/07/2027	SEK	APOTEA AB	1,76	(5 667)	63 117	733
15/07/2027	SEK	DYNAVIX GROUP AB	1,76	(707)	7 355	1 222
15/07/2027	SEK	ENGCON AB	1,76	(2 022)	19 475	1 097
15/07/2027	SEK	EPIROC AB-A	1,76	(10 179)	400 948	1 326
15/07/2027	SEK	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,76	(830)	21 094	573
15/07/2027	SEK	ACTIONS HOLMEN AB-B	1,76	(756)	34 184	251
15/07/2027	SEK	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,76	216	16 066	922
15/07/2027	SEK	PLEJD AB	1,76	(186)	29 977	381
15/07/2027	SEK	STORSKOGEN GROUP AB-B	1,76	(6 372)	8 562	504
15/07/2027	SEK	STORYTEL AB	1,76	(664)	10 150	1 090
15/07/2027	SEK	TROAX GROUP AB (STO)	1,76	(1 135)	18 528	1 227
14/08/2026	CHF	ABB LTD-REG (SWX)	(0,04)	18 625	2 677 134	184 464
14/08/2026	CHF	ACCELLERON INDUSTRIES AG	(0,04)	526	69 413	7 174
14/08/2026	CHF	ADECCO GROUP AG-REG	(0,04)	(29 055)	806 106	46 081
14/08/2026	CHF	ALLREAL HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	95	34 676	655
14/08/2026	CHF	ARBONIA AG	(0,04)	(6 024)	41 069	3 378
14/08/2026	CHF	AVOLTA AG	(0,04)	8 412	746 254	50 637
14/08/2026	CHF	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	(0,04)	(463)	96'606	280
14/08/2026	CHF	BARRY CALLEBAUT AG-REG	(0,04)	(225)	451 698	8 546
14/08/2026	CHF	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	(0,04)	1 496	130 869	9 275
14/08/2026	CHF	BUCHER INDUSTRIES AG-REG (SWX)	(0,04)	12	6 602	92
14/08/2026	CHF	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	(0,04)	87	69 924	2 264
14/08/2026	CHF	CEMBRA MONEY BANK AG (SWX)	(0,04)	331	54 426	503
14/08/2026	CHF	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	(0,04)	6	96 762	2 139
14/08/2026	CHF	CLARIANT AG-REG (SWX)	(0,04)	(37 207)	487 456	26 955
14/08/2026	CHF	COSMO PHARMACEUTICALS NV	(0,04)	(1 107)	135 789	6 502
14/08/2026	CHF	DORMAKABA HOLDING AG	(0,04)	1 507	137 517	480
14/08/2026	CHF	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	(0,04)	(47)	24 001	1 209
14/08/2026	CHF	EFG INTERNATIONAL AG	(0,04)	(1 852)	53 382	653
14/08/2026	CHF	FISCHER (GEORG)-REG(SWX)	(0,04)	(1 721)	130 213	3 638
14/08/2026	CHF	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	(0,04)	1 839	759 029	47 478
14/08/2026	CHF	GEBERIT AG-REG (SWX)	(0,04)	1 694	1 516 880	87 281
14/08/2026	CHF	GIVAUDAN-REG	(0,04)	221	1 234 047	91 808
14/08/2026	CHF	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	(0,04)	774	277 355	5 844
14/08/2026	CHF	IMPLENIA AG-REG	(0,04)	521	62 354	2 812
14/08/2026	CHF	INTERROLL HOLDING AG-REG	(0,04)	(3)	7 139	304
14/08/2026	CHF	KARDEX HOLDING AG-REG	(0,04)	61	23 068	1 168
14/08/2026	CHF	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG (SWX)	(0,04)	2 485	853 145	1 119

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	CHF	LANDIS+GYR GROUP AG	(0,04)	(189)	15 887	1 519
14/08/2026	CHF	MEDACTA GROUP SA	(0,04)	140	33 019	381
14/08/2026	CHF	MEDMIX AG	(0,04)	(1 594)	24 084	1 948
14/08/2026	CHF	MOBIMO HOLDING AG-REG	(0,04)	167	100 373	1 429
14/08/2026	CHF	NOVARTIS AG-REG	(0,04)	12 084	2 588 776	94 505
14/08/2026	CHF	PARTNERS GROUP HOLDING AG (SWX)	(0,04)	(1 843)	2 241 309	98 751
14/08/2026	CHF	POLYPEPTIDE GROUP AG	(0,04)	370	21 979	8 562
14/08/2026	CHF	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	(0,04)	119	29 779	302
14/08/2026	CHF	RIETER HOLDING AG-REG	(0,04)	(20 275)	115 278	7 695
14/08/2026	CHF	ROCHE HOLDING AG-BR (SWX)	(0,04)	40	23 460	342
14/08/2026	CHF	SCHINDLER HOLDING AG-REG	(0,04)	27	11 893	280
14/08/2026	CHF	SCHINDLER HOLDING - CERTIFICAT DE PART (SWX)	(0,04)	3 813	1 757 118	35 506
14/08/2026	CHF	SFS GROUP AG	(0,04)	40	9 125	221
14/08/2026	CHF	SGS SA-REG (SWX)	(0,04)	5 929	932 103	42 684
14/08/2026	CHF	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	(0,04)	(386)	49 787	1 809
14/08/2026	CHF	SKAN GROUP AG	(0,04)	742	63 998	7 985
14/08/2026	CHF	SOFTWAREONE HOLDING AG	(0,04)	(10 956)	153 905	3 857
14/08/2026	CHF	SULZER AG-REG	(0,04)	(285)	71 207	4 071
14/08/2026	CHF	SWATCH GROUP AG/THE-BR (SWX)	(0,04)	(2 566)	942 465	52 055
14/08/2026	CHF	SWISS PRIME SITE-REG	(0,04)	109	24 819	403
14/08/2026	CHF	SWISSCOM AG-REG	(0,04)	(498)	573 724	28 607
14/08/2026	CHF	UBS GROUP AG-REG (SWX)	(0,04)	17 924	1 223 556	36 054
14/08/2026	CHF	YPSOMED HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	178	109 015	4 897
14/08/2026	CHF	ZURICH INSURANCE GROUP AG (SWX)	(0,04)	1 160	1 147 684	70 429
14/08/2026	CHF	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	128	55 706	3 129
14/08/2026	CHF	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	(0,04)	(3 367)	121 126	6 943
14/08/2026	CHF	MONTANA AEROSPACE AG	(0,04)	(1 545)	59 105	1 473
14/08/2026	CHF	ROCHE HOLDING AG	(0,04)	4 333	2 513 343	16 458
14/08/2026	CHF	TX GROUP AG	(0,04)	(45)	9 871	26
13/08/2030	USD	10X GENOMICS INC - CLASSE A	3,62	655	26 590	8 484
13/08/2030	USD	1ST SOURCE CORP	3,62	288	31 158	1 540
13/08/2030	USD	A10 NETWORKS INC	3,62	2 646	117 046	20 796
13/08/2030	USD	AAR CORP (NYS)	3,62	179	29 296	6 391
13/08/2030	USD	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,62	1 196	142 320	7 043
13/08/2030	USD	ACADEMY SPORTS & OUTDOORS A	3,62	(1 280)	89 037	4 953
13/08/2030	USD	ACADIA REALTY TRUST	3,62	(851)	25 397	417
13/08/2030	USD	ACCEL ENTERTAINMENT INC	3,62	(2 967)	54 451	2 455
13/08/2030	USD	ACI WORLDWIDE INC (NSM)	3,62	1 001	61 045	9 122
13/08/2030	USD	ACUITY INC	3,62	894	349 570	120 858
13/08/2030	USD	ADEIA INC	3,62	555	23 877	1 598
13/08/2030	USD	ADMA BIOLOGICS INC	3,62	(3 641)	43 058	680
13/08/2030	USD	SYSTÈMES DE DRAINAGE AVANCÉS À	3,62	2 469	445 887	94 706
13/08/2030	USD	ADVANCED ENERGY INDUSTRIES (NSM)	3,62	292	125 489	26 354
13/08/2030	USD	ADVANCED MICRO DEVICES	3,62	1 382	894 232	228 095
13/08/2030	USD	AELUMA INC	3,62	(1 527)	47 487	593
13/08/2030	USD	AEROVIRONMENT INC (NSM)	3,62	(6 321)	1 524 369	74 174
13/08/2030	USD	AES CORP	3,62	(11 224)	228 995	758
13/08/2030	USD	AGILON HEALTH INC (NYS)	3,62	773	109 631	5 647

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	AGILYSYS INC (NSM)	3,62	117	14 872	2 170
13/08/2030	USD	AGIOS PHARMACEUTICALS INC	3,62	897	36 126	10 344
13/08/2030	USD	AGREE REALTY CORP (État de New York)	3,62	3 706	390 354	2 346
13/08/2030	USD	AIRBNB INC - CLASSE A	3,62	20 845	3 796 477	364 517
13/08/2030	USD	AIRSHIP AI HOLDINGS INC	3,62	(5 307)	21 463	3 744
13/08/2030	USD	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,62	(3 683)	667 543	63 098
13/08/2030	USD	AKEBIA THERAPEUTICS INC	3,62	65 773	80 066	24 633
13/08/2030	USD	ALAMO GROUP INC (NYS)	3,62	302	63 535	5 639
13/08/2030	USD	ALARM.COM HOLDINGS INC (NSM)	3,62	109	7 015	68
13/08/2030	USD	ALDEYRA THERAPEUTICS INC	3,62	2 635	6 210	1 624
13/08/2030	USD	ALERUS FINANCIAL CORP (NAS)	3,62	935	38 700	2 014
13/08/2030	USD	ALEXANDER'S INC (NYS)	3,62	166	62 015	1 625
13/08/2030	USD	ALIGN TECHNOLOGY INC (NSM)	3,62	(2 709)	645 902	10 514
13/08/2030	USD	ALIGNMENT HEALTHCARE INC	3,62	4 824	138 313	21 807
13/08/2030	USD	ALKAMI TECHNOLOGY INC	3,62	317	6 636	1 378
13/08/2030	USD	ALLEGION PLC	3,62	1 712	308 819	27 427
13/08/2030	USD	ALLEGRO MICROSYSTEMS INC	3,62	5 504	341 871	194 460
13/08/2030	USD	ALLISON TRANSMISSION HOLDING (NYS)	3,62	(1 172)	187 682	316
13/08/2030	USD	ALLOGENE THERAPEUTICS INC	3,62	9 609	23 852	4 008
13/08/2030	USD	ALLSTATE CORP (NYS)	3,62	1 702	530 103	35 898
13/08/2030	USD	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC (NSM)	3,62	3 829	1 555 037	48 746
13/08/2030	USD	ALPHA & OMEGA SEMICONDUCTOR (NSM)	3,62	322	17 338	3 921
13/08/2030	USD	RESSOURCES MÉTALLURGIQUES ALPHA	3,62	(68)	18 424	2 875
13/08/2030	USD	ALPHATEC HOLDINGS INC	3,62	8 351	94 681	5 862
13/08/2030	USD	ALTA EQUIPMENT GROUP INC	3,62	2 550	22 830	105
13/08/2030	USD	AMALGAMATED FINANCIAL CORP	3,62	762	46 438	2 236
13/08/2030	USD	AMBARELLA INC (NSM)	3,62	1 202	104 983	39 153
13/08/2030	USD	AMENTUM HOLDINGS INC	3,62	(19 159)	587 800	37 638
13/08/2030	USD	AMERANT BANCORP INC	3,62	409	13 427	1 108
13/08/2030	USD	AMEREN CORPORATION	3,62	11 529	1 748 779	74 953
13/08/2030	USD	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,62	53 806	1 006 972	350 810
13/08/2030	USD	AMERICAN ASSETS TRUST INC (NYS)	3,62	623	21 286	361
13/08/2030	USD	AMERICAN AXLE & MFG HOLDINGS	3,62	(7 025)	59 172	6 331
13/08/2030	USD	AMERICAN BATTERY TECHNOLOGY	3,62	(10 273)	44 053	3 674
13/08/2030	USD	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	3,62	(605)	14 790	323
13/08/2030	USD	AMERICAN ELECTRIC POWER	3,62	2 448	438 783	27 415
13/08/2030	USD	AMERICAN EXPRESS CO	3,62	3 534	1 544 246	119 944
13/08/2030	USD	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,62	3 043	561 940	30 752
13/08/2030	USD	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3,62	9 753	451 827	6 709
13/08/2030	USD	AMERICAN PUBLIC EDUCATION (NSM)	3,62	(117)	8 793	54
13/08/2030	USD	AMERICAN STATES WATER CO (État de New York)	3,62	1 038	113 661	5 712
13/08/2030	USD	AMERICAN WATER WORKS CO INC (NYS)	3,62	1 237	218 151	8 330
13/08/2030	USD	AMERIPRISE FINANCIAL INC (NYS)	3,62	3 747	2 354 660	36 130
13/08/2030	USD	AMERIS BANCORP	3,62	487	58 787	2 494
13/08/2030	USD	AMERISAFE INC (NSM)	3,62	2 360	105 481	6 813
13/08/2030	USD	AMETEK INC	3,62	2 843	895 372	66 386
13/08/2030	USD	AMN HEALTHCARE SERVICES INC	3,62	463	18 970	1 903
13/08/2030	USD	AMNEAL PHARMACEUTICALS INC	3,62	7 343	156 880	20 219

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13 août 2030	USD	AMPHASTAR PHARMACEUTICALS À	3,62	(1 548)	43 801	354
13 août 2030	USD	AMPHENOL CORP-CL A (NYS)	3,62	9 291	1 933 408	352 732
13 août 2030	USD	AMPLITUDE INC - CLASSE A	3,62	3 391	32 630	3 510
13 août 2030	USD	ANAPTYSBIO INC	3,62	938	68 151	20 255
13 août 2030	USD	ANAVEX LIFE SCIENCES CORP	3,62	2 319	7 956	403
13 août 2030	USD	ANGIODYNAMICS INC	3,62	4 281	73 312	4 212
13 août 2030	USD	ANI PHARMACEUTICALS INC	3,62	587	67 002	576
13 août 2030	USD	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	3,62	(3 757)	687 085	70 140
13 août 2030	USD	APPFOLIO INC - A(NMS)	3,62	(901)	211 492	10 691
13 août 2030	USD	APPLIED DIGITAL CORP	3,62	(1 060)	57 532	2 602
13 août 2030	USD	APPLIED INDUSTRIAL TECH INC (NYS)	3,62	2 946	1 290 349	96 548
13 août 2030	USD	APPLIED MATERIALS INC	3,62	1 375	953 020	436 733
13 août 2030	USD	APPLIED OPTOELECTRONICS INC (NMS)	3,62	(201)	49 090	7 805
13 août 2030	USD	APTARGROUP INC (NYS)	3,62	8 568	1 370 135	123 661
13 août 2030	USD	APTIV PLC	3,62	(22 794)	2 072 537	128 799
13 août 2030	USD	AQUESTIVE THERAPEUTICS INC	3,62	6 953	38 688	1 550
13 août 2030	USD	ARAMARK	3,62	26 905	1 999 836	131 251
13 août 2030	USD	ARCBEST CORP (NSM)	3,62	(520)	119 768	16 236
13 août 2030	USD	ARCHER AVIATION INC-A	3,62	(12 423)	87 489	5 872
13 août 2030	USD	ARCHROCK INC	3,62	1 542	76 748	10 736
13 août 2030	USD	ARCUTIS BIOTHERAPEUTICS INC	3,62	1 595	51 671	6 592
13 août 2030	USD	ARDENT HEALTH INC	3,62	3 010	39 122	2 103
13 août 2030	USD	ARGAN INC (NYS)	3,62	230	188 888	67 696
13 août 2030	USD	ARISTA NETWORKS INC	3,62	16 743	3 543 437	418 622
13 août 2030	USD	ARKO CORP	3,62	(1 655)	18 625	142
13 août 2030	USD	ARLO TECHNOLOGIES INC	3,62	7 441	127 843	11 843
13 août 2030	USD	ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES	3,62	3 506	744 101	38 349
13 août 2030	USD	ARRIVENT BIOPHARMA INC	3,62	210	8 929	1 238
13 août 2030	USD	ARROWHEAD PHARMACEUTICALS À	3,62	3 465	383 726	14 425
13 août 2030	USD	ARTERIS INC	3,62	3 770	176 177	79 947
13 août 2030	USD	ASGN INC	3,62	(7 359)	208 534	26 200
13 août 2030	USD	ASHLAND INC	3,62	1 463	132 350	2 361
13 août 2030	USD	ASPEN AEROGELS INC	3,62	6 887	52 247	8 619
13 août 2030	USD	AST SPACEMOBILE INC	3,62	(4 852)	601 516	1 564
13 août 2030	USD	ASTRONICS CORP	3,62	1 630	155 935	28 774
13 août 2030	USD	ATKORE INC	3,62	(75)	7 961	30
13 août 2030	USD	ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	3,62	623	44 022	955
13 août 2030	USD	ATLANTIC UNION BANKSHARES CO	3,62	803	43 416	3 897
13 août 2030	USD	ATLAS ENERGY SOLUTIONS INC	3,62	(4 459)	105 898	2 902
13 août 2030	USD	ATMOS ENERGY CORP	3,62	9 251	2 183 712	32 976
13 août 2030	USD	ATMUS FILTRATION TECHNOLOGIE	3,62	310	20 517	1 486
13 août 2030	USD	ATRICURE INC (NMS)	3,62	2 465	94 567	1 353
13 août 2030	USD	ATYR PHARMA INC	3,62	20 714	13 531	3 730
13 août 2030	USD	AURINIA PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 481	32 343	2 650
13 août 2030	USD	AUTONATION INC	3,62	(3 622)	975 915	40 625
13 août 2030	USD	AUTOZONE INC	3,62	133	576 837	14 501
13 août 2030	USD	AVEPOINT INC	3,62	7 052	105 424	4 588
13 août 2030	USD	EVERY DENNISON CORP	3,62	3 963	862 537	37 448

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	AVIS BUDGET GROUP INC (NSM)	3,62	(3 005)	782 934	168 307
13/08/2030	USD	AVNET INC (NSM)	3,62	17 250	2 054 141	84 787
13/08/2030	USD	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,62	4 119	573 726	44 969
13/08/2030	USD	AXOGEN INC	3,62	1 162	66 990	7 780
13/08/2030	USD	AZZ INC (NYS)	3,62	65	12 714	1 322
13/08/2030	USD	BACKBLAZE INC-A	3,62	1 321	13 632	15 792
13/08/2030	USD	BADGER METER INC	3,62	323	57 850	8 957
13/08/2030	USD	BALCHEM CORP (NSM)	3,62	90	20 289	870
13/08/2030	USD	BANCO LATINOAMERICANO COME-E	3,62	1 820	147 818	7 881
13/08/2030	USD	BANDWIDTH INC - CLASSE A	3,62	366	30 272	1 985
13/08/2030	USD	BANK FIRST CORP	3,62	189	37 909	1 224
13/08/2030	USD	BANK OF HAWAII CORP	3,62	538	58 738	2 719
13/08/2030	USD	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,62	12 637	2 470 319	74 750
13/08/2030	USD	BANNER CORPORATION	3,62	(85)	7 883	28
13/08/2030	USD	BARRETT BUSINESS SVCS INC (NSM)	3,62	179	8 572	274
13/08/2030	USD	BATH & BODY WORKS INC	3,62	3 283	82 959	23 372
13/08/2030	USD	BELLRING BRANDS INC	3,62	7 690	92 549	46 491
13/08/2030	USD	BENCHMARK ELECTRONICS INC (NYS)	3,62	1 119	129 303	24 891
13/08/2030	USD	BENTLEY SYSTEMS INC - CATÉGORIE B	3,62	(22 593)	1 022 404	82 252
13/08/2030	USD	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,62	1 898	1 281 176	40 615
13/08/2030	USD	BEST BUY CO INC (NYS)	3,62	11 867	1 251 776	14 779
13/08/2030	USD	BIGBEAR.AI HOLDINGS INC	3,62	(7 578)	42 483	3 833
13/08/2030	USD	BIGLARI HOLDINGS INC-B	3,62	131	56 972	21 014
13/08/2030	USD	BIOCRYST PHARMACEUTICALS INC	3,62	11 613	132 636	29 365
13/08/2030	USD	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,62	15 994	1 252 840	20 111
13/08/2030	USD	BIO-RAD LABORATORIES-A	3,62	933	378 638	2 332
13/08/2030	USD	BJ'S RESTAURANTS INC	3,62	401	27 072	6 918
13/08/2030	USD	BK TECHNOLOGIES CORP	3,62	437	48 571	3 742
13/08/2030	USD	BLACK HILLS CORP (NYS)	3,62	10 431	1 046 479	33 219
13/08/2030	USD	BLACKBAUD INC (NSM)	3,62	280	11 066	436
13/08/2030	USD	BLACKSKY TECHNOLOGY INC	3,62	(653)	28 949	3 653
13/08/2030	USD	BLACKSTONE INC	3,62	(13 205)	2 181 976	21 077
13/08/2030	USD	BLAIZE HOLDINGS INC	3,62	(5 683)	11 927	1 026
13/08/2030	USD	BLOOM ENERGY CORP - A	3,62	1 204	396 401	112 570
13/08/2030	USD	BLUE BIRD CORP	3,62	2 851	273 181	40 561
13/08/2030	USD	BLUELINX HOLDINGS INC	3,62	260	18 938	3 496
13/08/2030	USD	BOEING CO/THE (NYS)	3,62	9 869	2 885 622	88 675
13/08/2030	USD	BOK FINANCIAL CORPORATION	3,62	3 811	699 405	37 230
13/08/2030	USD	BOOKING HOLDINGS INC	3,62	20 599	4 614 599	509 137
13/08/2030	USD	BOOT BARN HOLDINGS INC	3,62	(101)	23 267	195
13/08/2030	USD	BOWHEAD SPECIALTY HOLDINGS I	3,62	2 060	77 795	8 087
13/08/2030	USD	BRADY CORPORATION - CL A	3,62	527	57 229	10 051
13/08/2030	USD	BREAD FINANCIAL HOLDINGS INC	3,62	340	45 731	5 687
13/08/2030	USD	BRIDGEBIO PHARMA INC	3,62	1 877	176 437	18 302
13/08/2030	USD	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT (NYS)	3,62	6 951	623 196	63 061
13/08/2030	USD	BRINKER INTERNATIONAL INC (NYS)	3,62	630	129 510	17 970
13/08/2030	USD	BRINK'S CO/THE	3,62	(1 248)	175 455	11 538
13/08/2030	USD	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (État de New York)	3,62	27 638	2 142 967	72 728

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,62	(2 239)	99 480	1 308
13/08/2030	USD	BROADCOM INC	3,62	4 947	2 578 295	24 808
13/08/2030	USD	BROOKDALE SENIOR LIVING INC	3,62	785	14 341	3 282
13/08/2030	USD	BUMBLE INC-A	3,62	11 217	42 392	7 659
13/08/2030	USD	BUNGE GLOBAL SA	3,62	(11 783)	2 106 744	363 895
13/08/2030	USD	BURKE & HERBERT FINANCIAL SE	3,62	95	8 757	749
13/08/2030	USD	BYLINE BANCORP INC	3,62	2 758	133 462	11 168
13/08/2030	USD	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC (NSM)	3,62	4 936	1 273 413	23 367
13/08/2030	USD	CABLE ONE INC	3,62	271	16 277	3 807
13/08/2030	USD	CABOT CORP	3,62	10 602	1 227 600	119 236
13/08/2030	USD	CACI INTERNATIONAL INC -CL A	3,62	(1 499)	1 089 407	125 674
13/08/2030	USD	CACTUS INC - A	3,62	(1 977)	160 128	19 209
13/08/2030	USD	CADENCE DESIGN SYS INC (NSM)	3,62	(3 857)	2 071 529	59 035
13/08/2030	USD	CALERES INC (NYS)	3,62	(3 429)	65 703	6 489
13/08/2030	USD	CALIFORNIA WATER SERVICE GRP	3,62	900	57 822	3 121
13/08/2030	USD	CAL-MAINE FOODS INC (NSM)	3,62	76	8 380	136
13/08/2030	USD	CAMDEN NATIONAL CORP	3,62	208	15 025	669
13/08/2030	USD	CAPITAL BANCORP INC/MD	3,62	240	11 216	514
13/08/2030	USD	CAPITAL CITY BANK GROUP INC (NSM)	3,62	228	14 725	1 035
13/08/2030	USD	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,62	11 331	2 806 846	360 205
13/08/2030	USD	CAPITOL FEDERAL FINANCIAL IN	3,62	5 176	58 251	3 053
13/08/2030	USD	CAPRICOR THERAPEUTICS INC	3,62	(1 145)	40 446	2 141
13/08/2030	USD	CARDINAL HEALTH INC (NYS)	3,62	9 522	2 874 535	275 874
13/08/2030	USD	CAREDX INC (NMS)	3,62	1 069	34 974	7 528
13/08/2030	USD	CARLISLE COS INC	3,62	1 267	579 223	60 528
13/08/2030	USD	CARPENTER TECHNOLOGY (NYS)	3,62	1 435	1 064 243	170 976
13/08/2030	USD	CARRIAGE SERVICES INC (État de New York)	3,62	(581)	32 409	1 450
13/08/2030	USD	CARVANA CO	3,62	(11 953)	1 119 081	23 632
13/08/2030	USD	CASS INFORMATION SYSTEMS INC (NSM)	3,62	457	31 317	1 495
13/08/2030	USD	CASTLE BIOSCIENCES INC	3,62	777	22 842	2 983
13/08/2030	USD	CAVA GROUP INC (NYS)	3,62	(6 493)	738 511	30 427
13/08/2030	USD	CAVCO INDUSTRIES INC (NSM)	3,62	54	42 511	3 685
13/08/2030	USD	CBIZ INC (NYS)	3,62	(287)	13 688	897
13/08/2030	USD	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES (État de New York)	3,62	1 330	92 867	6 424
13/08/2030	USD	CELANESE CORP (NYS)	3,62	(12 721)	893 745	81 363
13/08/2030	USD	CENTRAL GARDEN AND PET CO-A	3,62	398	20 414	1 061
13/08/2030	USD	CENTRAL PACIFIC FINANCIAL CO	3,62	202	10 178	633
13/08/2030	USD	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,62	(5 139)	783 421	9 072
13/08/2030	USD	CHATHAM LODGING TRUST	3,62	6 662	113 530	9 984
13/08/2030	USD	CHEFS' WAREHOUSE INC/THE	3,62	137	16 291	2 051
13/08/2030	USD	CHEMED CORP	3,62	2 470	1 496 376	107 057
13/08/2030	USD	CHUBB LTD (NYS)	3,62	6 099	2 810 284	90 754
13/08/2030	USD	CIENA CORP (NYS)	3,62	1 056	641 872	79 781
13/08/2030	USD	CIMPRESS PLC	3,62	380	48 700	5 142
13/08/2030	USD	CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,62	3 299	765 681	88 894
13/08/2030	USD	CISCO SYSTEMS INC	3,62	(14 123)	2 339 793	33 416
13/08/2030	USD	CITI TRENDS INC	3,62	446	28 399	7 599
13/08/2030	USD	CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,62	14 353	1 300 238	99 967

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	CITY HOLDING CO	3,62	331	59 647	1 428
13/08/2030	USD	CLARIVATE PLC	3,62	(194 850)	616 823	31 887
13/08/2030	USD	CLEAN ENERGY FUELS CORP (NSM)	3,62	16 335	45 332	1 264
13/08/2030	USD	CLEAN HARBORS INC	3,62	1 447	593 977	12 151
13/08/2030	USD	CLEANSARK INC	3,62	(4 133)	85 879	2 301
13/08/2030	USD	CLEAR SECURE INC - CLASSE A	3,62	2 549	184 738	13 503
13/08/2030	USD	CLEARWAY ENERGY INC-C	3,62	(10 286)	536 478	41 522
13/08/2030	USD	CLOROX COMPANY (NYSE)	3,62	(7 918)	1 085 710	30 262
13/08/2030	USD	CLOUDFLARE INC - CLASSE A	3,62	7 958	2 445 800	273 762
13/08/2030	USD	CMS ENERGY CORP	3,62	11 815	1 210 372	47 291
13/08/2030	USD	CNA FINANCIAL CORP (NYS)	3,62	17 491	1 092 765	91 180
13/08/2030	USD	CNO FINANCIAL GROUP INC	3,62	9 714	676 268	15 754
13/08/2030	USD	CNX RESOURCES CORP	3,62	1 941	89 866	1 744
13/08/2030	USD	COCA-COLA CO/THE	3,62	(20 378)	2 375 472	54 492
13/08/2030	USD	COGENT BIOSCIENCES INC	3,62	1 481	64 810	15 158
13/08/2030	USD	COGENT COMMUNICATIONS HOLDIN	3,62	(437)	8 812	383
13/08/2030	USD	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,62	(4 181)	302 084	78 245
13/08/2030	USD	COHERUS ONCOLOGY INC	3,62	12 670	24 030	644
13/08/2030	USD	COHU INC	3,62	2 766	210 109	75 502
13/08/2030	USD	COINBASE GLOBAL INC - CLASSE A	3,62	(4 365)	937 893	51 499
13/08/2030	USD	COLGATE-PALMOLIVE CO	3,62	17 777	2 231 023	36 494
13/08/2030	USD	COLLEGIUM PHARMACEUTICAL INC	3,62	2 060	99 973	3 795
13/08/2030	USD	COMFORT SYSTEMS USA INC	3,62	1 321	3 167 627	481 118
13/08/2030	USD	COMMERCE BANCSHARES INC	3,62	14 403	1 106 796	57 314
13/08/2030	USD	COMMERCE.COM INC	3,62	17 712	66 197	6 830
13/08/2030	USD	COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC	3,62	4 614	19 110	2 361
13/08/2030	USD	COMMUNITY TRUST BANCORP INC	3,62	1 273	124 783	4 183
13/08/2030	USD	COMMVAULT SYSTEMS INC (NSM)	3,62	4 359	763 330	97 698
13/08/2030	USD	COMPASS MINERALS INTERNATION	3,62	3 016	121 763	8 941
13/08/2030	USD	COMPASS THERAPEUTICS INC (NAS)	3,62	19 786	52 978	7 408
13/08/2030	USD	CONAGRA BRANDS INC (NYS)	3,62	21 461	399 245	2 059
13/08/2030	USD	CONCENTRA GROUP HOLDINGS PAR	3,62	265	9 834	1 149
13/08/2030	USD	CONMED CORP (NYS)	3,62	(516)	26 121	2 676
13/08/2030	USD	CONSOLIDATED EDISON INC (NYS)	3,62	16 714	2 507 996	82 249
13/08/2030	USD	CONSTELLATION BRANDS INC-A (NYS)	3,62	(8 565)	1 694 718	31 891
13/08/2030	USD	COPT DEFENSE PROPERTIES	3,62	20 270	966 467	68 162
13/08/2030	USD	CORCEPT THERAPEUTICS INC (NAS)	3,62	5 771	628 706	70 275
13/08/2030	USD	CORE & MAIN INC - CLASSE A	3,62	(12 150)	837 043	20 846
13/08/2030	USD	CORE LABORATORIES INC	3,62	(2 185)	40 892	5 579
13/08/2030	USD	CORE NATURAL RESOURCES INC	3,62	(666)	84 778	10 743
13/08/2030	USD	CORMEDIX INC	3,62	(8 766)	107 210	11 662
13/08/2030	USD	CORPAY INC	3,62	(1 977)	962 174	46 564
13/08/2030	USD	CORSAIR GAMING INC	3,62	4 415	53 134	6 352
13/08/2030	USD	CORTEVA INC	3,62	17 497	1 816 857	251 524
13/08/2030	USD	CORVEL CORP	3,62	779	66 431	1 320
13/08/2030	USD	COSTAR GROUP INC	3,62	(8 301)	396 252	70 496
13/08/2030	USD	COTY INC-CL A (NYS)	3,62	30 518	84 692	7 105
13/08/2030	USD	COURSERA INC	3,62	11 794	87 829	4 752

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	COUSINS PROPERTIES INC	3,62	23 352	946 029	28 012
13/08/2030	USD	COVENANT LOGISTICS GROUP INC	3,62	765	46 706	359
13/08/2030	USD	CRACKER BARREL OLD COUNTRY (NSM)	3,62	1 056	65 518	12 985
13/08/2030	USD	CRISPR THERAPEUTICS AG	3,62	241	16 616	1 690
13/08/2030	USD	CROCS INC (NSM)	3,62	(7 021)	1 194 116	16 309
13/08/2030	USD	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,62	50	53 798	366
13/08/2030	USD	CROWN CASTLE INC	3,62	(7 757)	1 010 140	184 861
13/08/2030	USD	CROWN HOLDINGS INC (NYS)	3,62	15 782	2 100 739	359 207
13/08/2030	USD	CTO REALTY GROWTH INC (NYS)	3,62	2 286	66 883	2 567
13/08/2030	USD	CULLINAN THERAPEUTICS INC	3,62	3 197	53 723	27 720
13/08/2030	USD	CUMMINS INC	3,62	1 897	1 710 133	180 824
13/08/2030	USD	CURIOSITYSTREAM INC	3,62	4 005	14 968	255
13/08/2030	USD	CURTISS-WRIGHT CORP	3,62	1 391	1 394 769	72 474
13/08/2030	USD	CUSHMAN & WAKEFIELD LTD	3,62	1 071	19 745	200
13/08/2030	USD	CUSTOM TRUCK ONE SOURCE INC	3,62	3 352	48 007	7 166
13/08/2030	USD	CVB FINANCIAL CORP	3,62	555	16 153	1 273
13/08/2030	USD	CVS HEALTH CORP	3,62	4 447	607 877	31 788
13/08/2030	USD	DAILY JOURNAL CORP (NAS)	3,62	64	47 052	6 569
13/08/2030	USD	DAKTRONICS INC	3,62	2 351	62 719	1 237
13/08/2030	USD	DANAHER CORP	3,62	4 686	1 199 997	44 237
13/08/2030	USD	DARLING INGREDIENTS INC	3,62	(5 860)	478 965	34 319
13/08/2030	USD	DATADOG INC - CLASSE A	3,62	7 491	2 377 954	340 503
13/08/2030	USD	DAVE & BUSTER'S ENTERTAINMENT (NSM)	3,62	(2 539)	44 224	4 035
13/08/2030	USD	DAVITA INC (NYS)	3,62	2 126	588 634	70 318
13/08/2030	USD	DELL TECHNOLOGIES -C	3,62	2 340	1 228 497	179 330
13/08/2030	USD	DELTA AIR LINES INC (NYS)	3,62	10 101	1 077 183	242 332
13/08/2030	USD	DELUXE CORP	3,62	194	6 304	141
13/08/2030	USD	DENALI THERAPEUTICS INC	3,62	4 248	122 095	30 371
13/08/2030	USD	DENTSPLY SIRONA INC	3,62	9 856	137 997	7 545
13/08/2030	USD	DESIGNER BRANDS INC - CATÉGORIE A	3,62	(3 038)	29 657	4 891
13/08/2030	USD	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,62	(4 960)	1 359 530	149 433
13/08/2030	USD	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO (NSM)	3,62	3 015	48 941	2 485
13/08/2030	USD	DIEBOLD NIXDORF INC (NYS)	3,62	590	66 473	3 337
13/08/2030	USD	DIGIMARC CORP (NSM)	3,62	(1 396)	22 213	6 360
13/08/2030	USD	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,62	(4 992)	1 258 517	3 384
13/08/2030	USD	DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	3,62	(4 469)	1 016 685	28 806
13/08/2030	USD	DIODES INC (NSM)	3,62	670	93 855	8 234
13/08/2030	USD	DNOW INC	3,62	(14 552)	280 050	17 846
13/08/2030	USD	DOLBY LABORATORIES INC-CL A (NYS)	3,62	(3 961)	292 856	1 356
13/08/2030	USD	DOLLAR GENERAL CORP	3,62	3 910	599 578	26 699
13/08/2030	USD	DOLLAR TREE INC	3,62	3 623	557 387	52 891
13/08/2030	USD	DOMO INC - CLASSE B	3,62	4 481	18 841	681
13/08/2030	USD	DONALDSON CO INC (NYS)	3,62	6 733	784 587	59 478
13/08/2030	USD	DONEGAL GROUP INC-CL A(NSM)	3,62	2 192	53 434	4 128
13/08/2030	USD	DONNELLEY FINANCIAL SOLUTION	3,62	407	21 341	2 444
13/08/2030	USD	DOORDASH INC - A	3,62	3 716	782 504	174 088
13/08/2030	USD	DOUBLEVERIFY HOLDINGS INC	3,62	10 408	149 789	7 228
13/08/2030	USD	DOUGLAS DYNAMICS INC	3,62	465	29 875	5 266

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	DROPBOX INC - CLASSE A	3,62	(8 979)	346 224	3 365
13/08/2030	USD	DT MIDSTREAM INC	3,62	2 990	587 101	26 582
13/08/2030	USD	DUCOMMUN INC (NYS)	3,62	668	143 414	29 146
13/08/2030	USD	DXP ENTERPRISES INC (NSM)	3,62	149	33 329	1 659
13/08/2030	USD	DYNATRACE INC	3,62	19 096	1 107 373	66 133
13/08/2030	USD	EAGLE MATERIALS INC	3,62	769	230 922	10 690
13/08/2030	USD	EAST WEST BANCORP INC (NSM)	3,62	9 077	1 627 589	6 254
13/08/2030	USD	EASTERN BANKSHARES INC	3,62	1 683	48 020	4 407
13/08/2030	USD	EASTGROUP PROPERTIES INC	3,62	1 554	435 312	5 257
13/08/2030	USD	EASTMAN CHEMICAL CO (NYS)	3,62	(6 110)	607 867	32 107
13/08/2030	USD	ECOLAB INC (NYS)	3,62	3 305	1 184 464	100 301
13/08/2030	USD	EDGEWISE THERAPEUTICS INC	3,62	681	31 264	7 341
13/08/2030	USD	EDISON INTERNATIONAL (NYS)	3,62	8 094	807 055	30 439
13/08/2030	USD	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,62	664	79 616	3 979
13/08/2030	USD	ELECTRONIC ARTS INC (NSM)	3,62	306	86 743	605
13/08/2030	USD	ELI LILLY & CO (NYS)	3,62	669	1 064 529	53 388
13/08/2030	USD	EMCOR GROUP INC (NYSE)	3,62	1 672	1 811 068	120 316
13/08/2030	USD	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	3,62	(1 132)	8 825	255
13/08/2030	USD	EMPLOYERS HOLDINGS INC	3,62	772	50 191	4 074
13/08/2030	USD	ENACT HOLDINGS INC	3,62	3 832	227 490	17 488
13/08/2030	USD	ENCORE CAPITAL GROUP INC (NSM)	3,62	518	57 935	9 434
13/08/2030	USD	ENERGY SERVICES OF AMERICA (NAS)	3,62	603	13 160	3 141
13/08/2030	USD	ENERPAC TOOL GROUP CORP	3,62	156	7 429	355
13/08/2030	USD	ENERSYS	3,62	2 247	691 763	40 228
13/08/2030	USD	ENOVA INTERNATIONAL INC	3,62	354	88 821	30 224
13/08/2030	USD	ENOVIX CORP	3,62	(6 409)	56 129	2 038
13/08/2030	USD	ENPHASE ENERGY INC (NMS)	3,62	(30 792)	2 171 526	64 402
13/08/2030	USD	ENSIGN GROUP INC/THE(NSM)	3,62	1 725	364 809	20 190
13/08/2030	USD	ENTERGY CORP (NYS)	3,62	1 430	220 320	8 219
13/08/2030	USD	ENVISTA HOLDINGS CORP	3,62	13 567	455 212	42 629
13/08/2030	USD	EPAM SYSTEMS INC (NYS)	3,62	(6 261)	812 358	123 488
13/08/2030	USD	EQT CORP	3,62	13 944	1 023 033	8 107
13/08/2030	USD	EQUINIX INC	3,62	415	602 775	2 285
13/08/2030	USD	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,62	7 323	656 854	4 215
13/08/2030	USD	ACTIONS RÉSIDENTIELLES	3,62	462	43 560	2 271
13/08/2030	USD	ESCO TECHNOLOGIES INC (NYS)	3,62	239	101 552	15 040
13/08/2030	USD	ESSENT GROUP LTD	3,62	9 436	773 879	70 854
13/08/2030	USD	ETHAN ALLEN INTERIORS INC (NYS)	3,62	458	13 636	602
13/08/2030	USD	ETSY INC	3,62	9 909	949 752	89 700
13/08/2030	USD	EURONET WORLDWIDE INC (NSM)	3,62	1 160	103 548	14 740
13/08/2030	USD	EVERCORE INC - A	3,62	4 461	2 120 022	1 416
13/08/2030	USD	EVEREST GROUP LTD	3,62	1 777	834 010	54 641
13/08/2030	USD	EVERGY INC	3,62	4 280	494 385	23 950
13/08/2030	USD	EVERQUOTE INC - CATÉGORIE A	3,62	2 086	57 657	11 563
13/08/2030	USD	EVERSOURCE ENERGY (NYS)	3,62	13 697	1 321 418	66 516
13/08/2030	USD	EVERTEC INC	3,62	2 205	73 615	11 765
13/08/2030	USD	EXCELERATE ENERGY INC-A	3,62	185	8 454	1 342
13/08/2030	USD	EXELIXIS INC	3,62	18 887	1 384 898	44 456

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	EXELON CORP (NSM)	3,62	12 385	787 753	21 654
13/08/2030	USD	EXPAND ENERGY CORP	3,62	7 236	893 457	24 578
13/08/2030	USD	EXPEDIA GROUP INC	3,62	7 027	2 145 503	365 135
13/08/2030	USD	EXPONENT INC	3,62	10 823	835 916	53 332
13/08/2030	USD	EXPRO GROUP HOLDINGS NV	3,62	(1 417)	32 427	3 372
13/08/2030	USD	EXTREME NETWORKS INC	3,62	4 706	187 563	24 680
13/08/2030	USD	EZCORP INC-CL A(NSM)	3,62	3 585	145 184	27 640
13/08/2030	USD	F5 INC	3,62	2 247	1 226 965	74 470
13/08/2030	USD	FABRINET	3,62	(758)	613 364	21 137
13/08/2030	USD	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,62	(158)	51 611	952
13/08/2030	USD	FAIR ISAAC CORP (NYS)	3,62	(440)	747 741	14 971
13/08/2030	USD	FARADAY FUTURE INTELLIGENT E	3,62	(45 434)	19 021	4 374
13/08/2030	USD	FARMLAND PARTNERS INC	3,62	(457)	6 316	165
13/08/2030	USD	FASTENAL CO (NSM)	3,62	26 331	1 690 217	69 640
13/08/2030	USD	FATE THERAPEUTICS INC	3,62	3 167	8 259	3 700
13/08/2030	USD	FB FINANCIAL CORP	3,62	101	7 602	175
13/08/2030	USD	FEDERAL REALTY INVS TRUST (NYS)	3,62	(1 209)	208 425	853
13/08/2030	USD	FEDERAL SIGNAL CORP (NYS)	3,62	456	70 364	11 316
13/08/2030	USD	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	3,62	15 548	844 966	3 788
13/08/2030	USD	FIRST BANCORP PUERTO RICO	3,62	1 914	66 089	3 897
13/08/2030	USD	FIRST BANCORP/NC	3,62	94	7 970	420
13/08/2030	USD	FIRST BUSINESS FINANCIAL SER	3,62	748	62 681	3 079
13/08/2030	USD	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,62	(135)	397 778	6 766
13/08/2030	USD	FIRST COMMONWEALTH FINL CORP	3,62	1 779	48 452	1 872
13/08/2030	USD	FIRST COMMUNITY BANKSHARES	3,62	411	25 385	1
13/08/2030	USD	FIRST FINANCIAL BANCORP	3,62	2 592	114 043	8 816
13/08/2030	USD	FIRST FINANCIAL CORP	3,62	78	8 054	352
13/08/2030	USD	FIRST FINL BANKSHARES INC	3,62	16 882	781 856	35 418
13/08/2030	USD	FIRST HAWAIIAN INC	3,62	18 708	730 760	32 016
13/08/2030	USD	FIRST MID BANCSHARES INC	3,62	817	52 569	2 102
13/08/2030	USD	FIRSTCASH HOLDINGS INC	3,62	2 293	677 050	12 828
13/08/2030	USD	FIRSTENERGY CORP (NYS)	3,62	10 835	701 555	14 945
13/08/2030	USD	FIVE9 INC (NMS)	3,62	(798)	23 759	93
13/08/2030	USD	FLEX LTD	3,62	4 330	842 297	135 578
13/08/2030	USD	FLOTEK INDUSTRIES INC (NYS)	3,62	(2 735)	90 165	687
13/08/2030	USD	FLOWERS FOODS INC (NYS)	3,62	16 254	176 123	4 719
13/08/2030	USD	FLOWSERVE CORP	3,62	1 836	186 550	3 261
13/08/2030	USD	FLYWIRE CORP - DROIT DE VOTE	3,62	400	7 938	1 868
13/08/2030	USD	FORMFACTOR INC (NSM)	3,62	774	125 003	47 964
13/08/2030	USD	FORTINET INC	3,62	22 201	4 333 398	419 041
13/08/2030	USD	FORTREA HOLDINGS INC	3,62	2 439	55 577	3 500
13/08/2030	USD	FOX CORP - CLASSE A	3,62	(7 955)	754 368	180 895
13/08/2030	USD	FOX FACTORY HOLDING CORP	3,62	(871)	21 439	928
13/08/2030	USD	FRANKLIN ELECTRIC CO INC (NSM)	3,62	508	70 581	5 227
13/08/2030	USD	FREQUENCY ELECTRONICS INC (NMS)	3,62	(809)	75 171	530
13/08/2030	USD	FRESHWORKS INC-CL A	3,62	2 849	37 307	2 839
13/08/2030	USD	FRONTDOOR INC	3,62	100	9 357	1 458
13/08/2030	USD	FTI CONSULTING INC	3,62	(1 543)	343 533	24 128

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	FUBOTV INC - CLASSE A	3,62	(7 588)	105 607	8 398
13/08/2030	USD	FULCRUM THERAPEUTICS INC	3,62	2 342	11 464	463
13/08/2030	USD	FULTON FINANCIAL CORP	3,62	2 025	64 160	4 026
13/08/2030	USD	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,62	66	8 565	43
13/08/2030	USD	GARMIN LTD	3,62	1 305	436 540	2 979
13/08/2030	USD	GARRETT MOTION INC	3,62	4 130	184 189	24 710
13/08/2030	USD	GCI LIBERTY INC-CL C	3,62	13 535	403 922	2 612
13/08/2030	USD	GCM GROSVENOR INC - CLASSE A	3,62	6 982	109 344	11 264
13/08/2030	USD	GE VERNOVA INC	3,62	2 810	3 399 126	1 214 011
13/08/2030	USD	GENERAL DYNAMICS CORP	3,62	6 620	3 161 678	101 096
13/08/2030	USD	GENERAL ELECTRIC	3,62	6 015	2 673 409	460 501
13/08/2030	USD	GENESCO INC (NYS)	3,62	(695)	37 819	5 269
13/08/2030	USD	GENIE ENERGY LTD-B	3,62	744	14 744	210
13/08/2030	USD	GENTHERM INC	3,62	(591)	28 896	873
13/08/2030	USD	GENUINE PARTS CO	3,62	4 414	605 890	126 056
13/08/2030	USD	GENWORTH FINANCIAL INC (NYS)	3,62	1 756	21 868	1 279
13/08/2030	USD	GERMAN AMERICAN BANCORP	3,62	140	8 909	337
13/08/2030	USD	GETTY REALTY CORP	3,62	982	45 986	133
13/08/2030	USD	GIGACLOUD TECHNOLOGY INC - A	3,62	(710)	31 397	197
13/08/2030	USD	GITLAB INC-CL A	3,62	83 693	3 327 518	229 808
13/08/2030	USD	GLACIER BANCORP INC (NYS)	3,62	8 181	546 368	41 124
13/08/2030	USD	GLAUKOS CORP	3,62	669	114 278	16 018
13/08/2030	USD	GLOBAL INDUSTRIAL CO	3,62	744	32 786	1 862
13/08/2030	USD	GLOBAL NET LEASE INC	3,62	(633)	8 360	497
13/08/2030	USD	GLOBALFOUNDRIES INC (NSM)	3,62	6 232	650 248	65 694
13/08/2030	USD	GLOBANT SA	3,62	(16 453)	845 506	186 657
13/08/2030	USD	GLOBE LIFE INC	3,62	3 271	742 399	71 655
13/08/2030	USD	GLOBUS MEDICAL INC - A	3,62	(2 552)	287 772	7 440
13/08/2030	USD	GODADDY INC - CLASSE A (NYS)	3,62	12 567	1 398 887	88 090
13/08/2030	USD	GOGO INC (NSM)	3,62	(3 863)	18 316	1 692
13/08/2030	USD	GOLD.COM INC	3,62	839	47 690	863
13/08/2030	USD	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	3,62	37 327	305 559	37 539
13/08/2030	USD	GORMAN-RUPP CO (État de New York)	3,62	103	11 412	1 758
13/08/2030	USD	GOSSAMER BIO INC	3,62	133 178	28 973	1 533
13/08/2030	USD	GRACO INC	3,62	11 632	1 191 787	31 683
13/08/2030	USD	GRAHAM CORP (NYS)	3,62	313	41 930	12 162
13/08/2030	USD	GREEN PLAINS INC (NSM)	3,62	2 227	46 399	1 253
13/08/2030	USD	GREENLIGHT CAPITAL RE LTD-A(NSM)	3,62	2 020	44 875	581
13/08/2030	USD	GREIF INC-CL A (NYS)	3,62	4 251	382 430	62 099
13/08/2030	USD	GRID DYNAMICS HOLDINGS INC	3,62	(2 028)	17 337	1 338
13/08/2030	USD	GRIFFON CORP	3,62	878	111 152	8 304
13/08/2030	USD	GRINDR INC (NYS)	3,62	516	8 333	2 014
13/08/2030	USD	GROUPON INC	3,62	2 299	51 586	25 806
13/08/2030	USD	GUARDANT HEALTH INC	3,62	1 315	239 682	35 310
13/08/2030	USD	GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,62	2 555	415 419	22 177
13/08/2030	USD	GULFPORT ENERGY CORP (NYS)	3,62	253	58 727	996
13/08/2030	USD	H&R BLOCK INC (NYS)	3,62	22 841	1 185 247	36 383
13/08/2030	USD	H2O AMERICA	3,62	108	8 698	437

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	HAGERTY INC-A	3,62	3 151	47 546	4 771
13/08/2030	USD	HALLADOR ENERGY CO (NAS)	3,62	2 381	52 496	5 163
13/08/2030	USD	HALLIBURTON CO	3,62	(15 318)	848 701	123 885
13/08/2030	USD	HAMILTON INSURANCE GROU-CL B	3,62	2 862	126 242	8 994
13/08/2030	USD	HANOVER INSURANCE GROUP INC/	3,62	6 030	1 659 879	144 922
13/08/2030	USD	HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	3,62	2 684	132 801	3 159
13/08/2030	USD	HARTFORD INSURANCE GROUP INC	3,62	5 821	1 049 291	28 007
13/08/2030	USD	HASBRO INC	3,62	11 350	1 302 498	10 488
13/08/2030	USD	HAVERTY FURNITURE	3,62	523	17 059	1 743
13/08/2030	USD	HAWKINS INC (NSM)	3,62	(352)	75 488	5 938
13/08/2030	USD	HAYWARD HOLDINGS INC	3,62	3 011	59 248	13 439
13/08/2030	USD	HCA HEALTHCARE INC	3,62	2 486	1 294 314	56 718
13/08/2030	USD	HCI GROUP INC	3,62	439	98 706	8 636
13/08/2030	USD	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,62	(4 583)	130 764	2 224
13/08/2030	USD	GROUPE DE SERVICES DE SANTÉ (NSM)	3,62	977	29 034	4 410
13/08/2030	USD	HEALTHEQUITY INC (NSM)	3,62	261	32 656	15
13/08/2030	USD	HEALTHSTREAM INC (NSM)	3,62	1 857	68 160	2 249
13/08/2030	USD	HELEN OF TROY LTD (NSM)	3,62	563	21 615	1 164
13/08/2030	USD	HELIOS TECHNOLOGIES INC	3,62	173	19 298	2 209
13/08/2030	USD	HERITAGE FINANCIAL CORP	3,62	247	9 893	286
13/08/2030	USD	HERSHEY CO/THE	3,62	(4 344)	1 069 890	1 011
13/08/2030	USD	HERTZ GLOBAL HLDGS INC	3,62	(3 421)	23 758	13 212
13/08/2030	USD	HEXCEL CORP	3,62	5 765	736 184	67 074
13/08/2030	USD	HF SINCLAIR CORP	3,62	(1 300)	129 616	1 237
13/08/2030	USD	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,62	(12 235)	515 282	2 012
13/08/2030	USD	HILLMAN SOLUTIONS CORP	3,62	636	6 599	881
13/08/2030	USD	HILLTOP HOLDINGS INC	3,62	1 034	54 593	1 185
13/08/2030	USD	HIMS & HERS HEALTH INC	3,62	3 211	153 488	4 697
13/08/2030	USD	HOME BANCSHARES INC	3,62	26 848	1 033 743	32 665
13/08/2030	USD	HORACE MANN EDUCATORS	3,62	2 874	194 385	13 497
13/08/2030	USD	HOVNANIAN ENTERPRISES-A	3,62	246	38 395	10 504
13/08/2030	USD	HOWARD HUGHES HOLDINGS INC	3,62	1 857	171 566	13 265
13/08/2030	USD	HUB GROUP INC-CL A	3,62	(317)	19 646	344
13/08/2030	USD	HUMACYTE INC	3,62	(24 989)	46 697	19 548
13/08/2030	USD	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC (NSM)	3,62	5 791	2 267 292	64 586
13/08/2030	USD	HURON CONSULTING GROUP INC	3,62	(796)	121 485	22 053
13/08/2030	USD	HYLION HOLDINGS CORP	3,62	(4 312)	41 612	10 561
13/08/2030	USD	HYSTER-YALE INC (NYS)	3,62	1 449	68 502	2 800
13/08/2030	USD	IAC INC	3,62	16 833	992 500	89 616
13/08/2030	USD	ICF INTERNATIONAL INC (NSM)	3,62	258	25 758	433
13/08/2030	USD	ICHOR HOLDINGS LTD	3,62	852	85 749	48 130
13/08/2030	USD	IDACORP INC	3,62	1 892	373 742	24 757
13/08/2030	USD	IDEAYA BIOSCIENCES INC	3,62	1 549	59 620	21 033
13/08/2030	USD	IDEXX LABORATORIES INC (NSM)	3,62	(1 326)	1 029 879	60 027
13/08/2030	USD	IDT CORP - CATÉGORIE B (NYS)	3,62	1 322	102 320	4 798
13/08/2030	USD	IHEARTMEDIA INC - CLASSE A	3,62	4 912	26 715	2 636
13/08/2030	USD	ILLINOIS TOOL WORKS (NYS)	3,62	2 548	888 932	75 524
13/08/2030	USD	ILLUMINA INC	3,62	2 882	652 982	52 274

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	IMMERSION CORPORATION (NSM)	3,62	5 833	52 630	2 322
13/08/2030	USD	IMMUNITYBIO INC	3,62	5 190	50 519	12 902
13/08/2030	USD	INCYTE CORP	3,62	4 378	643 442	47 566
13/08/2030	USD	INDEPENDENCE REALTY TRUST À	3,62	(9 110)	215 732	1 916
13/08/2030	USD	INDEPENDENT BANK CORP - MICH	3,62	1 240	61 060	1 157
13/08/2030	USD	IMMOBILIER LOGISTIQUE INDUSTRIEL	3,62	1 061	12 813	278
13/08/2030	USD	INGEVITY CORP	3,62	701	66 534	6 359
13/08/2030	USD	INHIBRX BIOSCIENCES INC (NSM)	3,62	66	8 235	469
13/08/2030	USD	INSEEGO CORP	3,62	(2 924)	42 285	270
13/08/2030	USD	INSMED INC	3,62	7 849	1 007 864	158 689
13/08/2030	USD	INSPERITY INC	3,62	2 062	106 396	13 207
13/08/2030	USD	PRODUITS DE CONSTRUCTION INSTALLÉS (État de New York)	3,62	259	70 667	12 446
13/08/2030	USD	INSULET CORP	3,62	6 885	1 448 046	10 343
13/08/2030	USD	INTAPP INC	3,62	3 198	106 276	5 951
13/08/2030	USD	INTEL CORP	3,62	11 122	1 660 210	508 079
13/08/2030	USD	INTELLIA THERAPEUTICS INC	3,62	1 406	23 921	9 324
13/08/2030	USD	INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	3,62	587	70 081	1 075
13/08/2030	USD	INTERDIGITAL INC (NSM)	3,62	1 054	410 316	9 232
13/08/2030	USD	INTERFACE INC (NSM)	3,62	4 319	183 101	32 886
13/08/2030	USD	INTERNATIONAL BANCSHARES CRP(NSM)	3,62	5 754	604 306	3 428
13/08/2030	USD	INTERNATIONAL PAPER CO	3,62	16 167	740 105	125 860
13/08/2030	USD	INTERPARFUMS INC	3,62	558	76 540	10 984
13/08/2030	USD	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,62	665	68 839	5 170
13/08/2030	USD	INTUITIVE MACHINES INC	3,62	(1 466)	54 248	10 816
13/08/2030	USD	INTUITIVE SURGICAL INC	3,62	(854)	490 693	18 632
13/08/2030	USD	INVITATION HOMES INC	3,62	17 207	712 922	16 336
13/08/2030	USD	IONQ INC	3,62	(20 105)	1 586 312	96 303
13/08/2030	USD	IOVANCE BIOTHERAPEUTICS INC	3,62	4 830	25 461	2 521
13/08/2030	USD	IQVIA HOLDINGS INC	3,62	2 711	688 716	40 468
13/08/2030	USD	IRHYTHM TECHNOLOGIES INC	3,62	459	72 933	3 050
13/08/2030	USD	IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	3,62	5 853	27 344	7 046
13/08/2030	USD	ITRON INC (NSM)	3,62	816	90 672	7 651
13/08/2030	USD	IVANHOE ELECTRIC INC / États-Unis	3,62	(2 544)	35 903	1 939
13/08/2030	USD	JABIL INC	3,62	2 391	1 209 069	80 738
13/08/2030	USD	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,62	4 004	712 434	57 108
13/08/2030	USD	JACOBS SOLUTIONS INC	3,62	10 280	1 745 548	61 001
13/08/2030	USD	JANUS HENDERSON GROUP PLC	3,62	3 048	219 981	251
13/08/2030	USD	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,62	4 575	1 465 055	69 228
13/08/2030	USD	JEFFERIES FINANCIAL GROUP À	3,62	(10 640)	860 494	123 182
13/08/2030	USD	JFROG LTD	3,62	713	79 903	10 396
13/08/2030	USD	JOHNSON & JOHNSON (NYS)	3,62	4 958	1 648 963	103 920
13/08/2030	USD	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	3,62	8 651	1 681 274	82 571
13/08/2030	USD	JOHNSON OUTDOORS INC-A	3,62	1 312	83 908	84
13/08/2030	USD	JONES LANG LASALLE INC	3,62	3 995	1 661 451	61 476
13/08/2030	USD	KAISER ALUMINUM CORP (NSM)	3,62	393	95 822	11 284
13/08/2030	USD	KARAT PACKAGING INC	3,62	267	10 880	1 572
13/08/2030	USD	KBR INC	3,62	4 751	226 725	2 366
13/08/2030	USD	KEMPER CORP	3,62	6 105	210 459	18 746

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13 août 2030	USD	KENNAMETAL INC	3,62	1 291	59 952	3 014
13 août 2030	USD	KENVUE INC (NYS)	3,62	2 607	65 725	3 646
13 août 2030	USD	KEROS THERAPEUTICS INC	3,62	1 492	20 661	1 565
13 août 2030	USD	KEYCORP (NYS)	3,62	33 019	1 012 105	55 167
13 août 2030	USD	KEYSIGHT TECHNOLOGIES A	3,62	2 135	990 525	54 931
13 août 2030	USD	KFORCE INC (NYS)	3,62	(241)	16 522	671
13 août 2030	USD	KILROY REALTY CORP	3,62	(22 921)	1 228 075	16 473
13 août 2030	USD	KIMBALL ELECTRONICS INC (NSM)	3,62	212	7 332	218
13 août 2030	USD	KINIKSA PHARMACEUTICALS INTE	3,62	2 912	200 082	59 949
13 août 2030	USD	KLA CORP	3,62	4 639	1 381 613	570 667
13 août 2030	USD	KNOWLES CORP	3,62	959	49 897	5 510
13 août 2030	USD	KODIAK GAS SERVICES INC	3,62	672	62 310	8 038
13 août 2030	USD	KODIAK SCIENCES INC	3,62	794	34 779	8 384
13 août 2030	USD	KOPIN CORP (NAS)	3,62	(5 002)	32 087	936
13 août 2030	USD	KOPPERS HOLDINGS INC (NYS)	3,62	287	16 682	1 290
13 août 2030	USD	KRATOS DEFENSE & SECURITY (NSM)	3,62	(6 360)	486 217	46 041
13 août 2030	USD	KRISPY KREME INC	3,62	(8 300)	45 142	4 466
13 août 2030	USD	KRONOS WORLDWIDE INC	3,62	(1 154)	10 461	225
13 août 2030	USD	KRYSTAL BIOTECH INC	3,62	108	47 053	8 923
13 août 2030	USD	KULICKE & SOFFA INDUSTRIES	3,62	1 566	222 820	70 067
13 août 2030	USD	KURA ONCOLOGY INC	3,62	19 255	233 076	61 740
13 août 2030	USD	KYNDRYL HOLDINGS INC	3,62	50 231	788 058	1 612
13 août 2030	USD	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,62	(1 374)	580 582	23 283
13 août 2030	USD	LAKELAND FINANCIAL CORP (NSM)	3,62	519	44 273	274
13 août 2030	USD	LAKELAND INDUSTRIES INC (NMS)	3,62	(3 022)	47 833	2 845
13 août 2030	USD	LAM RESEARCH CORP	3,62	4 497	2 018 102	704 096
13 août 2030	USD	LAMAR ADVERTISING CO-A	3,62	4 474	940 500	39 048
13 août 2030	USD	LAMB WESTON HOLDINGS INC	3,62	(3 851)	236 996	5 817
13 août 2030	USD	LANDS' END INC	3,62	(715)	12 314	1 925
13 août 2030	USD	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	3,62	2 908	536 807	83 148
13 août 2030	USD	LA-Z-BOY INC (NYS)	3,62	1 335	69 554	5 399
13 août 2030	USD	LCI INDUSTRIES	3,62	89	11 260	2 002
13 août 2030	USD	LEAR CORP	3,62	(1 164)	228 518	10 514
13 août 2030	USD	LEGALZOOMCOM INC	3,62	6 137	50 238	2 115
13 août 2030	USD	LEMAITRE VASCULAR INC	3,62	1 441	185 562	6 844
13 août 2030	USD	LENDINGTREE INC	3,62	170	8 634	1 870
13 août 2030	USD	LENNAR CORP-A	3,62	8 478	1 062 296	3 056
13 août 2030	USD	LEVI STRAUSS & CO - CLASSE A	3,62	2 885	92 334	7 405
13 août 2030	USD	LIBERTY ENERGY INC	3,62	(1 161)	45 706	3 326
13 août 2030	USD	LIBERTY LIVE HOLDINGS-C	3,62	127	18 233	592
13 août 2030	USD	LIFE TIME GROUP HOLDINGS INC	3,62	1 110	51 702	11 542
13 août 2030	USD	LIFESTANCE HEALTH GROUP INC	3,62	2 208	24 202	8 839
13 août 2030	USD	LIGAND PHARMACEUTICALS	3,62	277	95 893	26 337
13 août 2030	USD	LINCOLN EDUCATIONAL SERVICES	3,62	718	47 491	2 374
13 août 2030	USD	LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS	3,62	996	351 715	17 166
13 août 2030	USD	LINCOLN NATIONAL CORP (NYS)	3,62	(11 832)	597 476	16 026
13 août 2030	USD	LINDBLAD EXPEDITIONS HOLDING (NAS)	3,62	4 912	150 016	43 641
13 août 2030	USD	LINDSAY CORP	3,62	256	40 252	3 886

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	LIONSGATE STUDIOS CORP	3,62	2 883	55 040	6 442
13/08/2030	USD	LIQUIDITY SERVICES INC	3,62	2 350	123 943	3 963
13/08/2030	USD	LITHIA MOTORS INC	3,62	(2 571)	1 092 934	55 101
13/08/2030	USD	LITTELFUSE INC	3,62	288	178 100	4 896
13/08/2030	USD	LIVANOVA PLC	3,62	19 525	2 134 177	99 836
13/08/2030	USD	LIVE NATION ENTERTAINMENT A	3,62	7 915	1 889 418	136 047
13/08/2030	USD	LOEWS CORP (NYS)	3,62	3 127	471 180	21 470
13/08/2030	USD	LOUISIANA-PACIFIC CORP (NYS)	3,62	2 393	239 474	22 649
13/08/2030	USD	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,62	(5 289)	2 132 876	61 710
13/08/2030	USD	LULULEMON ATHLETICA INC	3,62	(4 009)	664 908	28 681
13/08/2030	USD	LUXFER HOLDINGS PLC (NYS)	3,62	1 021	24 931	690
13/08/2030	USD	M/I HOMES INC	3,62	181	34 682	5 892
13/08/2030	USD	MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS H	3,62	1 841	916 613	59 130
13/08/2030	USD	MADISON SQUARE GARDEN SPORTS	3,62	1 057	569 525	21 517
13/08/2030	USD	MADRIGAL PHARMACEUTICALS INC	3,62	198	130 141	18 016
13/08/2030	USD	MAGNERA CORP	3,62	(2 896)	48 463	1 157
13/08/2030	USD	MANITOWOC COMPANY INC (NYS)	3,62	3 339	54 806	9 856
13/08/2030	USD	MANPOWERGROUP INC (NYS)	3,62	3 984	183 733	7 663
13/08/2030	USD	MARA HOLDINGS INC	3,62	1 187	20 890	2 068
13/08/2030	USD	MARCUS & MILLICHAP INC	3,62	2 343	99 199	2 401
13/08/2030	USD	MARCUS CORPORATION	3,62	1 613	47 485	5 376
13/08/2030	USD	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,62	(2 698)	1 453 189	60 981
13/08/2030	USD	MARZETTI COMPANY/THE	3,62	7 304	1 113 918	55 192
13/08/2030	USD	MASTERCARD INC - A	3,62	4 428	3 019 061	146 566
13/08/2030	USD	MATADOR RESOURCES CO (NYS)	3,62	(9 615)	735 563	70 844
13/08/2030	USD	MATCH GROUP INC	3,62	9 604	460 058	48 969
13/08/2030	USD	MATERION CORP	3,62	231	72 176	23 808
13/08/2030	USD	MATRIX SERVICE CO	3,62	7 412	133 236	8 092
13/08/2030	USD	MATTEL INC (NSM)	3,62	(56 494)	1 151 594	59 675
13/08/2030	USD	MAXIMUS INC (NYS)	3,62	(9 001)	769 961	98 651
13/08/2030	USD	MAXLINEAR INC (NSM)	3,62	117	11 740	9 260
13/08/2030	USD	MCGRATH RENTCORP	3,62	219	34 499	2 400
13/08/2030	USD	MEDIAALPHA INC - CLASSE A	3,62	2 703	36 149	11 306
13/08/2030	USD	MEDPACE HOLDINGS INC	3,62	5 021	3 261 058	444 359
13/08/2030	USD	MERCADOLIBRE INC (NSM)	3,62	759	1 681 147	112 306
13/08/2030	USD	MERCK & CO. INC.	3,62	456	75 731	6 328
13/08/2030	USD	MERCURY GENERAL CORP (NYS)	3,62	793	112 114	5 859
13/08/2030	USD	MERCURY SYSTEMS INC	3,62	291	43 345	6 266
13/08/2030	USD	MERIT MEDICAL SYSTEMS INC	3,62	300	28 026	916
13/08/2030	USD	METROPOLITAN BANK HOLDING CO	3,62	343	44 910	2 233
13/08/2030	USD	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3,62	428	680 812	81 693
13/08/2030	USD	MGE ENERGY INC	3,62	1 004	108 832	5 679
13/08/2030	USD	MGIC INVESTMENT CORP	3,62	52 582	1 886 002	179 164
13/08/2030	USD	MICRON TECHNOLOGY INC (NSM)	3,62	3 136	3 918 943	1 132 671
13/08/2030	USD	MICROVISION INC (NMS)	3,62	(110 825)	56 658	5 554
13/08/2030	USD	MID-AMERICA APARTMENT COMM (NYS)	3,62	(2 117)	412 667	3 576
13/08/2030	USD	MIDLAND STATES BANCORP INC	3,62	849	34 880	1 917
13/08/2030	USD	MIMEDX GROUP INC	3,62	6 472	32 853	1 828

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	MIRION TECHNOLOGIES INC	3,62	695	15 333	2 029
13/08/2030	USD	MIRUM PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 194	156 519	38 528
13/08/2030	USD	MISSION PRODUCE INC	3,62	1 066	16 709	781
13/08/2030	USD	MITEK SYSTEMS INC	3,62	1 228	27 417	7 086
13/08/2030	USD	MOELIS & CO - CLASSE A	3,62	(374)	34 840	1 283
13/08/2030	USD	MOHAWK INDUSTRIES INC	3,62	8 752	1 241 869	238 918
13/08/2030	USD	MONARCH CASINO & RESORT INC	3,62	1 237	219 462	7 486
13/08/2030	USD	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	3,62	(7 069)	593 955	15 509
13/08/2030	USD	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,62	(172)	353 327	22 573
13/08/2030	USD	MONSTER BEVERAGE CORP	3,62	17 520	2 228 490	115 226
13/08/2030	USD	MONTE ROSA THERAPEUTICS INC	3,62	1 133	26 102	12 247
13/08/2030	USD	MOODY'S CORP	3,62	2 326	1 465 129	6 030
13/08/2030	USD	MOOG INC - CLASSE A	3,62	1 143	640 065	38 664
13/08/2030	USD	MOSAIC CO/THE (NYS)	3,62	10 742	296 909	19 883
13/08/2030	USD	MOTORCAR PARTS OF AMERICA IN (NSM)	3,62	291	5 856	349
13/08/2030	USD	MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,62	771	442 595	3 830
13/08/2030	USD	MUELLER WATER PRODUCTS INC-A (NYS)	3,62	3 059	109 336	539
13/08/2030	USD	MYR GROUP INC/DELAWARE	3,62	248	140 836	32 296
13/08/2030	USD	MYRIAD GENETICS INC	3,62	13 662	84 402	24 527
13/08/2030	USD	N B T BANCORP INC	3,62	537	35 549	1 581
13/08/2030	USD	N-ABLE INC	3,62	8 713	37 303	7 296
13/08/2030	USD	NAPCO SECURITY TECHNOLOGIES (NSM)	3,62	2 587	127 099	10 159
13/08/2030	USD	NATERA INC	3,62	5 751	1 736 342	442 440
13/08/2030	USD	NATIONAL CINEMEDIA INC	3,62	3 749	18 665	1 167
13/08/2030	USD	REU des services énergétiques nationaux (NAS)	3,62	2 541	83 380	22 785
13/08/2030	USD	NATIONAL FUEL GAS CO (État de New York)	3,62	8 475	911 585	3 942
13/08/2030	USD	NATIONAL HEALTHCARE CORP (ASE)	3,62	595	159 156	16 484
13/08/2030	USD	NATIONAL PRESTO INDS INC (NYS)	3,62	(153)	27 533	950
13/08/2030	USD	NATL HEALTH INVESTORS INC (NYS)	3,62	1 373	139 257	7 982
13/08/2030	USD	NAVITAS SEMICONDUCTOR CORP (NMS)	3,62	(3 208)	91 711	11 988
13/08/2030	USD	NB BANCORP INC	3,62	350	10 011	278
13/08/2030	USD	NELNET INC-CL A	3,62	293	53 413	1 043
13/08/2030	USD	NEOGEN CORP (NSM)	3,62	(1 892)	24 195	546
13/08/2030	USD	NET POWER INC	3,62	(4 073)	9 486	22
13/08/2030	USD	NETFLIX INC	3,62	(10 164)	1 162 285	155 613
13/08/2030	USD	NETSCOUT SYSTEMS INC	3,62	3 163	177 762	14 042
13/08/2030	USD	NETSTREIT CORP	3,62	3 084	87 693	3 799
13/08/2030	USD	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,62	9 496	2 130 212	96 890
13/08/2030	USD	NEUROPACE INC	3,62	748	16 387	142
13/08/2030	USD	NEW JERSEY RESOURCES CORP (NYS)	3,62	6 779	525 389	7 411
13/08/2030	USD	NEWMARK GROUP INC - CATÉGORIE A	3,62	3 356	70 108	410
13/08/2030	USD	NEWMONT CORP	3,62	14 693	1 907 862	4 531
13/08/2030	USD	NEXSTAR MEDIA GROUP INC	3,62	1 847	446 658	11 797
13/08/2030	USD	NEXTDECADE CORP	3,62	(3 220)	37 855	4 153
13/08/2030	USD	NEXTDOOR HOLDINGS INC	3,62	8 352	23 877	2 531
13/08/2030	USD	NEXTNAV INC	3,62	(1 067)	32 066	5 702
13/08/2030	USD	NIAGEN BIOSCIENCE INC	3,62	(7 634)	36 942	3 126
13/08/2030	USD	NICOLET BANKSHARES INC (NYS)	3,62	440	88 868	12 749

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	NIKE INC -CL B	3,62	(29 908)	1 841 942	122 233
13/08/2030	USD	NIOCORP DEVELOPMENTS LTD (NMS)	3,62	(3 215)	21 700	151
13/08/2030	USD	NISOURCE INC	3,62	18 532	1 205 190	20 497
13/08/2030	USD	NLIGHT INC	3,62	1 444	126 261	13 772
13/08/2030	USD	NMI HOLDINGS INC	3,62	2 720	140 499	15 191
13/08/2030	USD	NNN REIT INC	3,62	4 642	299 723	631
13/08/2030	USD	NOBLE CORP PLC	3,62	(309)	19 938	3 759
13/08/2030	USD	NORFOLK SOUTHERN CORP	3,62	303	130 569	2 020
13/08/2030	USD	NORTHERN TRUST CORP (NSM)	3,62	8 713	2 018 598	97 434
13/08/2030	USD	NORTHWEST BANCSHARES INC	3,62	554	11 249	438
13/08/2030	USD	NOVAVAX INC	3,62	1 638	19 553	1 936
13/08/2030	USD	NPK INTERNATIONAL INC	3,62	2 917	59 391	5 235
13/08/2030	USD	NU SKIN ENTERPRISES INC - A (NYS)	3,62	(3 175)	24 042	735
13/08/2030	USD	NUCOR CORP (NYS)	3,62	(2 452)	856 535	96 814
13/08/2030	USD	NUTANIX INC - A	3,62	69 427	4 808 053	113 485
13/08/2030	USD	NVENT ELECTRIC PLC	3,62	746	163 114	13 041
13/08/2030	USD	NVR INC	3,62	82	721 001	56 906
13/08/2030	USD	NWPX INFRASTRUCTURE INC	3,62	396	67 545	15 289
13/08/2030	USD	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,62	(1 430)	569 466	8 696
13/08/2030	USD	OCEANEERING INTL INC	3,62	1 260	69 055	1 982
13/08/2030	USD	OCULAR THERAPEUTIX INC	3,62	6 793	82 796	10 140
13/08/2030	USD	OFB BANCORP	3,62	459	29 976	1 595
13/08/2030	USD	OGE ENERGY CORP	3,62	21 439	1 424 332	26 761
13/08/2030	USD	O-I GLASS INC	3,62	3 766	43 853	6 691
13/08/2030	USD	OIL-DRI CORP OF AMERICA	3,62	68	9 067	609
13/08/2030	USD	OLD DOMINION FREIGHT LINE (NSM)	3,62	(3 193)	1 050 638	89 270
13/08/2030	USD	OLD REPUBLIC INTL CORP	3,62	12 226	654 711	46 355
13/08/2030	USD	OLD SECOND BANCORP INC	3,62	1 586	48 924	2 552
13/08/2030	USD	OLLIE'S BARGAIN OUTLET HOLDI	3,62	(6 300)	687 918	14 485
13/08/2030	USD	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,62	11 366	726 902	27 179
13/08/2030	USD	OMEROS CORP	3,62	(2 979)	42 375	2 988
13/08/2030	USD	ONE GAS INC	3,62	(5 110)	548 286	500
13/08/2030	USD	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,62	372	12 788	43
13/08/2030	USD	ONEOK INC (NYS)	3,62	(22 938)	2 897 170	125 404
13/08/2030	USD	ONITY GROUP INC	3,62	390	20 216	1 367
13/08/2030	USD	OPENLANE INC	3,62	953	48 761	5 995
13/08/2030	USD	OPTIMUM COMMUNICATIONS INC-A	3,62	46 513	77 838	16 229
13/08/2030	USD	OPTION CARE HEALTH INC	3,62	(23 632)	704 599	15 579
13/08/2030	USD	ORACLE CORP	3,62	(11 543)	3 210 671	871 546
13/08/2030	USD	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,62	16 006	2 019 173	31 104
13/08/2030	USD	ORGANOGENESIS HOLDINGS INC (NAS)	3,62	(15 091)	51 982	988
13/08/2030	USD	OSCAR HEALTH INC - CLASSE A	3,62	1 153	44 780	959
13/08/2030	USD	OSHKOSH CORP (NYS)	3,62	4 619	856 973	134 900
13/08/2030	USD	OSI SYSTEMS INC	3,62	184	55 928	25
13/08/2030	USD	OTIS WORLDWIDE CORP	3,62	11 072	1 091 945	20 537
13/08/2030	USD	OTTER TAIL CORP (NSM)	3,62	931	116 330	161
13/08/2030	USD	OVINTIV INC	3,62	(3 106)	250 966	22 591
13/08/2030	USD	OWENS CORNING (NYS)	3,62	4 763	764 389	293 399

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	OXFORD INDUSTRIES INC (NYS)	3,62	(178)	10 743	2 146
13/08/2030	USD	P G & E CORP	3,62	102 839	2 402 167	11 223
13/08/2030	USD	PACCAR INC	3,62	6 473	1 028 979	53 082
13/08/2030	USD	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	3,62	(4 488)	812 175	84 804
13/08/2030	USD	PALOMAR HOLDINGS INC	3,62	250	39 515	4 506
13/08/2030	USD	PAR PACIFIC HOLDINGS INC	3,62	(592)	47 578	1 417
13/08/2030	USD	PARK AEROSPACE CORP	3,62	1 569	73 497	9 947
13/08/2030	USD	PARK NATIONAL CORP	3,62	489	120 273	4 229
13/08/2030	USD	PARKER HANNIFIN CORP	3,62	575	703 396	80 269
13/08/2030	USD	PARSONS CORP	3,62	308	22 676	203
13/08/2030	USD	PATHWARD FINANCIAL INC	3,62	116	13 192	873
13/08/2030	USD	PAYCHEX INC	3,62	(9 683)	1 365 197	41 526
13/08/2030	USD	PAYCOM SOFTWARE INC (NYS)	3,62	(5 888)	1 121 105	92 988
13/08/2030	USD	PAYMENTUS HOLDINGS INC-A	3,62	396	11 597	1 739
13/08/2030	USD	PEDIATRIX MEDICAL GROUP INC	3,62	2 157	70 870	5 199
13/08/2030	USD	PELOTON INTERACTIVE INC-A	3,62	8 896	69 349	3 829
13/08/2030	USD	PENN ENTERTAINMENT INC	3,62	(33 081)	989 555	6 806
13/08/2030	USD	PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC	3,62	742	184 373	6
13/08/2030	USD	PERPETUA RESOURCES CORP (NAS)	3,62	(1 941)	57 818	1 818
13/08/2030	USD	PERRIGO CO PLC (NYS)	3,62	(4 418)	68 686	3 032
13/08/2030	USD	PETCO HEALTH AND WELLNESS CO	3,62	(8 971)	35 405	1 487
13/08/2030	USD	PFIZER INC	3,62	(45 958)	1 640 723	84 825
13/08/2030	USD	PHATHOM PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 126	15 420	1 595
13/08/2030	USD	PHILLIPS EDISON & COMPANY A	3,62	2 344	135 885	71
13/08/2030	USD	PHOTRONICS INC (NSM)	3,62	1 444	57 653	7 795
13/08/2030	USD	PHREESIA INC	3,62	2 718	34 644	4 327
13/08/2030	USD	PINNACLE WEST CAPITAL (NYS)	3,62	938	134 864	4 784
13/08/2030	USD	PLANET LABS PBC	3,62	2 641	113 142	8 703
13/08/2030	USD	PLEXUS CORP	3,62	287	110 269	9 891
13/08/2030	USD	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP (NYS)	3,62	4 566	1 481 339	83 454
13/08/2030	USD	POLARIS INC	3,62	8 201	760 655	26 599
13/08/2030	USD	POPULAR INC	3,62	10 940	2 382 283	128 905
13/08/2030	USD	PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	3,62	24 052	1 701 236	48 788
13/08/2030	USD	POSTAL REALTY TRUST INC - A	3,62	1 551	50 462	2 730
13/08/2030	USD	POWELL INDUSTRIES INC	3,62	361	132 070	11 898
13/08/2030	USD	POWER INTEGRATIONS INC	3,62	76	7 910	978
13/08/2030	USD	POWERFLEET INC	3,62	(13 046)	69 862	376
13/08/2030	USD	PPL CORP	3,62	3 176	157 587	4 090
13/08/2030	USD	PRAIRIE OPERATING CO	3,62	(41 216)	48 241	6 878
13/08/2030	USD	PRAXIS PRECISION MEDICINES I	3,62	153	51 349	20 239
13/08/2030	USD	PREFORMED LINE PRODUCTS CO (NSM)	3,62	118	57 950	9 584
13/08/2030	USD	PRICESMART INC (NSM)	3,62	86	20 957	2 446
13/08/2030	USD	PRIMERICA INC	3,62	3 857	1 488 044	42 379
13/08/2030	USD	PRIMORIS SERVICES CORP	3,62	89	11 652	634
13/08/2030	USD	PRIVIA HEALTH GROUP INC	3,62	1 663	53 108	6 509
13/08/2030	USD	PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,62	(433)	89 865	702
13/08/2030	USD	PROFRAC HOLDING CORP-A	3,62	(1 324)	13 645	2 997
13/08/2030	USD	PROG HOLDINGS INC	3,62	519	26 208	7 567

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	PROGRESS SOFTWARE CORP	3,62	798	35 411	1 889
13/08/2030	USD	PROGRESSIVE CORP	3,62	9 102	2 591 950	176 070
13/08/2030	USD	PROGYNY INC	3,62	2 158	77 914	8 757
13/08/2030	USD	PROLOGIS INC	3,62	(5 243)	1 065 816	71 360
13/08/2030	USD	PROPETRO HOLDING CORP	3,62	(2 256)	47 412	2 458
13/08/2030	USD	PROSPERITY BANCSHARES INC	3,62	8 270	820 107	26 026
13/08/2030	USD	PROTHENA CORP PLC	3,62	6 512	71 833	17 121
13/08/2030	USD	PROTO LABS INC	3,62	101	10 392	1 074
13/08/2030	USD	PROVIDENT FINANCIAL SERVICES	3,62	659	21 247	423
13/08/2030	USD	PTC INC	3,62	(8 668)	1 632 842	267 494
13/08/2030	USD	PUBLIC STORAGE (État de New York)	3,62	(3 215)	1 453 765	14 533
13/08/2030	USD	PUMA BIOTECHNOLOGY INC (NSM)	3,62	4 206	41 176	6 370
13/08/2030	USD	PURE STORAGE INC - CLASSE A	3,62	4 875	452 300	82 173
13/08/2030	USD	PURECYCLE TECHNOLOGIES INC	3,62	(5 752)	79 292	14 371
13/08/2030	USD	PVH CORP	3,62	(9 094)	993 257	54 457
13/08/2030	USD	Q2 HOLDINGS INC	3,62	808	49 680	4 446
13/08/2030	USD	QUALCOMM INC	3,62	(652)	178 648	11 009
13/08/2030	USD	QUALYS INC	3,62	10 494	1 612 712	400 975
13/08/2030	USD	QUANTUM-SI INC	3,62	(31 544)	41 636	2 841
13/08/2030	USD	QUINSTREET INC (NSM)	3,62	6 969	119 636	22 748
13/08/2030	USD	RADIAN GROUP INC (NYS)	3,62	1 170	56 666	5 066
13/08/2030	USD	RALPH LAUREN CORP (NYS)	3,62	1 628	854 619	56 521
13/08/2030	USD	RAMACO RESOURCES INC-A	3,62	(3 276)	65 239	5 044
13/08/2030	USD	RANGE RESOURCES CORP (NYS)	3,62	(2 571)	140 332	7 093
13/08/2030	USD	RANGER ENERGY SERVICES-CL A	3,62	2 233	49 046	680
13/08/2030	USD	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC (NYS)	3,62	5 616	1 179 390	7 898
13/08/2030	USD	RBC BEARINGS INC	3,62	764	650 824	40 030
13/08/2030	USD	REALREAL INC/THE	3,62	9 360	119 043	34 992
13/08/2030	USD	REALTY INCOME CORP (NYS)	3,62	809	70 072	277
13/08/2030	USD	RED CAT HOLDINGS INC	3,62	(5 473)	83 155	2 092
13/08/2030	USD	RED ROCK RESORTS INC - CATÉGORIE A	3,62	494	42 767	2 115
13/08/2030	USD	RED VIOLET INC	3,62	964	72 191	13 471
13/08/2030	USD	REDWIRE CORP	3,62	(2 715)	56 301	10 299
13/08/2030	USD	REGENCY CENTERS CORP	3,62	9 486	1 059 619	707
13/08/2030	USD	REGENXBIO INC	3,62	1 994	17 046	16 471
13/08/2030	USD	REGIONS FINANCIAL CORP	3,62	19 273	768 149	48 949
13/08/2030	USD	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,62	2 231	638 893	21 155
13/08/2030	USD	RELAY THERAPEUTICS INC	3,62	1 492	28 068	10 943
13/08/2030	USD	REMITLY GLOBAL INC	3,62	2 181	54 869	13 329
13/08/2030	USD	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD (NYS)	3,62	2 362	974 179	69 240
13/08/2030	USD	REPAY HOLDINGS CORP (NAS)	3,62	15 808	74 512	18 156
13/08/2030	USD	REPUBLIC BANCORP INC - CATÉGORIE A	3,62	878	107 418	3 571
13/08/2030	USD	REPUBLIC SERVICES INC	3,62	8 793	2 604 898	781
13/08/2030	USD	RESMED INC (NYS)	3,62	6 519	1 761 993	11 098
13/08/2030	USD	RESOURCES CONNECTION INC	3,62	(2 459)	16 152	1 396
13/08/2030	USD	REVOLUTION MEDICINES INC (NSM)	3,62	6 554	1 326 402	387 180
13/08/2030	USD	REVOLVE GROUP INC	3,62	248	7 038	871
13/08/2030	USD	REX AMERICAN RESOURCES CORP	3,62	1 275	77 932	2 157

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	REXFORD INDUSTRIAL REALTY À	3,62	(18 341)	884 127	18 338
13/08/2030	USD	REYNOLDS CONSUMER PRODUCTS I	3,62	5 731	187 416	27 051
13/08/2030	USD	RHYTHM PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 079	128 970	38 305
13/08/2030	USD	RICHTECH ROBOTICS INC-CL B	3,62	(12 650)	38 810	1 694
13/08/2030	USD	RINGCENTRAL INC - CLASSE A	3,62	3 186	172 079	931
13/08/2030	USD	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	3,62	30 160	620 800	108 636
13/08/2030	USD	RLI CORP (NYS)	3,62	12 773	960 811	124 528
13/08/2030	USD	RLJ LODGING TRUST	3,62	1 571	23 311	2 906
13/08/2030	USD	RMR GROUP INC/THE - A	3,62	(1 132)	33 230	920
13/08/2030	USD	ROBLOX CORP - CLASSE A	3,62	38 738	2 241 916	699 184
13/08/2030	USD	ROCKET LAB CORP	3,62	(1 800)	263 695	9 340
13/08/2030	USD	ROCKWELL AUTOMATION INC	3,62	917	585 502	50 232
13/08/2030	USD	ROGERS CORP (NYS)	3,62	101	19 363	3 695
13/08/2030	USD	ROIVANT SCIENCES LTD	3,62	6 781	268 658	65 072
13/08/2030	USD	ROYAL GOLD INC	3,62	2 362	649 134	6 460
13/08/2030	USD	ROYALTY PHARMA PLC - CL A	3,62	9 265	704 426	18 275
13/08/2030	USD	RPC INC	3,62	(7 503)	74 813	14 222
13/08/2030	USD	RTX CORP	3,62	8 112	2 014 077	134 885
13/08/2030	USD	RUBRIK INC-A	3,62	29 412	2 923 315	367 305
13/08/2030	USD	RUMBLE INC (NMS)	3,62	(4 618)	45 080	4 100
13/08/2030	USD	RUSH ENTERPRISES INC-CL A	3,62	572	54 059	4 063
13/08/2030	USD	RUSH STREET INTERACTIVE INC	3,62	4 027	161 849	4 759
13/08/2030	USD	RYERSON HOLDING CORP (NYS)	3,62	(1 749)	69 855	9 891
13/08/2030	USD	SABLE OFFSHORE CORP	3,62	(4 340)	71 902	54 287
13/08/2030	USD	SABRA HEALTH CARE REIT INC (NSM)	3,62	6 527	171 304	5 882
13/08/2030	USD	SAFETY INSURANCE GROUP INC (NSM)	3,62	1 867	186 602	9 965
13/08/2030	USD	SAIA INC	3,62	(2 338)	1 511 874	144 886
13/08/2030	USD	SALESFORCE INC	3,62	(9 966)	2 355 516	176 484
13/08/2030	USD	SAMSARA INC-CL A	3,62	(6 646)	303 319	705
13/08/2030	USD	SANMINA CORP (NSM)	3,62	278	89 679	8 293
13/08/2030	USD	SANUWAVE HEALTH INC	3,62	(2 387)	47 868	14 901
13/08/2030	USD	SAVARA INC	3,62	3 116	22 118	4 656
13/08/2030	USD	SBA COMMUNICATIONS CORP (NSM)	3,62	(816)	235 932	36 288
13/08/2030	USD	SCHOLAR ROCK HOLDING CORP	3,62	1 039	63 884	15 866
13/08/2030	USD	SCHRODINGER INC	3,62	2 690	53 081	7 839
13/08/2030	USD	SCHWAB (CHARLES) CORP (NYS)	3,62	10 342	1 287 491	40 093
13/08/2030	USD	SCIENCE APPLICATIONS INTE	3,62	(2 922)	465 473	16 987
13/08/2030	USD	SEA LTD-ADR	3,62	8 528	980 436	158 511
13/08/2030	USD	SEADRILL LIMITED	3,62	(695)	43 430	6 991
13/08/2030	USD	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,62	1 663	1 892 392	345 487
13/08/2030	USD	SEI INVESTMENTS COMPANY (NSM)	3,62	(5 064)	627 106	5 730
13/08/2030	USD	SELECTIVE INSURANCE GROUP (NSM)	3,62	12 901	1 643 306	98 489
13/08/2030	USD	SELECTQUOTE INC	3,62	(15 218)	18 349	558
13/08/2030	USD	SEMTECH CORP (NSM)	3,62	135	29 045	1 359
13/08/2030	USD	SENECA FOODS CORP - CL A(NSM)	3,62	703	145 046	25 427
13/08/2030	USD	SENTINELONE INC - CLASSE A	3,62	54 581	1 125 755	164 794
13/08/2030	USD	SERVE ROBOTICS INC	3,62	(2 447)	23 819	1 287
13/08/2030	USD	SERVICE CORP INTERNATIONAL (NYS)	3,62	4 076	419 720	12 767

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	SERVISFIRST BANCSHARES INC	3,62	209	23 358	1 887
13/08/2030	USD	SHAKE SHACK INC - CLASSE A	3,62	452	34 341	879
13/08/2030	USD	SHARPLINK GAMING INC	3,62	(7 769)	55 905	4 114
13/08/2030	USD	SHENANDOAH TELECOMMUNICATION	3,62	(493)	11 124	796
13/08/2030	USD	SHOE CARNIVAL INC	3,62	(1 732)	40 216	4 573
13/08/2030	USD	SI-BONE INC	3,62	789	16 912	1 011
13/08/2030	USD	SIGNET JEWELERS LTD (NYS)	3,62	279	33 430	9
13/08/2030	USD	SINCLAIR INC	3,62	572	11 327	8
13/08/2030	USD	SIRIUSPOINT LTD	3,62	2 336	75 773	2 226
13/08/2030	USD	SITE CENTERS CORP	3,62	(1 133)	7 948	1 722
13/08/2030	USD	SITIME CORP	3,62	489	481 031	28 434
13/08/2030	USD	SKYWEST INC (NSM)	3,62	864	102 657	16 976
13/08/2030	USD	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,62	(12 593)	1 235 748	36 346
13/08/2030	USD	SLB LTD	3,62	(29 701)	2 299 198	372 223
13/08/2030	USD	SMARTFINANCIAL INC	3,62	428	26 447	1 504
13/08/2030	USD	SMARTSTOP SELF STORAGE REIT	3,62	(2 221)	101 870	648
13/08/2030	USD	SMITH & WESSON BRANDS INC	3,62	2 687	53 509	2 728
13/08/2030	USD	SMITH (A.O.) CORP (État de New York)	3,62	7 381	588 975	55 739
13/08/2030	USD	SMURFIT WESTROCK PLC (NYS)	3,62	20 269	1 100 966	205 527
13/08/2030	USD	SNAP-ON INC	3,62	814	429 603	26 335
13/08/2030	USD	SNOWFLAKE INC	3,62	13 040	4 362 565	256 981
13/08/2030	USD	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,62	772	58 717	4 088
13/08/2030	USD	SOLID POWER INC	3,62	(21 015)	81 179	5 574
13/08/2030	USD	SOLSTICE ADV MATERIALS INC	3,62	1 315	145 340	17 384
13/08/2030	USD	SONIC AUTOMOTIVE INC - CATÉGORIE A	3,62	96	11 266	102
13/08/2030	USD	SOTERA HEALTH CO	3,62	17 228	390 892	34 991
13/08/2030	USD	SOUNDHOUND AI INC-A	3,62	(7 341)	69 102	2 629
13/08/2030	USD	SOUTH PLAINS FINANCIAL INC	3,62	823	48 032	1 299
13/08/2030	USD	SOUTHSTATE BANK CORP	3,62	6 286	847 423	26 239
13/08/2030	USD	SPHERE ENTERTAINMENT CO	3,62	77	15 248	3 338
13/08/2030	USD	SPROUTS FARMERS MARKET INC	3,62	(7 487)	904 691	17 770
13/08/2030	USD	STAGWELL INC	3,62	2 866	26 099	3 577
13/08/2030	USD	STANDARD MOTOR PRODS	3,62	(627)	33 987	1
13/08/2030	USD	STARZ ENTERTAINMENT CORP	3,62	219	8 386	409
13/08/2030	USD	STEEL DYNAMICS INC (NSM)	3,62	(2 363)	884 267	130 742
13/08/2030	USD	STEPAN CO (NYS)	3,62	439	31 639	2 626
13/08/2030	USD	STEPSTONE GROUP INC - CATÉGORIE A	3,62	(252)	14 883	97
13/08/2030	USD	STERIS PLC	3,62	7 254	2 105 393	25 614
13/08/2030	USD	STEVEN MADDEN LTD	3,62	(1 126)	69 453	3 246
13/08/2030	USD	STITCH FIX INC - CATÉGORIE A	3,62	15 522	77 926	10 961
13/08/2030	USD	STRATA CRITICAL MEDICAL INC	3,62	(13 191)	100 807	4 196
13/08/2030	USD	STRATEGY INC	3,62	(2 614)	416 312	101 883
13/08/2030	USD	STRATTEC SECURITY CORP	3,62	920	99 444	4 837
13/08/2030	USD	SUMMIT THERAPEUTICS INC	3,62	7 498	141 118	11 746
13/08/2030	USD	SUNRUN INC (NSM)	3,62	1 217	20 196	2 488
13/08/2030	USD	SUPER MICRO COMPUTER INC	3,62	(41 032)	1 683 812	8 685
13/08/2030	USD	SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 225	77 028	2 240
13/08/2030	USD	SYLVAMO CORP	3,62	(624)	34 608	1 834

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	SYMBOTIC INC	3,62	1 702	97 884	8 663
13/08/2030	USD	SYNAPTICS INC (NSM)	3,62	(8 985)	1 614 119	63 426
13/08/2030	USD	SYNCHRONY FINANCIAL	3,62	7 484	725 985	66 361
13/08/2030	USD	SYNDAX PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 727	42 339	10 343
13/08/2030	USD	SYNOPSIS INC (NSM)	3,62	(3 919)	2 516 962	86 972
13/08/2030	USD	SYSCO CORP (NYS)	3,62	6 397	700 650	43 605
13/08/2030	USD	TABoola.COM LTD	3,62	2 178	14 336	822
13/08/2030	USD	TECHNOLOGIE DES SYSTÈMES TACTILES I	3,62	387	14 016	2 047
13/08/2030	USD	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE (NSM)	3,62	7 283	2 137 539	399 443
13/08/2030	USD	TANDEM DIABETES CARE INC	3,62	(1 002)	22 679	1 678
13/08/2030	USD	TAPESTRY INC	3,62	10 855	2 149 343	71 472
13/08/2030	USD	TARGA RESOURCES CORP	3,62	(1 969)	748 359	14 196
13/08/2030	USD	TARGET HOSPITALITY CORP (NAS)	3,62	1 842	43 772	8 524
13/08/2030	USD	TARSUS PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 393	119 024	2 938
13/08/2030	USD	TELEFLEX INC	3,62	(5 578)	1 027 968	42 085
13/08/2030	USD	TELOS CORPORATION	3,62	15 617	99 311	597
13/08/2030	USD	TENABLE HOLDINGS INC	3,62	2 936	109 730	41 623
13/08/2030	USD	TENNANT CO (État de New York)	3,62	351	41 856	1 014
13/08/2030	USD	TESLA INC	3,62	496	263 945	25 901
13/08/2030	USD	TETRA TECH INC	3,62	13 928	545 197	19 059
13/08/2030	USD	TEXAS CAPITAL BANCSHARES INC (NSM)	3,62	6 471	904 128	27 032
13/08/2030	USD	TEXAS INSTRUMENTS INC	3,62	3 497	1 394 047	60 005
13/08/2030	USD	TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,62	431	225 502	37 852
13/08/2030	USD	TEXAS ROADHOUSE INC (NSM)	3,62	8 479	1 942 038	349 964
13/08/2030	USD	TG THERAPEUTICS INC	3,62	304	19 764	3 521
13/08/2030	USD	LA SOCIÉTÉ CAMPBELL'S	3,62	(27 441)	875 568	18 982
13/08/2030	USD	TOOTSIE ROLL INDS	3,62	213	11 730	8
13/08/2030	USD	TOPGOLF CALLAWAY BRANDS CORP	3,62	1 399	31 723	4 916
13/08/2030	USD	TORO CO	3,62	13 327	1 705 706	109 862
13/08/2030	USD	TOWNE BANK (NSM)	3,62	2 638	128 906	4 993
13/08/2030	USD	TPG INC	3,62	(8 190)	477 215	15 777
13/08/2030	USD	TRADE DESK INC/ACTION DE CLASSE A	3,62	(20 815)	559 942	37 312
13/08/2030	USD	TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,62	4 624	2 925 058	248 910
13/08/2030	USD	TRANSMEDICS GROUP INC	3,62	(643)	67 046	7 785
13/08/2030	USD	TRAVELERS COS INC/THE	3,62	5 540	2 344 981	209 593
13/08/2030	USD	TRAVERE THERAPEUTICS INC	3,62	1 769	115 306	24 860
13/08/2030	USD	TRICO BANCSHARES (NSM)	3,62	718	52 377	1 725
13/08/2030	USD	TRINET GROUP INC (NYS)	3,62	438	29 240	921
13/08/2030	USD	TRONOX HOLDINGS PLC	3,62	(8 611)	85 861	9 964
13/08/2030	USD	TRUIST FINANCIAL CORP	3,62	(12 553)	871 089	1 212
13/08/2030	USD	TRUSTMARK CORP	3,62	766	48 305	946
13/08/2030	USD	TURNING POINT BRANDS INC	3,62	295	32 936	1 915
13/08/2030	USD	TURTLE BEACH CORP	3,62	(2 421)	44 262	2 379
13/08/2030	USD	TUTOR PERINI CORP (NYS)	3,62	1 026	98 325	20 401
13/08/2030	USD	TWILIO INC - A	3,62	(4 271)	1 233 454	7 673
13/08/2030	USD	TWIST BIOSCIENCE CORP (NSM)	3,62	410	38 749	20 265
13/08/2030	USD	TYSON FOODS INC-CL A	3,62	22 884	1 791 270	45 057
13/08/2030	USD	UBER TECHNOLOGIES INC	3,62	6 689	640 004	31 082

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	UDR INC (NYS)	3,62	20 499	1 124 036	14 159
13/08/2030	USD	UFP INDUSTRIES INC	3,62	3 535	404 633	43 678
13/08/2030	USD	UL SOLUTIONS INC - CLASSE A	3,62	2 085	293 554	5 256
13/08/2030	USD	ULTRA CLEAN HOLDINGS INC (NSM)	3,62	655	83 031	47 693
13/08/2030	USD	ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL IN	3,62	4 112	131 719	60 042
13/08/2030	USD	UMB FINANCIAL CORP	3,62	1 118	222 915	2 797
13/08/2030	USD	UNION PACIFIC CORP	3,62	187	69 636	1 425
13/08/2030	USD	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	3,62	2 456	352 023	113 984
13/08/2030	USD	UNITED BANKSHARES INC (NSM)	3,62	16 640	1 041 454	26 950
13/08/2030	USD	UNITED COMMUNITY BANKS/GA	3,62	616	29 182	1 078
13/08/2030	USD	UNITED FIRE GROUP INC	3,62	3 300	219 700	22 117
13/08/2030	USD	UNITED STATES LIME & MINERAL	3,62	179	25 953	110
13/08/2030	USD	UNITI GROUP INC	3,62	(6 181)	100 075	1 496
13/08/2030	USD	UNITIL CORP	3,62	125	8 995	166
13/08/2030	USD	UNIVERSAL DISPLAY CORP	3,62	(6 123)	747 745	6 152
13/08/2030	USD	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,62	606	34 032	3 532
13/08/2030	USD	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,62	2 296	463 697	11 781
13/08/2030	USD	UNIVERSAL INSURANCE HOLDINGS	3,62	1 646	86 882	7 929
13/08/2030	USD	UNIVEST FINANCIAL CORP	3,62	1 584	92 313	4 124
13/08/2030	USD	UPWORK INC	3,62	(4 131)	49 371	1 355
13/08/2030	USD	US BANCORP	3,62	7 949	629 755	43 508
13/08/2030	USD	US FOODS HOLDING CORP	3,62	8 332	1 047 837	139 336
13/08/2030	USD	VAALCO ENERGY INC (NYS)	3,62	(3 254)	25 231	1 989
13/08/2030	USD	VALERO ENERGY CORP	3,62	4 302	1 548 308	14 561
13/08/2030	USD	VANDA PHARMACEUTICALS INC	3,62	7 075	59 495	730
13/08/2030	USD	VARONIS SYSTEMS INC	3,62	4 224	193 800	53 649
13/08/2030	USD	VEEVA SYSTEMS INC - CLASSE A (NYS)	3,62	16 145	3 752 167	252 842
13/08/2030	USD	VELOCITY FINANCIAL INC	3,62	2 608	63 393	3 619
13/08/2030	USD	VENTAS INC	3,62	19 882	2 345 500	125 541
13/08/2030	USD	VERA THERAPEUTICS INC	3,62	131	5 777	2 077
13/08/2030	USD	VERACYTE INC	3,62	483	32 446	7 127
13/08/2030	USD	VERALTO CORP	3,62	10 712	1 234 212	89 978
13/08/2030	USD	VERICEL CORP	3,62	856	44 622	8 487
13/08/2030	USD	VERTEX INC - CLASSE A	3,62	(504)	8 989	958
13/08/2030	USD	VERTIV HOLDINGS CO-A (NYS)	3,62	5 631	2 241 316	391 037
13/08/2030	USD	VF CORP (NYS)	3,62	(20 728)	483 897	1 606
13/08/2030	USD	VIASAT INC	3,62	110	9 434	4 385
13/08/2030	USD	VIATRIS INC	3,62	25 246	555 211	5 925
13/08/2030	USD	VIAVI SOLUTIONS INC	3,62	1 219	79 592	1 355
13/08/2030	USD	VICOR CORP (NSM)	3,62	1 678	732 958	161 332
13/08/2030	USD	VICTORY CAPITAL HOLDING - A	3,62	(166)	20 338	827
13/08/2030	USD	VIKING HOLDINGS LTD	3,62	26 312	3 246 632	593 465
13/08/2030	USD	VILLAGE SUPER MARKET - CLASSE A (NSM)	3,62	129	7 441	128
13/08/2030	USD	VIR BIOTECHNOLOGY INC	3,62	1 877	21 595	5 092
13/08/2030	USD	VIRIDIAN THERAPEUTICS INC	3,62	1 815	39 916	6 565
13/08/2030	USD	VIRTUS INVESTMENT PARTNERS	3,62	145	28 495	445
13/08/2030	USD	ACTIONS DE CLASSE A DE VISA INC	3,62	5 410	2 436 269	147 461
13/08/2030	USD	VISHAY INTERTECHNOLOGY INC (NYS)	3,62	(691)	52 663	905

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Théorique montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	VIVID SEATS INC - CLASSE A (NSM)	3,62	(3 543)	43 529	11 293
13/08/2030	USD	VULCAN MATERIALS CO	3,62	2 067	785 981	62 941
13/08/2030	USD	VUZIX CORP (NAS)	3,62	(9 466)	39 536	1 229
13/08/2030	USD	WABTEC CORP	3,62	5 263	1 882 733	91 755
13/08/2030	USD	WAFD INC	3,62	346	17 636	840
13/08/2030	USD	WALKER & DUNLOP INC (État de New York)	3,62	235	16 737	1 158
13/08/2030	USD	WALT DISNEY CO/THE	3,62	(10 427)	1 433 885	27 627
13/08/2030	USD	WARBY PARKER INC - CATÉGORIE A	3,62	2 176	75 924	16 174
13/08/2030	USD	WARNER BROS DISCOVERY INC	3,62	3 154	115 464	1 484
13/08/2030	USD	WARNER MUSIC GROUP CORP-CL A	3,62	(5 718)	228 775	13 716
13/08/2030	USD	WASHINGTON TRUST BANCORP (NSM)	3,62	163	7 899	376
13/08/2030	USD	WASTE CONNECTIONS INC	3,62	7 935	1 757 049	84 175
13/08/2030	USD	WATSCO INC (NYS)	3,62	718	380 510	36 943
13/08/2030	USD	WATTS WATER TECHNOLOGIES-A (NYS)	3,62	3 929	1 716 958	432 096
13/08/2030	USD	WAYFAIR INC - CLASSE A	3,62	13 535	1 296 162	451 031
13/08/2030	USD	WAYSTAR HOLDING CORP	3,62	284	7 446	675
13/08/2030	USD	WD-40 CO	3,62	249	77 255	7 234
13/08/2030	USD	WEATHERFORD INTERNATIONAL PL (NSM)	3,62	(3 299)	448 765	75 943
13/08/2030	USD	WEC ENERGY GROUP INC (NYS)	3,62	7 585	1 205 959	26 107
13/08/2030	USD	WERNER ENTERPRISES INC (NSM)	3,62	2 455	146 360	2 565
13/08/2030	USD	WESCO INTERNATIONAL INC	3,62	1 310	615 278	16 630
13/08/2030	USD	WESTERN DIGITAL CORP (NSM)	3,62	1 530	1 045 686	317 102
13/08/2030	USD	WESTROCK COFFEE CO	3,62	(3 426)	42 665	4 083
13/08/2030	USD	WHIRLPOOL CORP (NYS)	3,62	(12 054)	674 245	13 304
13/08/2030	USD	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP (État de New York)	3,62	45	126 695	3 101
13/08/2030	USD	WILEY (JOHN) & SONS - CLASSE A (État de New York)	3,62	305	18 881	1 725
13/08/2030	USD	WINMARK CORP (NMS)	3,62	246	133 539	11 385
13/08/2030	USD	WINTRUST FINANCIAL CORP	3,62	1 329	287 560	9 977
13/08/2030	USD	WISDOMTREE INC	3,62	3 525	82 438	590
13/08/2030	USD	WOLVERINE WORLD WIDE INC (NYSE)	3,62	(1 929)	46 189	1 873
13/08/2030	USD	WOODWARD INC (NSM)	3,62	2 189	1 121 154	176 799
13/08/2030	USD	WORLD ACCEPTANCE CORP	3,62	337	80 519	24 827
13/08/2030	USD	WORLD KINECT CORP	3,62	1 934	84 823	4 368
13/08/2030	USD	WORTHINGTON STEEL INC	3,62	(561)	32 139	5 921
13/08/2030	USD	WP CAREY INC	3,62	(2 856)	302 058	14 538
13/08/2030	USD	WR BERKLEY CORP	3,62	27 652	2 628 007	105 481
13/08/2030	USD	WSFS FINANCIAL CORP	3,62	984	101 600	3 448
13/08/2030	USD	WW GRAINGER INC (NYS)	3,62	592	1 087 801	32 646
13/08/2030	USD	WYNN RESORTS LTD (NSM)	3,62	(5 387)	790 760	64 446
13/08/2030	USD	XENIA HOTELS & RESORTS INC (NYS)	3,62	2 197	56 558	6 110
13/08/2030	USD	XENON PHARMACEUTICALS INC	3,62	400	28 638	5 026
13/08/2030	USD	XERIS BIOPHARMA HOLDINGS INC	3,62	9 811	91 806	16 545
13/08/2030	USD	XEROX HOLDINGS CORP	3,62	(3 988)	18 019	489
13/08/2030	USD	XPO INC	3,62	(5 233)	1 578 196	85 424
13/08/2030	USD	XYLEM INC	3,62	1 741	260 102	27 450
13/08/2030	USD	YELP INC (NYS)	3,62	3 137	106 218	768
13/08/2030	USD	ZENAS BIOPHARMA INC	3,62	816	20 381	8 573
13/08/2030	USD	ZETA GLOBAL HOLDINGS CORP-A	3,62	(547)	15 203	233

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ZEVI PBC-A	3,62	2 899	5 579	1 010
13/08/2030	USD	ZEVI THERAPEUTICS INC	3,62	1 658	31 214	1 886
13/08/2030	USD	ZILLOW GROUP INC - C	3,62	(17 298)	812 281	54 453
13/08/2030	USD	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,62	(3 062)	376 195	8 319
13/08/2030	USD	ZIONS BANCORP NA	3,62	9 493	871 356	42 725
13/08/2030	USD	ZSCALER INC	3,62	8 941	1 555 217	202 508
13/08/2030	USD	ZURN ELKAY WATER SOLUTIONS C	3,62	384	25 233	1 778
13/08/2030	USD	ZYMEWORKS INC	3,62	1 013	32 280	4 628
13/08/2030	USD	ABBVIE INC	3,62	5 773	1 811 013	208 129
13/08/2030	USD	ADAPTIVE BIOTECHNOLOGIES	3,62	2 674	63 654	16 404
13/08/2030	USD	AIRSCULPT TECHNOLOGIES INC	3,62	(9 644)	66 842	6 351
13/08/2030	USD	ALLIENT INC	3,62	1 436	171 741	34 395
13/08/2030	USD	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,62	(8 277)	865 009	1 541
13/08/2030	USD	AMKOR TECHNOLOGY INC (NSM)	3,62	3 716	362 120	85 246
13/08/2030	USD	ANALOG DEVICES INC (NSM)	3,62	3 234	1 770 932	18 992
13/08/2030	USD	ATEA PHARMACEUTICALS INC	3,62	3 338	20 435	1 170
13/08/2030	USD	AUDIOEYE INC	3,62	(872)	8 123	1 096
13/08/2030	USD	AURA BIOSCIENCES INC (NMS)	3,62	1 386	11 829	1 888
13/08/2030	USD	AXT INC	3,62	(76)	9 040	1 448
13/08/2030	USD	BIOVENTUS INC - A	3,62	1 288	16 255	665
13/08/2030	USD	BORR DRILLING LTD (NYS)	3,62	(2 644)	16 703	1 541
13/08/2030	USD	BOWMAN CONSULTING GROUP LTD	3,62	(1 828)	78 083	3 909
13/08/2030	USD	BRAZE INC-A	3,62	(1 162)	35 099	39
13/08/2030	USD	BRUNSWICK CORP	3,62	5 083	559 134	39 370
13/08/2030	USD	BUILD-A-BEAR WORKSHOP INC (NYS)	3,62	(1 043)	49 163	4 497
13/08/2030	USD	CADRE HOLDINGS INC	3,62	(1 488)	61 298	2 330
13/08/2030	USD	CAPRI HOLDINGS LTD	3,62	(2 842)	80 496	7 124
13/08/2030	USD	CARNIVAL CORP LTD	3,62	16 615	672 054	1 989
13/08/2030	USD	CARTER BANKSHARES INC	3,62	1 305	52 995	8 881
13/08/2030	USD	CARTESIAN THERAPEUTICS INC	3,62	39	404	164
13/08/2030	USD	CATERPILLAR INC	3,62	1 295	1 638 227	293 086
13/08/2030	USD	BANQUE CENTRALE	3,62	789	32 241	1 282
13/08/2030	USD	CERIBELL INC	3,62	719	18 429	1 036
13/08/2030	USD	CHEESECAKE FACTORY INC/THE (NSM)	3,62	1 588	156 391	19 583
13/08/2030	USD	COLONY BANCORP (NYS)	3,62	(300)	8 639	261
13/08/2030	USD	COMMERCIAL METALS CO	3,62	(1 059)	108 650	16 530
13/08/2030	USD	CORNING INC	3,62	2 000	469 043	245 178
13/08/2030	USD	CS DISCO INC	3,62	6 285	31 991	1 067
13/08/2030	USD	DEFINIUM THERAPEUTICS INC	3,62	2 054	66 569	69 053
13/08/2030	USD	DELEK US HOLDINGS INC	3,62	1 568	104 981	5 931
13/08/2030	USD	DESIGN THERAPEUTICS INC	3,62	2 325	34 563	12 443
13/08/2030	USD	EGAIN CORP	3,62	(6 735)	68 188	9 342
13/08/2030	USD	EHEALTH INC (NSM)	3,62	(2 665)	6 095	583
13/08/2030	USD	EIGHTCO HOLDINGS INC	3,62	(38 642)	47 960	10 723
13/08/2030	USD	ELECTROMED INC (ASE)	3,62	800	41 479	5 680
13/08/2030	USD	ELEVANCE HEALTH INC	3,62	(1 011)	570 385	24 547
13/08/2030	USD	ENTRADA THERAPEUTICS INC	3,62	3 010	25 060	5 846
13/08/2030	USD	EOS ENERGY ENTERPRISES INC	3,62	(6 079)	51 458	1 764

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ERASCA INC	3,62	1 625	30 298	11 307
13/08/2030	USD	EW SCRIPPS CO/THE-A	3,62	(10 527)	45 363	4 886
13/08/2030	USD	FIRST BANK/HAMILTON NJ (NMS)	3,62	565	12 946	1 002
13/08/2030	USD	FIRST HORIZON CORP	3,62	13 308	458 770	18 717
13/08/2030	USD	FISERV INC	3,62	(14 714)	1 090 150	87 015
13/08/2030	USD	FIVE STAR BANCORP	3,62	851	52 289	5 427
13/08/2030	USD	FLEXSTEEL INDS (NSM)	3,62	351	28 464	8 137
13/08/2030	USD	FLOWCO HOLDINGS INC-CL A	3,62	(1 309)	43 775	5 006
13/08/2030	USD	FUTUREFUEL CORP	3,62	(2 285)	14 563	198
13/08/2030	USD	FVCBANKCORP INC	3,62	1 139	26 336	1 406
13/08/2030	USD	GALAXY DIGITAL INC-A	3,62	(584)	24 555	2 395
13/08/2030	USD	GBANK FINANCIAL HOLDINGS INC	3,62	(436)	19 511	1 142
13/08/2030	USD	GRANITE RIDGE RESOURCES INC	3,62	(1 077)	7 525	765
13/08/2030	USD	GREENWICH LIFESCIENCES INC	3,62	441	13 598	802
13/08/2030	USD	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,62	4 384	125 148	5 948
13/08/2030	USD	HINGE HEALTH INC-A	3,62	1 453	125 751	42 720
13/08/2030	USD	HYCROFT MINING HOLDING CO-A	3,62	805	25 798	396
13/08/2030	USD	IDAHO STRATEGIC RESOURCES À	3,62	429	18 995	546
13/08/2030	USD	INDIVIOR PHARMACEUTICALS INC	3,62	1 334	70 860	5 345
13/08/2030	USD	INNVENTURE INC	3,62	(10 512)	80 774	6 626
6 janvier 2031	USD	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	3,62	3 876	877 006	54 956
13/08/2030	USD	IREN LTD	3,62	(11 624)	827 624	83 363
13/08/2030	USD	JETBLUE AIRWAYS CORP (NSM)	3,62	14 954	96 137	23 413
13/08/2030	USD	KINDER MORGAN INC	3,62	20 067	889 254	3 406
13/08/2030	USD	LINDE PLC (NSM)	3,62	102	72 425	1 429
13/08/2030	USD	MASCO CORP (NYS)	3,62	5 123	506 315	74 675
13/08/2030	USD	METROCITY BANKSHARES INC	3,62	530	25 529	939
13/08/2030	USD	MINERALYS THERAPEUTICS INC (NSM)	3,62	739	24 486	3 298
13/08/2030	USD	MOBILEYE GLOBAL INC-A	3,62	6 498	82 825	4 739
13/08/2030	USD	MOVADO GROUP INC	3,62	2 441	122 718	12 074
13/08/2030	USD	NANO NUCLEAR ENERGY INC	3,62	(1 084)	33 431	1 545
13/08/2030	USD	NATURES SUNSHINE PRODS INC	3,62	1 965	56 094	3 539
13/08/2030	USD	NERDWALLET INC-CL A	3,62	568	6 654	664
13/08/2030	USD	NORTHEAST COMMUNITY BANCORP (NAS)	3,62	166	5 933	479
13/08/2030	USD	ONDAS INC	3,62	(1 988)	25 811	3 063
13/08/2030	USD	ORANGE COUNTY BANCORP INC	3,62	983	49 104	1 325
13/08/2030	USD	ORIGIN BANCORP INC	3,62	1 583	108 414	4 252
13/08/2030	USD	ORMAT TECHNOLOGIES INC	3,62	(810)	125 460	393
13/08/2030	USD	PAGAYA TECHNOLOGIES LTD -A	3,62	315	6 370	1 655
13/08/2030	USD	PALLADYNE AI CORP	3,62	(10 034)	86 616	979
13/08/2030	USD	PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	3,62	8 740	1 134 859	92 166
13/08/2030	USD	LOGISTIQUE AUTOMOBILE PERFORMANTE À	3,62	(1 822)	20 378	3 176
13/08/2030	USD	ENTREPRISE DE SERVICE PUBLIC GP	3,62	5 943	663 931	13 361
13/08/2030	USD	QCR HOLDINGS INC	3,62	469	62 442	1 121
13/08/2030	USD	QUAD GRAPHICS INC (NYS)	3,62	1 292	13 675	1 497
13/08/2030	USD	QUAKER CHEMICAL CORPORATION	3,62	37	7 052	1 141
13/08/2030	USD	REAL BROKERAGE INC/THE (NAS)	3,62	20 341	46 521	5 047
13/08/2030	USD	REGENERON PHARMACEUTICALS (NSM)	3,62	1 303	1 130 882	11 231

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Montant notionnel	Non réalisé
					montant	gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	RIDGEPOST CAPITAL INC-A	3,62	(1 302)	15 016	750
13/08/2030	USD	RIGETTI COMPUTING INC (NAS)	3,62	(1 862)	50 492	467
13/08/2030	USD	RXO INC	3,62	(149)	5 974	260
13/08/2030	USD	SANDISK CORP	3,62	26	59 581	22 980
13/08/2030	USD	SEPTERNA INC	3,62	844	35 863	3 490
13/08/2030	USD	SOLVENTUM CORP	3,62	(3 870)	431 224	13 947
13/08/2030	USD	STAAR SURGICAL CO	3,62	(3 926)	160 582	3 976
13/08/2030	USD	STATE STREET CORP	3,62	8 323	1 877 987	86 258
13/08/2030	USD	STRYKER CORP	3,62	(151)	67 455	49
13/08/2030	USD	TERADYNE INC (NSM)	3,62	1 034	501 213	197 738
13/08/2030	USD	THREDUP INC - CLASSE A (NSM)	3,62	2 708	18 240	7 691
13/08/2030	USD	TOAST INC - CLASSE A	3,62	9 835	333 284	48 059
13/08/2030	USD	TTEC HOLDINGS INC	3,62	(4 283)	13 260	1 728
13/08/2030	USD	TYRA BIOSCIENCES INC	3,62	525	18 611	4 791
13/08/2030	USD	UWM HOLDINGS CORP	3,62	(129 518)	432 905	4 116
13/08/2030	USD	VERSIGENT PLC	3,62	(3 486)	214 161	8 132
13/08/2030	USD	WELLTOWER INC	3,62	244	71 920	5 184
Total des plus-values latentes sur les swaps sur actions						68 673 141
13/08/2030	AUD	ALS LTD (ASX)	4,35	(11 671)	259 060	(3 057)
13/08/2030	AUD	AMPOL LTD	4,35	721	26 156	(2 870)
13/08/2030	AUD	APA GROUP (ASX)	4,35	7 804	80 369	(1 082)
13/08/2030	AUD	ARISTOCRAT LEISURE LTD	4,35	(8 813)	471 306	(58 011)
13/08/2030	AUD	AURIZON HOLDINGS LTD (ASX)	4,35	67 677	288 205	(12 527)
13/08/2030	AUD	BHP GROUP LTD	4,35	29 417	1 731 037	(29 380)
13/08/2030	AUD	CLEANAWAY WASTE MANAGEMENT L	4,35	32 459	75 724	(1 517)
13/08/2030	AUD	COCHLEAR LTD (ASX)	4,35	(290)	34 062	(597)
13/08/2030	AUD	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,35	(5 147)	804 605	(20 590)
13/08/2030	AUD	CSL LTD (ASX)	4,35	(11 930)	1 206 909	(127 484)
13/08/2030	AUD	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	4,35	(22 403)	68 692	(2 339)
13/08/2030	AUD	GOODMAN GROUP	4,35	2 705	83 638	(1 287)
13/08/2030	AUD	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	4,35	(35 351)	164 525	(1 533)
13/08/2030	AUD	IGO LTD	4,35	158 174	1 303 103	(170 268)
13/08/2030	AUD	GROUPE INSURANCE AUSTRALIA	4,35	(64 761)	498 736	(11 800)
13/08/2030	AUD	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,35	(22 365)	709 720	(122 273)
13/08/2030	AUD	LENDLEASE GROUP (ASX)	4,35	(97 959)	253 677	(54 884)
13/08/2030	AUD	LYNAS RARE EARTHS LTD	4,35	(51 062)	840 841	(56 828)
13/08/2030	AUD	MACQUARIE GROUP LTD (ASX)	4,35	(4 815)	1 115 347	(76 306)
13/08/2030	AUD	NEW HOPE CORP LTD (ASX)	4,35	6 092	33 997	(2 063)
13/08/2030	AUD	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,35	(37 424)	679 038	(12 065)
13/08/2030	AUD	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,35	(15 407)	577 949	(82 233)
13/08/2030	AUD	REA GROUP LTD (ASX)	4,35	988	139 462	(5 062)
13/08/2030	AUD	REECE LTD	4,35	(9 851)	148 883	(16 661)
13/08/2030	AUD	RIO TINTO LTD	4,35	505	88 516	(3 728)
13/08/2030	AUD	SANTOS LTD (ASX)	4,35	56 051	424 470	(29 695)
13/08/2030	AUD	SEEK LTD (ASX)	4,35	6 550	86 251	(531)
13/08/2030	AUD	SGH LTD	4,35	(2 915)	120 942	(11 777)
13/08/2030	AUD	SIGMA HEALTHCARE LTD	4,35	6 991	18 807	(83)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	AUD	SONIC HEALTHCARE LTD	4,35	(11 583)	229 849	(5 059)
13/08/2030	AUD	SOUTH32 LTD (ASX)	4,35	271 918	1 179 944	(148 443)
13/08/2030	AUD	TECHNOLOGY ONE LTD	4,35	32 032	994 914	(76 950)
13/08/2030	AUD	TELIX PHARMACEUTICALS LTD	4,35	(70 946)	936 972	(210 807)
13/08/2030	AUD	TELSTRA GROUP LTD	4,35	294 570	1 489 067	(30 707)
13/08/2030	AUD	TRANSURBAN GROUP (ASX)	4,35	52 635	792 017	(39 442)
13/08/2030	AUD	TREASURY WINE ESTATES LTD	4,35	(179 103)	826 923	(2 909)
13/08/2030	AUD	WASHINGTON H SOUL PATTINSON	4,35	(2 659)	113 373	(6 296)
13/08/2030	AUD	WHITEHAVEN COAL LTD (ASX)	4,35	15 053	129 009	(17 387)
13/08/2030	AUD	XERO LTD	4,35	13 464	1 009 600	(64 230)
13/08/2030	AUD	YANCOAL AUSTRALIA LTD (ASX)	4,35	76 573	469 317	(60 254)
13/08/2030	AUD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (ASX)	4,35	(23 936)	863 202	(23 935)
13/08/2026	CAD	AGNICO EAGLE MINES LTD (TOR)	2,31	4 002	910 095	(29 463)
13/08/2026	CAD	ALAMOS GOLD INC - CATÉGORIE A (TOR)	2,31	17 740	872 631	(112 055)
13/08/2026	CAD	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC (TOR)	2,31	(11 910)	1 004 132	(69 979)
13/08/2026	CAD	ALTAGAS LTD	2,31	11 605	638 398	(29 378)
13/08/2026	CAD	ARC RESOURCES LTD (TOR)	2,31	767	24 360	(1 643)
13/08/2026	CAD	ATKINSREALIS GROUP INC	2,31	(9 669)	800 230	(49 632)
13/08/2026	CAD	BARRICK MINING CORP	2,31	26 070	1 466 438	(106 060)
13/08/2026	CAD	CAE INC	2,31	(14 237)	504 018	(375)
13/08/2026	CAD	CAMECO CORP (TOR)	2,31	(2 395)	339 121	(6 465)
13/08/2026	CAD	CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,31	(5 463)	909 426	(17 826)
13/08/2026	CAD	RESSOURCES NATURELLES CANADIENNES	2,31	11 275	714 835	(78 611)
13/08/2026	CAD	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	2,31	4 931	620 714	(15 441)
13/08/2026	CAD	CANADIAN TIRE CORP - CATÉGORIE A	2,31	(4 929)	922 868	(37 854)
13/08/2026	CAD	CAPITAL POWER CORP (TOR)	2,31	(7 799)	552 403	(27 961)
13/08/2026	CAD	CELESTICA INC	2,31	1 488	818 727	(51 448)
13/08/2026	CAD	CENOVUS ENERGY INC (TOR)	2,31	18 435	726 625	(76 730)
13/08/2026	CAD	CONSTELLATION SOFTWARE INC (TOR)	2,31	254	742 696	(66 762)
13/08/2026	CAD	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE(TOR)	2,31	1 417	144 562	(5 877)
13/08/2026	CAD	DOLLARAMA INC (TOR)	2,31	1 696	323 834	(6 679)
13/08/2026	CAD	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	2,31	(26 001)	694 219	(68 790)
13/08/2026	CAD	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,31	(241)	545 549	(15 476)
13/08/2026	CAD	FINNING INTERNATIONAL INC	2,31	(1 779)	171 496	(6 256)
13/08/2026	CAD	FRANCO-NEVADA CORP	2,31	(983)	288 343	(2 356)
13/08/2026	CAD	HYDRO ONE LTD	2,31	(2 948)	167 122	(5 937)
13/08/2026	CAD	KINROSS GOLD CORP (TOR)	2,31	43 439	1 540 817	(86 715)
13/08/2026	CAD	LOBLAW COMPANIES LTD (TOR)	2,31	18 784	1 220 806	(14 012)
13/08/2026	CAD	METRO INC/CN (TOR)	2,31	2 278	212 332	(6 506)
13/08/2026	CAD	OPEN TEXT CORP (TOR)	2,31	(45 078)	1 401 078	(25 914)
13/08/2026	CAD	PAN AMERICAN SILVER CORP (TOR)	2,31	10 444	703 926	(42 390)
13/08/2026	CAD	QUÉBECOR INC -CL B	2,31	30 644	2 109 035	(32 340)
13/08/2026	CAD	RB GLOBAL INC	2,31	(4 772)	718 329	(69 625)
13/08/2026	CAD	SAPUTO INC (TOR)	2,31	2 831	118 930	(2 575)
13/08/2026	CAD	SHOPIFY INC - CLASSE A	2,31	(540)	81 794	(5 423)
13/08/2026	CAD	STANTEC INC	2,31	5 475	553 468	(18 765)
13/08/2026	CAD	SUNCOR ENERGY INC	2,31	22 020	1 877 680	(194 034)
13/08/2026	CAD	TECK RESOURCES LTD-CLS B(TOR)	2,31	625	56 631	(3 968)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2026	CAD	THOMSON REUTERS CORP	2,31	(3 759)	430 284	(4 469)
13/08/2026	CAD	GROUPE TMX LTD (TOR)	2,31	13 693	691 223	(57 932)
13/08/2026	CAD	TOURMALINE OIL CORP (TOR)	2,31	12 550	793 156	(46 470)
13/08/2026	CAD	WESTON (GEORGE) LTD (TOR)	2,31	6 712	698 115	(15 410)
13/08/2026	CAD	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,31	4 236	687 588	(14 070)
13/08/2026	CAD	WSP GLOBAL INC (TOR)	2,31	1 152	210 758	(8 580)
13/08/2026	CAD	ARITZIA INC. – ACTIONS À DROIT DE VOTE SUBORDONNÉ	2,31	7 874	1 319 142	(91 419)
13/08/2026	CAD	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	2,31	(77)	3 939	(123)
13/08/2026	CAD	DPM METALS INC	2,31	(1 120)	50 192	(1 392)
13/08/2026	CAD	ELDORADO GOLD CORP	2,31	(5 001)	215 472	(5 237)
13/08/2026	CAD	FORTIS INC (TOR)	2,31	(5 304)	422 251	(7 711)
13/08/2026	CAD	G MINING VENTURE CORP	2,31	(9 148)	340 306	(38 906)
13/08/2026	CAD	HUDBAY MINERALS INC	2,31	6 026	234 044	(32 748)
13/08/2026	CAD	MAGNA INTERNATIONAL INC	2,31	2 030	189 335	(330)
13/08/2026	CAD	MANULIFE FINANCIAL CORP (TOR)	2,31	(8 486)	477 932	(10 178)
13/08/2026	CAD	BANQUE NATIONALE DU CANADA (TOR)	2,31	(326)	69 799	(3 440)
13/08/2026	CAD	OCEANAGOLD CORP	2,31	12 608	460 685	(12 874)
13/08/2026	CAD	OU ROYALTIES INC	2,31	1 416	66 977	(3 471)
13/08/2026	CAD	TRIPLE FLAG PRECIOUS MET	-	(251)	10 661	(4)
14/08/2026	DKK	AL SYDBANK	1,78	(799)	96 358	(3 200)
14/08/2026	DKK	ALK-ABELLO A/S	1,78	1 219	70 506	(6 167)
14/08/2026	DKK	BAVARIAN NORDIC A/S (CPH)	1,78	552	21 997	(218)
14/08/2026	DKK	CARLSBERG AS-B (CPH)	1,78	(1 974)	360 631	(4 669)
14/08/2026	DKK	CHEMOMETEC A/S (CPH)	1,78	560	45 408	(1 606)
14/08/2026	DKK	D/S NORDEN (CPH)	1,78	338	23 675	(3 627)
14/08/2026	DKK	DEMANT A/S	1,78	(10 225)	555 976	(37 878)
14/08/2026	DKK	DFDS A/S	1,78	1 391	42 334	(8 721)
14/08/2026	DKK	H LUNDBECK A/S (CPH)	1,78	3 274	30 969	(935)
14/08/2026	DKK	NETCOMPANY GROUP AS	1,78	110	7 905	(828)
14/08/2026	DKK	NKT A/S	1,78	947	201 357	(1 521)
14/08/2026	DKK	NOVO NORDISK A/S-B	1,78	(50 395)	3 133 436	(293 586)
14/08/2026	DKK	NOVONESIS (NOVOZYMES) B(CPH)	1,78	(3 961)	331 810	(21 465)
14/08/2026	DKK	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,78	1 913	87 455	(1 023)
14/08/2026	DKK	SCANDINAVIAN TOBACCO GROUP A	1,78	447	6 541	(122)
14/08/2026	DKK	SCHOUW & CO	1,78	286	38 692	(2 755)
14/08/2026	DKK	TRYG A/S (CPH)	1,78	30 392	993 640	(16 260)
14/08/2026	DKK	ZEALAND PHARMA A/S	1,78	8 556	547 747	(12 602)
14/08/2026	DKK	ORSTED A/S	1,78	9 075	303 163	(15 144)
14/08/2026	DKK	TORM PLC-A	1,78	517	21 419	(2 600)
14/08/2026	EUR	A2A SPA	2,18	126 964	466 700	(3 861)
14/08/2026	EUR	ACCIONA SA	2,18	(87)	36 540	(2 293)
14/08/2026	EUR	ACCOR SA	2,18	(7 921)	607 318	(42 435)
14/08/2026	EUR	ADESSO SE	2,18	66	5 670	(296)
14/08/2026	EUR	AEDIFICA(BRU)	2,18	639	73 195	(423)
14/08/2026	EUR	AEGON LTD	2,18	(42 938)	506 707	(23 552)
14/08/2026	EUR	AIR FRANCE-KLM (PAR)	-	(6 363)	127 127	(13 567)
14/08/2026	EUR	AIXTRON SE	2,18	332	30 617	(2 404)
14/08/2026	EUR	ALMIRALL SA (MAD)	2,18	2 441	44 785	(450)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	AMADEUS IT GROUP SA (MAD)	2,18	2 791	230 112	(165)
14/08/2026	EUR	AMUNDI SA	2,18	(3 304)	441 695	(6 127)
14/08/2026	EUR	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV (BRU)	2,18	(10 272)	1 184 601	(20 161)
14/08/2026	EUR	ARCADIS NV	2,18	1 542	86 968	(3 357)
14/08/2026	EUR	ARISTON HOLDING NV	2,18	(7 003)	36 483	(4 140)
14/08/2026	EUR	ARNOLDO MONDADORI EDITORE	2,18	2 459	8 315	(323)
14/08/2026	EUR	AROWNTOWN SA	2,18	(14 992)	55 933	(249)
14/08/2026	EUR	ASR NEDERLAND NV	2,18	(5 310)	562 195	(3 890)
14/08/2026	EUR	ATOSS SOFTWARE SE	2,18	2 049	248 629	(27 629)
14/08/2026	EUR	ATRESMEDIA CORP DE MEDIOS DE	2,18	1 033	8 691	(439)
14/08/2026	EUR	AXA SA	2,18	(23 500)	1 553 515	(110 458)
14/08/2026	EUR	AZIMUT HOLDING SPA	2,18	1 482	88 044	(3 234)
14/08/2026	EUR	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,18	(123 971)	2 149 325	(23 260)
14/08/2026	EUR	BANCO SANTANDER SA (MAD)	2,18	(89 238)	1 592 566	(149 417)
14/08/2026	EUR	BARCO N.V.	2,18	3 280	45 452	(1 070)
14/08/2026	EUR	BECHTLE AG (GER)	2,18	(6 098)	302 696	(7 795)
14/08/2026	EUR	BEKAERT NV	2,18	787	52 459	(2 898)
14/08/2026	EUR	BENETEAU (PAR)	2,18	(2 122)	22 693	(54)
14/08/2026	EUR	BFF BANK SPA	2,18	(3 775)	17 419	(1 400)
14/08/2026	EUR	BOLLORE SE	2,18	34 117	289 458	(3 330)
14/08/2026	EUR	BOUYGUES SA (PAR)	2,18	19 893	1 618 891	(52 838)
14/08/2026	EUR	BPER BANCA SPA	2,18	(20 686)	436 553	(21 649)
14/08/2026	EUR	CANCOM SE (ALL)	2,18	248	10 292	(678)
14/08/2026	EUR	CAREL INDUSTRIES SPA	2,18	(795)	37 815	(3 159)
14/08/2026	EUR	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR(GER)	2,18	(7 288)	294 780	(18 912)
14/08/2026	EUR	CARREFOUR SA (PAR)	2,18	22 621	612 107	(19 209)
14/08/2026	EUR	CEMENTIR HOLDING NV	2,18	671	16 859	(1 113)
14/08/2026	EUR	CIE AUTOMOTIVE SA (MAD)	2,18	1 594	73 241	(4 738)
14/08/2026	EUR	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	2,18	(15 901)	1 958 489	(74 315)
14/08/2026	EUR	COMPAGNIE DES ALPES (PAR)	2,18	1 496	55 063	(1 858)
14/08/2026	EUR	CONTINENTAL AG (ALL)	2,18	10 386	1 214 887	(6 183)
14/08/2026	EUR	CTS EVENTIM AG & CO KGAA (GER)	2,18	(288)	23 507	(162)
14/08/2026	EUR	CTT-CORREIOS DE PORTUGAL (LIS)	2,18	7 063	68 449	(2 553)
14/08/2026	EUR	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	2,18	(13 206)	893 971	(6 125)
14/08/2026	EUR	DASSAULT AVIATION SA (PAR)	2,18	2 981	1 430 808	(49 827)
14/08/2026	EUR	DASSAULT SYSTÈMES SE (PAR)	2,18	(32 788)	912 946	(29 307)
14/08/2026	EUR	DELIVERY HERO SE	2,18	12 461	758 843	(35 813)
14/08/2026	EUR	DE'LONGHI SPA	2,18	993	59 839	(263)
14/08/2026	EUR	DERMAPHARM HOLDING SE (ALL)	2,18	348	27 391	(535)
14/08/2026	EUR	DEUTSCHE BOERSE AG (GER)	2,18	246	99 264	(4 521)
14/08/2026	EUR	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,18	(12 586)	188 639	(15 300)
14/08/2026	EUR	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,18	23 122	1 039 019	(149 582)
14/08/2026	EUR	GROUPE DHL	2,18	(8 892)	744 059	(17 957)
14/08/2026	EUR	DIASORIN SPA	2,18	(2 622)	282 100	(5 581)
14/08/2026	EUR	DUERR AG	2,18	2 187	68 502	(5 975)
14/08/2026	EUR	E.ON SE	2,18	35 879	1 068 669	(25 534)
14/08/2026	EUR	EDP SA (LIS)	2,18	(115 301)	833 294	(19 467)
14/08/2026	EUR	EDREAMS ODIGEO SL (MAD)	2,18	(10 981)	79 770	(3 756)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel	Non réalisé
			%		montant	gain (perte)
					\$	\$
14/08/2026	EUR	EL.EN. SPA	2,18	(5 395)	143 671	(5 002)
14/08/2026	EUR	ELISA OYJ	2,18	11 514	751 097	(68 949)
14/08/2026	EUR	ENAGAS SA (MAD)	2,18	17 494	504 932	(11 616)
14/08/2026	EUR	ENGIE	2,18	6 224	277 019	(8)
14/08/2026	EUR	ENI SPA	2,18	92 492	3 409 486	(331 338)
14/08/2026	EUR	EURONEXT NV (PAR)	2,18	106	25 376	(1 437)
14/08/2026	EUR	EVOTEC SE	2,18	(4 712)	36 349	(1 809)
14/08/2026	EUR	FAGRON (BRU)	2,18	788	31 554	(922)
14/08/2026	EUR	FDJ UNITED	2,18	845	31 881	(2 798)
14/08/2026	EUR	FERRARI NV (MIL)	2,18	(708)	351 486	(18 547)
14/08/2026	EUR	FERROVIAL SE	2,18	(4 045)	378 613	(13 126)
14/08/2026	EUR	FIELMANN GROUP AG	2,18	1 311	96 826	(6 330)
14/08/2026	EUR	FILA SPA	2,18	1 165	17 303	(12)
14/08/2026	EUR	FINCANTIERI SPA	2,18	43 693	811 527	(110 662)
14/08/2026	EUR	FLOW TRADERS LTD	2,18	430	18 311	(404)
14/08/2026	EUR	FLUIDRA SA	2,18	(5 266)	160 258	(8 053)
14/08/2026	EUR	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	2,18	1 251	80 291	(613)
14/08/2026	EUR	GAZTRANSPORT ET TECHNIGA SA	2,18	2 046	672 634	(45 440)
14/08/2026	EUR	GERRESHEIMER AG	2,18	(4 878)	198 091	(22 679)
14/08/2026	EUR	GESTAMP AUTOMOCION SA	2,18	14 235	72 662	(6 287)
14/08/2026	EUR	GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV (BRU)	2,18	99	12 878	(151)
14/08/2026	EUR	HARVIA OYJ	2,18	(438)	28 664	(779)
14/08/2026	EUR	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	2,18	(8 493)	958 438	(50 228)
14/08/2026	EUR	HERA SPA	2,18	85 433	523 859	(1 846)
14/08/2026	EUR	HIAB OYJ	2,18	(287)	25 376	(313)
14/08/2026	EUR	HORNBACH HOLDING AG & CO KGA	2,18	176	22 438	(153)
14/08/2026	EUR	HUGO BOSS AG -ORD	2,18	1 407	89 917	(4 765)
14/08/2026	EUR	HUHTAMAKI OYJ (HEL)	2,18	1 120	48 418	(941)
14/08/2026	EUR	IMERYS SA (PAR)	2,18	856	30 884	(1 781)
14/08/2026	EUR	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2,18	14 633	1 324 357	(23 256)
14/08/2026	EUR	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,18	(7 355)	952 681	(16 312)
14/08/2026	EUR	INTESA SANPAOLO (MIL)	2,18	(71 676)	677 229	(14 052)
14/08/2026	EUR	IPSOS(PAR)	2,18	107	6 686	(675)
14/08/2026	EUR	IREN SPA	2,18	1 740	7 770	(485)
14/08/2026	EUR	ITALGAS SPA	2,18	18 498	318 730	(16 358)
14/08/2026	EUR	JERONIMO MARTINS	2,18	10 819	310 870	(18 467)
14/08/2026	EUR	JUNGHEINRICH - PRFD	2,18	(397)	14 490	(311)
14/08/2026	EUR	K+S AG-REG (GER)	2,18	3 635	80 335	(2 812)
14/08/2026	EUR	KAUFMAN & BROAD SA (PAR)	2,18	3 103	121 743	(1 375)
14/08/2026	EUR	KEMIRA OYJ	2,18	694	19 077	(709)
14/08/2026	EUR	KLEPIERRE (PAR)	2,18	292	17 249	(14)
14/08/2026	EUR	KNORR-BREMSE AG (ALL)	2,18	4 931	812 142	(3 969)
14/08/2026	EUR	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,18	29 426	1 731 505	(59 946)
14/08/2026	EUR	KONINKLIJKE KPN NV (EOE)	2,18	201 745	1 453 860	(49 428)
14/08/2026	EUR	LEONARDO SPA	2,18	7 291	630 852	(72 756)
14/08/2026	EUR	LOGISTA INTEGRAL SA	2,18	3 613	199 914	(3 277)
14/08/2026	EUR	LOTTOMATICA GROUP SPA	2,18	1 342	59 773	(7 190)
14/08/2026	EUR	LVMH MOËT HENNESSY LOUIS VUI (PAR)	2,18	689	569 180	(31 196)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	MAIRE SPA	2,18	7 790	190 059	(10 146)
14/08/2026	EUR	MANDATUM OYJ	2,18	5 906	52 411	(108)
14/08/2026	EUR	MELEXIS NV	2,18	284	37 034	(1 254)
14/08/2026	EUR	MERCK KGAA (ALL)	2,18	(8 783)	1 904 384	(178 609)
14/08/2026	EUR	METSO CORP	2,18	(20 928)	501 116	(12 206)
14/08/2026	EUR	MICHELIN (CGDE) (PAR)	2,18	(16 989)	910 898	(14 165)
14/08/2026	EUR	MONTEA NV	2,18	70	7 588	(34)
14/08/2026	EUR	MTU AERO ENGINES AG (ALL)	2,18	(2 391)	1 206 934	(197 561)
14/08/2026	EUR	NEINOR HOMES SA	2,18	(5 964)	148 017	(10 364)
14/08/2026	EUR	NEMETSCHEK SE	2,18	2 866	261 054	(15 678)
14/08/2026	EUR	NEXANS SA (PAR)	2,18	133	31 395	(229)
14/08/2026	EUR	NEXI SPA	2,18	(11 166)	61 332	(2 628)
14/08/2026	EUR	NEXITY	2,18	(3 433)	43 490	(5)
14/08/2026	EUR	NOKIAN RENKAAT OYJ	2,18	(2 804)	52 624	(1 631)
14/08/2026	EUR	NOS SGPS	2,18	7 034	61 453	(4 223)
14/08/2026	EUR	ONTEX GROUP NV	2,18	1 950	7 777	(182)
14/08/2026	EUR	ORANGE	2,18	58 334	1 683 170	(94 774)
14/08/2026	EUR	ORION OYJ - CLASSE B (HEL)	2,18	(445)	50 528	(1 306)
14/08/2026	EUR	OUTOKUMPU OYJ	2,18	4 972	48 587	(8 231)
14/08/2026	EUR	OVS SPA	2,18	10 334	107 003	(4 246)
14/08/2026	EUR	PERNOD RICARD SA (PAR)	2,18	(17 299)	1 775 552	(7 086)
14/08/2026	EUR	PHARMA MAR SA	2,18	(149)	16 151	(1 990)
14/08/2026	EUR	PHARMING GROUP NV	2,18	(16 269)	29 335	(2 288)
14/08/2026	EUR	POSTNL NV (EOE)	2,18	22 323	35 376	(2 274)
14/08/2026	EUR	PROSUS NV (EOE)	2,18	15 167	964 242	(34 891)
14/08/2026	EUR	PRYSMIAN SPA (MIL)	2,18	(2 421)	563 644	(7 045)
14/08/2026	EUR	RAI WAY SPA (MIL)	2,18	1 840	16 701	(1 689)
14/08/2026	EUR	RATIONAL AG	2,18	427	449 391	(8 264)
14/08/2026	EUR	RECTICEL	2,18	(900)	15 580	(353)
14/08/2026	EUR	REDCARE PHARMACY NV	-	(590)	46 601	(16 701)
14/08/2026	EUR	RENAULT SA (PAR)	2,18	4 974	223 476	(22 554)
14/08/2026	EUR	REPLY SPA (MIL)	2,18	1 876	302 401	(25 647)
14/08/2026	EUR	REPSOL SA	2,18	35 194	1 291 870	(42 047)
14/08/2026	EUR	IMMOBILIER COMMERCIAL	2,18	798	91 408	(2 985)
14/08/2026	EUR	REVENIO GROUP OYJ	2,18	405	8 230	(257)
14/08/2026	EUR	RHEINMETALL AG	2,18	1 155	2 211 548	(366 724)
14/08/2026	EUR	RWE AG (ALL)	2,18	17 251	1 603 722	(28 267)
14/08/2026	EUR	SACYR SA	2,18	(851)	6 380	(167)
14/08/2026	EUR	SAFILO GROUP SPA (MIL)	2,18	13 517	38 511	(1 160)
14/08/2026	EUR	SAIPEM SPA (MIL)	2,18	77 232	589 774	(40 356)
14/08/2026	EUR	SALVATORE FERRAGAMO SPA	2,18	(3 692)	56 925	(8 042)
14/08/2026	EUR	SANOFI	2,18	6 400	788 649	(12 391)
14/08/2026	EUR	SAP SE (ALL)	2,18	6 738	1 525 787	(68 680)
14/08/2026	EUR	SCHAEFFLER AG (GER)	2,18	2 867	44 530	(5 413)
14/08/2026	EUR	SCHNEIDER ELECTRIC SE (PAR)	2,18	(3 249)	1 394 557	(102 359)
14/08/2026	EUR	SCHOTT PHARMA AG & CO KGAA	2,18	472	13 455	(284)
14/08/2026	EUR	SCOR SE (PAR)	2,18	(12 465)	626 725	(11 978)
14/08/2026	EUR	SCOUT24 SE	2,18	3 791	456 633	(6 979)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	EUR	SGL CARBON SE	2,18	2 017	16 904	(2 476)
14/08/2026	EUR	SHURGARD SELF STORAGE LTD	2,18	(188)	7 315	(463)
14/08/2026	EUR	SIEMENS AG-REG	2,18	(5 999)	2 567 165	(155 619)
14/08/2026	EUR	SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	2,18	(560)	44 848	(12 134)
14/08/2026	EUR	SODEXO SA (PAR)	2,18	(3 526)	287 516	(657)
14/08/2026	EUR	SOL SPA	2,18	99	9 770	(477)
14/08/2026	EUR	SONAE	2,18	(2 234)	7 164	(103)
14/08/2026	EUR	STROEER SE & CO KGAA	2,18	310	17 163	(114)
14/08/2026	EUR	SUEDZUCKER AG	-	735	13 414	(942)
14/08/2026	EUR	SYMRISE AG	2,18	(2 739)	364 261	(23 792)
14/08/2026	EUR	TAG IMMOBILIEN AG (GER)	2,18	(12 354)	267 032	(18 849)
14/08/2026	EUR	TECHNIP ENERGIES NV	2,18	11 941	688 750	(50 955)
14/08/2026	EUR	TECHNOGYM SPA	2,18	6 613	179 852	(17 817)
14/08/2026	EUR	TECNICAS REUNIDAS SA	2,18	722	37 497	(3 851)
14/08/2026	EUR	TELEFONICA SA	2,18	24 174	154 292	(12 144)
14/08/2026	EUR	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)(PAR)	2,18	540	5 958	(158)
14/08/2026	EUR	THALES SA	2,18	5 160	1 959 350	(88 512)
14/08/2026	EUR	TOMTOM NV (EOE)	2,18	10 684	89 366	(9 395)
14/08/2026	EUR	TOTALENERGIES SE	2,18	15 067	1 856 606	(185 642)
14/08/2026	EUR	TUI AG (GER)	2,18	(5 247)	60 103	(1 289)
14/08/2026	EUR	UCB SA (BRU)	2,18	2 168	962 212	(45 708)
14/08/2026	EUR	UNICAJA BANCO SA	2,18	(5)	24	(1)
14/08/2026	EUR	UNITED INTERNET AG - ACTION ORDINAIRE (ALL)	2,18	295	12 581	(1 643)
14/08/2026	EUR	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,18	(18 294)	530 278	(11 480)
14/08/2026	EUR	VALEO	2,18	19 529	459 087	(55 545)
14/08/2026	EUR	VALLOUREC SA (PAR)	2,18	3 503	139 477	(23 690)
14/08/2026	EUR	VAN LANSCHOT KEMPEN NV	2,18	72	7 886	(169)
14/08/2026	EUR	VGP	2,18	(666)	88 141	(2 380)
14/08/2026	EUR	VIRBAC SA (PAR)	2,18	15	8 445	(402)
14/08/2026	EUR	VOPAK	2,18	308	22 811	(64)
14/08/2026	EUR	VUSIONGROUP	2,18	546	116 958	(6 022)
14/08/2026	EUR	WACKER NEUSON SE	2,18	(911)	26 678	(836)
14/08/2026	EUR	WIIT SPA (MIL)	2,18	328	18 812	(559)
14/08/2026	EUR	WOLTERS KLUWER (EOE)	2,18	3 406	336 694	(19 257)
14/08/2026	EUR	ZALANDO SE	2,18	(8 209)	327 118	(8 782)
14/08/2026	EUR	ADP(PAR)	2,18	(180)	33 190	(52)
14/08/2026	EUR	AIRBUS SE	2,18	(2 450)	714 541	(55 512)
14/08/2026	EUR	ALSTOM	2,18	(1 934)	47 568	(105)
14/08/2026	EUR	ALTAREA	2,18	(251)	36 842	(5 476)
14/08/2026	EUR	AMPLIFON SPA	2,18	9 166	157 935	(17 897)
14/08/2026	EUR	AUMOVIO SE	2,18	1 136	71 679	(5 726)
14/08/2026	EUR	BANCA GENERALI SPA (MIL)	2,18	(1 262)	126 253	(6 752)
14/08/2026	EUR	BUREAU VERITAS SA	2,18	(3 666)	153 946	(4 871)
14/08/2026	EUR	CARMILA	2,18	1 448	40 013	(1 092)
14/08/2026	EUR	CEWE STIFTUNG & CO KGAA (GER)	2,18	69	10 884	(729)
14/08/2026	EUR	CORTICEIRA AMORIM SA (LIS)	2,18	1 275	13 553	(389)
14/08/2026	EUR	DANIELI & CO	2,18	754	91 553	(9 639)
14/08/2026	EUR	DRAEGERWERK AG - PREF(GER)	2,18	154	21 851	(1 334)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel	Non réalisé
			%		montant	gain (perte)
					\$	\$
14/08/2026	EUR	ELIA GROUP SA/NV	2,18	(178)	39 137	(1 058)
14/08/2026	EUR	EUROFINS SCIENTIFIC (PAR)	2,18	(484)	50 178	(3 427)
14/08/2026	EUR	EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,18	7 677	36 479	(6 594)
14/08/2026	EUR	EXOR NV	2,18	(541)	58 631	(33)
14/08/2026	EUR	GIMV NV	2,18	(242)	17 775	(310)
14/08/2026	EUR	GRIFOLS SA	2,18	(3 147)	45 913	(133)
14/08/2026	EUR	ACTION KALMAR OYJ-B	2,18	566	37 270	(2 201)
14/08/2026	EUR	KEMPOWER OYJ	2,18	744	15 191	(457)
14/08/2026	EUR	KION GROUP AG (GER)	2,18	(2 680)	162 824	(5 077)
14/08/2026	EUR	KONINKLIJKE PHILIPS NV (EOE)	2,18	(2 555)	94 290	(3 779)
14/08/2026	EUR	LISI	2,18	707	75 265	(336)
14/08/2026	EUR	LU-VE SPA	2,18	261	28 588	(586)
14/08/2026	EUR	MAPFRE SA (MAD)	2,18	(2 322)	15 499	(756)
14/08/2026	EUR	MBB SE	2,18	28	7 928	(119)
14/08/2026	EUR	MEDINCELL SA	2,18	(209)	9 272	(427)
17/04/2031	EUR	METLEN ENERGY & METALS	2,18	(696)	46 487	(942)
14/08/2026	EUR	NATURGY ENERGY GROUP SA (MAD)	2,18	18 394	869 209	(53 888)
14/08/2026	EUR	NEWPRINCES SPA	2,18	(3 186)	79 535	(573)
14/08/2026	EUR	PATRIZIA SE	2,18	(599)	7 578	(176)
14/08/2026	EUR	PLUXEE NV	2,18	(1 316)	23 740	(657)
14/08/2026	EUR	REXEL SA (PAR)	2,18	(2 435)	145 838	(4 657)
14/08/2026	EUR	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,18	(179)	51 797	(804)
14/08/2026	EUR	SILTRONIC AG (ALL)	2,18	605	91 912	(12 420)
14/08/2026	EUR	AVIO SPA	2,18	1 335	80 801	(13 114)
14/08/2026	EUR	UBISOFT ENTERTAINMENT (PAR)	2,18	(6 438)	50 174	(5 774)
14/08/2026	EUR	VEOLIA ENVIRONNEMENT (PAR)	2,18	(2 203)	126 387	(3 264)
14/08/2026	EUR	VIVENDI SE (PAR)	2,18	(5 043)	17 612	(16)
14/08/2026	EUR	WACKER CHEMIE AG (GER)	2,18	629	95 142	(2 802)
13/08/2030	HKD	AIA GROUP LTD (HKG)	3,84	(61 600)	775 299	(9 277)
13/08/2030	HKD	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD (HKG)	3,84	17 000	136 867	(5 700)
13/08/2030	HKD	CK ASSET HOLDINGS LTD	3,84	73 500	589 711	(12 845)
13/08/2030	HKD	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD (HKG)	3,84	28 500	335 981	(681)
13/08/2030	HKD	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L (HKG)	3,84	22 000	122 141	(7 311)
13/08/2030	HKD	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,84	1 600	108 859	(5 796)
13/08/2030	HKD	SUN HUNG KAI PROPERTIES (HKG)	3,84	50 000	1 033 857	(37 252)
13/08/2030	HKD	WH GROUP LTD	3,84	47 000	73 077	(3 891)
14/08/2026	JPY	77 BANK LTD/THE	0,98	(2 200)	62 731	(1 872)
14/08/2026	JPY	ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT	0,98	31	41 153	(520)
14/08/2026	JPY	AEON CO LTD (TYO)	0,98	197 400	2 391 384	(84 597)
14/08/2026	JPY	AEON FINANCIAL SERVICE CO LT	0,98	1 800	23 715	(718)
14/08/2026	JPY	AEON HOKKAIDO CORP	0,98	800	5 907	(99)
14/08/2026	JPY	AI HOLDINGS CORP	0,98	(1 300)	30 567	(574)
14/08/2026	JPY	AICHI CORP	0,98	(8 900)	104 866	(85)
14/08/2026	JPY	AICHI FINANCIAL GROUP INC	0,98	1 500	17 897	(528)
14/08/2026	JPY	AISAN INDUSTRY CO LTD	0,98	(2 300)	36 314	(1 747)
14/08/2026	JPY	AISIN CORP	0,98	8 300	161 811	(3 611)
14/08/2026	JPY	ALPEN CO LTD (TYO)	0,98	2 100	38 655	(678)
14/08/2026	JPY	ANRITSU CORP	0,98	(300)	10 165	(1 412)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	ANYCOLOR INC	0,98	(300)	5 931	(59)
14/08/2026	JPY	APPIER GROUP INC	0,98	(8 700)	60 898	(336)
14/08/2026	JPY	ASAHI KASEI CORP	0,98	99 500	1 553 191	(100)
14/08/2026	JPY	ASAHI YUKIZAI CORP	0,98	(300)	18 538	(349)
14/08/2026	JPY	ASICS CORP (TYO)	0,98	9 200	357 323	(5 045)
14/08/2026	JPY	AZ-COM MARUWA HOLDINGS INC	0,98	(3 200)	20 947	(1 520)
14/08/2026	JPY	BELLUNA CO LTD	0,98	(7 500)	61 598	(563)
14/08/2026	JPY	BIC CAMERA INC	0,98	4 900	74 928	(4 339)
14/08/2026	JPY	BIPROGY INC	0,98	800	30 415	(213)
14/08/2026	JPY	BROTHER INDUSTRIES LTD	0,98	20 400	671 606	(18 940)
14/08/2026	JPY	CANON INC	0,98	48 000	1 790 139	(23 214)
14/08/2026	JPY	CAPCOM CO LTD	0,98	(55 000)	1 345 045	(106 061)
14/08/2026	JPY	CCI GROUP INC	0,98	(5 500)	47 476	(1 454)
14/08/2026	JPY	CHIBA BANK LTD/THE	0,98	(13 500)	286 380	(7 781)
14/08/2026	JPY	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD (TYO)	0,98	(9 200)	598 214	(11 360)
14/08/2026	JPY	CHUGIN FINANCIAL GROUP INC	0,98	(1 200)	32 458	(296)
14/08/2026	JPY	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO	0,98	(5 400)	41 965	(653)
14/08/2026	JPY	CKD CORP (TYO)	0,98	(700)	40 568	(5 038)
14/08/2026	JPY	COLOWIDE CO LTD	0,98	2 500	40 214	(69)
14/08/2026	JPY	COMFORIA RESIDENTIAL REIT EN	0,98	29	26 222	(115)
14/08/2026	JPY	CRE LOGISTICS REIT INC	0,98	(31)	38 502	(383)
14/08/2026	JPY	CREDIT SAISON CO LTD	0,98	(800)	29 480	(2 112)
14/08/2026	JPY	CYBERAGENT INC (TYO)	0,98	70 600	840 489	(2 460)
14/08/2026	JPY	CYBOZU INC (TYO)	0,98	2 000	40 026	(654)
14/08/2026	JPY	DAIFUKU CO LTD (TYO)	-	(6 500)	382 229	(23 127)
14/08/2026	JPY	DAIICHI SANKYO CO LTD	0,98	(48 200)	1 055 220	(48 600)
14/08/2026	JPY	DAIO PAPER CORP	0,98	8 700	70 618	(462)
14/08/2026	JPY	DAISEKI CO LTD (TYO)	0,98	(1 100)	37 059	(646)
14/08/2026	JPY	DAIWA SECURITIES GROUP INC (TYO)	0,98	(11 400)	156 163	(2 504)
14/08/2026	JPY	DCM HOLDINGS CO LTD	0,98	(1 100)	14 372	(259)
14/08/2026	JPY	DEXERIALS CORP	0,98	(4 400)	154 342	(10 072)
14/08/2026	JPY	DIGITAL GARAGE INC	0,98	(4 400)	70 086	(2 909)
14/08/2026	JPY	DISCO CORP	-	(1 000)	713 210	(3 104)
14/08/2026	JPY	DOSHISHA CO LTD (TYO)	0,98	3 200	80 828	(120)
14/08/2026	JPY	EAGLE INDUSTRY CO LTD	0,98	(300)	7 400	(58)
14/08/2026	JPY	EARTH CORP	0,98	600	24 639	(115)
14/08/2026	JPY	EBARA CORP (TYO)	0,98	(58 700)	2 820 896	(398 977)
14/08/2026	JPY	EISAI CO LTD (TYO)	0,98	(7 100)	234 241	(20 825)
14/08/2026	JPY	EIZO CORP	0,98	400	8 714	(41)
14/08/2026	JPY	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT C (TYO)	0,98	1 800	63 564	(5 414)
14/08/2026	JPY	ENEOS HOLDINGS INC	0,98	103 400	1 114 405	(22 492)
14/08/2026	JPY	ES-CON JAPAN LTD	0,98	(10 500)	101 724	(65)
14/08/2026	JPY	EXEDY CORP (TYO)	0,98	1 100	57 029	(133)
14/08/2026	JPY	EZAKI GLICO CO LTD (TYO)	0,98	500	23 758	(290)
14/08/2026	JPY	FAST RETAILING CO LTD	0,98	(1 000)	702 863	(19 422)
14/08/2026	JPY	FERROTEC CORP	0,98	(500)	39 712	(2 578)
14/08/2026	JPY	FOOD & LIFE COMPANIES LTD	0,98	400	17 433	(414)
14/08/2026	JPY	FRONTIER REAL ESTATE INVEST (TYO)	0,98	(117)	83 225	(956)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	FUJI CO LTD	0,98	1 000	17 351	(23)
14/08/2026	JPY	FUJI OIL CO LTD /OSAKA	0,98	(3 100)	101 219	(6 489)
14/08/2026	JPY	FUJIFILM HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	(50 900)	1 510 905	(44 121)
14/08/2026	JPY	FUJIKURA LTD (TYO)	0,98	(19 300)	716 922	(338 610)
14/08/2026	JPY	FUJIMI INC	0,98	(2 300)	83 208	(9 110)
14/08/2026	JPY	FUJITSU LIMITED	0,98	5 900	167 874	(1 153)
14/08/2026	JPY	FUKUDA DENSHI CO LTD (TYO)	0,98	500	50 186	(569)
14/08/2026	JPY	FURUKAWA ELECTRIC CO LTD	0,98	(14 000)	514 304	(67 039)
14/08/2026	JPY	FUTURE CORP	0,98	(3 800)	49 683	(1 849)
14/08/2026	JPY	FUYO GENERAL LEASE CO LTD	0,98	(2 400)	89 737	(172)
14/08/2026	JPY	GENDA INC	0,98	(10 500)	54 253	(1 012)
14/08/2026	JPY	GMO FINANCIAL HOLDINGS INC	0,98	1 300	11 392	(5)
14/08/2026	JPY	GMO INTERNET GROUP INC	-	(5 400)	145 305	(11 333)
14/08/2026	JPY	GNI GROUP LTD	0,98	(1 900)	41 789	(5 494)
14/08/2026	JPY	GOLDWIN INC	0,98	2 500	47 371	(4)
14/08/2026	JPY	GS YUASA CORP (TYO)	0,98	(1 100)	59 496	(3 085)
14/08/2026	JPY	GUNGHO ONLINE ENTERTAINMENT	0,98	4 200	81 673	(1 514)
14/08/2026	JPY	H I S CO LTD	0,98	2 800	24 903	(1 062)
14/08/2026	JPY	HALOWS CO LTD (TYO)	0,98	700	23 583	(889)
14/08/2026	JPY	HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC	0,98	17 800	720 704	(51 059)
14/08/2026	JPY	HARMONIC DRIVE SYSTEMS INC (TYO)	0,98	(1 700)	97 186	(18 540)
14/08/2026	JPY	HEIWADO CO LTD (TYO)	0,98	300	6 719	(109)
14/08/2026	JPY	HIDAY HIDAKA CORP	0,98	1 000	22 806	(570)
14/08/2026	JPY	HISAMITSU PHARMACEUTICAL CO (TYO)	0,98	900	47 445	(71)
14/08/2026	JPY	HITACHI LTD (TYO)	0,98	48 900	1 976 639	(71 173)
14/08/2026	JPY	HOKUETSU CORP	0,98	800	6 487	(301)
14/08/2026	JPY	HOKUHOKU FINANCIAL GROUP INC	0,98	(1 000)	56 775	(2 097)
14/08/2026	JPY	HOSHINO RESORTS REIT INC (TYO)	0,98	(32)	66 416	(685)
14/08/2026	JPY	HOSIDEN CORP	0,98	800	18 915	(933)
14/08/2026	JPY	HOYA CORP	0,98	4 600	1 060 726	(20 367)
14/08/2026	JPY	HULIC CO LTD (TYO)	0,98	600	9 036	(4)
14/08/2026	JPY	HYAKUGO BANK LTD/THE (TYO)	0,98	(2 600)	44 137	(967)
14/08/2026	JPY	IBIDEN CO LTD (TYO)	0,98	(6 700)	1 117 209	(274 031)
14/08/2026	JPY	IDEMITSU KOSAN CO LTD (TYO)	0,98	65 300	749 181	(67 474)
14/08/2026	JPY	IDOM INC	0,98	(3 800)	43 978	(1 097)
14/08/2026	JPY	IHI CORP (TYO)	0,98	(80 200)	1 700 957	(197 909)
14/08/2026	JPY	INDUSTRIE ET INFRASTRUCTURES	0,98	51	63 252	(182)
14/08/2026	JPY	INVINCIBLE INVESTMENT CORP	0,98	(14)	7 466	(56)
14/08/2026	JPY	ISETAN MITSUKOSHI HOLDINGS L(TYO)	0,98	(9 500)	313 741	(27 518)
14/08/2026	JPY	ISUZU MOTORS LTD (TYO)	0,98	(35 300)	658 307	(11 086)
14/08/2026	JPY	ITOCHU CORP (TYO)	-	94 700	1 546 520	(16 943)
14/08/2026	JPY	ITOKI CORP	0,98	(2 000)	42 558	(3 546)
14/08/2026	JPY	IWATANI CORP (TYO)	0,98	(400)	6 457	(168)
14/08/2026	JPY	IYOGIN HOLDINGS INC	0,98	(3 000)	81 277	(1 101)
14/08/2026	JPY	JACCS CO LTD	0,98	(700)	21 811	(291)
14/08/2026	JPY	JAPAN AVIATION ELECTRONICS	0,98	(600)	12 045	(49)
14/08/2026	JPY	JAPAN EXCELLENT INC (TYO)	0,98	(11)	13 278	(144)
14/08/2026	JPY	JAPAN POST BANK CO LTD	0,98	77 800	2 172 586	(57 426)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	0,98	88 300	1 782 689	(97 181)
14/08/2026	JPY	JAPAN PULP & PAPER CO LTD	0,98	1 200	11 469	(112)
14/08/2026	JPY	JAPAN SECURITIES FINANCE CO	0,98	(4 000)	80 856	(680)
14/08/2026	JPY	JAPAN STEEL WORKS LTD	0,98	(1 700)	112 009	(2 378)
14/08/2026	JPY	JAPAN TOBACCO INC	0,98	17 100	921 906	(9 728)
14/08/2026	JPY	JAPAN WOOL TEXTILE CO LTD	0,98	1 600	24 033	(33)
14/08/2026	JPY	JFE HOLDINGS INC	0,98	78 800	1 109 362	(13 362)
14/08/2026	JPY	JGC HOLDINGS CORP	0,98	5 500	121 858	(1 609)
14/08/2026	JPY	JMDC INC	0,98	(2 800)	64 224	(6 036)
14/08/2026	JPY	JTEKT CORP	0,98	3 000	52 145	(79)
14/08/2026	JPY	JUSTSYSTEMS CORP	0,98	400	13 249	(453)
14/08/2026	JPY	JVCKENWOOD CORP	0,98	(3 200)	30 108	(1 271)
14/08/2026	JPY	K&O ENERGY GROUP INC	0,98	400	6 886	(213)
14/08/2026	JPY	KADOKAWA CORP	0,98	(2 800)	82 333	(2 295)
14/08/2026	JPY	KANADEVIA CORP	0,98	(2 200)	24 693	(112)
14/08/2026	JPY	KANAMOTO CO LTD	0,98	3 100	147 459	(2 651)
14/08/2026	JPY	KANEMATSU CORP (TYO)	0,98	5 200	94 719	(1 296)
14/08/2026	JPY	KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES (TYO)	0,98	(45 100)	1 115 550	(41 249)
14/08/2026	JPY	KAWASAKI KISEN KAISHA LTD (TYO)	0,98	28 300	647 761	(31 613)
14/08/2026	JPY	KEEPER TECHNICAL LABORATORY	0,98	(900)	21 397	(475)
14/08/2026	JPY	KEIHAN HOLDINGS CO LTD	0,98	(4 100)	114 332	(2 939)
14/08/2026	JPY	KEIHANSHIN BUILDING CO LTD	0,98	(1 600)	14 726	(521)
14/08/2026	JPY	KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO	0,98	(81 100)	770 481	(57 620)
14/08/2026	JPY	KH NEOCHEM CO LTD	0,98	(500)	11 639	(1 523)
14/08/2026	JPY	KIKKOMAN CORP (TYO)	0,98	(48 300)	686 722	(20 393)
14/08/2026	JPY	KOBE BUSSAN CO LTD	0,98	51 700	1 225 330	(35 066)
14/08/2026	JPY	KOBE STEEL LTD (TYO)	0,98	40 200	679 448	(23 442)
14/08/2026	JPY	KOHNAN SHOJI CO LTD	0,98	(500)	18 263	(75)
14/08/2026	JPY	KOKUSAI ELECTRIC CORP	0,98	(5 800)	449 272	(101 207)
14/08/2026	JPY	KOKUYO CO LTD	0,98	2 600	18 622	(324)
14/08/2026	JPY	KOMATSU LTD	0,98	4 200	239 190	(6 415)
14/08/2026	JPY	KONICA MINOLTA INC	0,98	9 400	47 396	(2 397)
14/08/2026	JPY	KONISHI CO LTD (TYO)	0,98	(800)	10 055	(384)
14/08/2026	JPY	KOSHIDAKA HOLDINGS CO LTD	0,98	2 600	22 035	(282)
14/08/2026	JPY	K'S HOLDINGS CORP	0,98	1 300	23 147	(1 314)
14/08/2026	JPY	KUBOTA CORP (TYO)	0,98	(55 000)	1 299 556	(352)
14/08/2026	JPY	KYOCERA CORP (TYO)	0,98	51 600	1 653 281	(43 584)
14/08/2026	JPY	KYOKUTO KAIHATSU KOGYO CO	0,98	(2 600)	47 518	(2 019)
14/08/2026	JPY	KYORITSU MAINTENANCE CO LTD	0,98	(4 200)	96 134	(15 972)
14/08/2026	JPY	KYUSHU FINANCIAL GROUP INC	0,98	600	7 567	(53)
14/08/2026	JPY	LASERTEC CORP	0,98	(2 500)	960 076	(128 969)
14/08/2026	JPY	M&A CAPITAL PARTNERS CO LTD (TYO)	0,98	300	9 073	(144)
14/08/2026	JPY	M3 INC	0,98	(85 200)	1 197 232	(151 540)
14/08/2026	JPY	MACNICA HOLDINGS INC	0,98	(1 400)	38 735	(62)
14/08/2026	JPY	MAEDA KOSEN CO LTD (TYO)	-	(1 800)	27 289	(552)
14/08/2026	JPY	MARUBENI CORP	0,98	24 000	1 026 199	(45 095)
14/08/2026	JPY	MARUWA CO LTD (TYO)	0,98	(200)	114 790	(8 793)
14/08/2026	JPY	MCDONALD'S HOLDINGS CO JAPAN	0,98	12 100	792 062	(3 296)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	MEGACHIPS CORP (TYO)	0,98	1 400	137 099	(8 752)
14/08/2026	JPY	MEGMILK SNOW BRAND CO LTD	0,98	(2 400)	75 724	(371)
14/08/2026	JPY	MEIDENSHA CORP	0,98	(100)	7 768	(149)
14/08/2026	JPY	MEIKO ELECTRONICS CO LTD	0,98	(300)	80 777	(330)
14/08/2026	JPY	MENICON CO LTD	0,98	(4 700)	67 480	(1 143)
14/08/2026	JPY	MERCARI INC	0,98	(5 400)	175 799	(16 829)
14/08/2026	JPY	MICRONICS JAPAN CO LTD	0,98	(500)	65 722	(6 840)
14/08/2026	JPY	MIRAI CORP	0,98	45	17 046	(195)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI CORP (TYO)	0,98	39 700	1 588 690	(72 507)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI ESTATE CO LTD (TYO)	0,98	1 400	51 224	(326)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI ESTATE LOGISTICS	0,98	55	57 413	(133)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI HC CAPITAL INC	0,98	25 400	292 409	(1 648)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI LOGISNEXT CO LTD	0,98	1 200	16 014	(24)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI MATERIALS CORP (TYO)	0,98	1 000	40 498	(2 897)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI PENCIL CO LTD	0,98	(2 300)	52 374	(2 295)
14/08/2026	JPY	INSTITUT DE RECHERCHE MITSUBISHI	0,98	200	7 960	(221)
14/08/2026	JPY	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	0,98	(49 500)	1 371 349	(13 451)
14/08/2026	JPY	MITSUMI FUDOSAN HÉBERGEMENT	0,98	22	23 637	(265)
14/08/2026	JPY	MITSUMI FUDOSAN CO LTD (TYO)	0,98	3 300	44 821	(1 063)
14/08/2026	JPY	MIZUHO LEASING CO LTD	0,98	(700)	7 765	(60)
14/08/2026	JPY	MODEC INC	0,98	500	42 025	(1 137)
14/08/2026	JPY	MONOGATARI CORP	0,98	(700)	28 898	(249)
14/08/2026	JPY	MORINAGA & CO LTD	0,98	(300)	6 697	(185)
14/08/2026	JPY	MORINAGA MILK INDUSTRY CO	0,98	(800)	8 889	(47)
14/08/2026	JPY	MUSASHINO BANK LTD/THE	0,98	(600)	13 160	(141)
14/08/2026	JPY	NAKANISHI INC (TYO)	0,98	2 800	73 681	(60)
14/08/2026	JPY	NANKAI ELECTRIC RAILWAY CO	0,98	(300)	7 244	(259)
14/08/2026	JPY	NEXON CO LTD (TYO)	0,98	46 300	882 564	(5 160)
14/08/2026	JPY	NEXTAGE CO LTD	0,98	(1 800)	56 164	(7 808)
14/08/2026	JPY	NHK SPRING CO LTD	0,98	(2 700)	86 509	(5 712)
14/08/2026	JPY	NIDEC CORP	0,98	(24 300)	557 159	(3 306)
14/08/2026	JPY	NIHON M&A CENTER HOLDINGS EN	0,98	(1 100)	6 106	(139)
14/08/2026	JPY	NINTENDO CO LTD	0,98	44 900	2 776 079	(99 148)
14/08/2026	JPY	NIPPON KAYAKU CO LTD	0,98	900	16 417	(475)
14/08/2026	JPY	NIPPON LIGHT METAL HOLDINGS (TYO)	0,98	1 300	34 493	(3 106)
14/08/2026	JPY	NIPPON PAINT HOLDINGS CO LTD	0,98	(97 200)	853 872	(45 273)
14/08/2026	JPY	NIPPON SANSO HOLDINGS CORP	0,98	(12 900)	608 327	(69 585)
14/08/2026	JPY	NIPPON SHINYAKU CO LTD	0,98	(1 300)	44 739	(1 105)
14/08/2026	JPY	NIPPON SODA CO LTD	0,98	(200)	6 214	(101)
14/08/2026	JPY	NIPPON STEEL CORP	0,98	277 700	1 336 943	(11 509)
14/08/2026	JPY	NIPPON TELEVISION HOLDINGS (TYO)	0,98	7 800	192 763	(660)
14/08/2026	JPY	NIPPON YUSEN KK (TYO)	0,98	8 800	431 677	(23 876)
14/08/2026	JPY	NIPRO CORP	0,98	6 400	94 318	(6 389)
14/08/2026	JPY	NISHIMATSUYA CHAIN CO LTD	0,98	500	8 532	(39)
14/08/2026	JPY	NISSAN MOTOR CO LTD (TYO)	0,98	301 100	886 158	(99 073)
14/08/2026	JPY	NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD	0,98	(3 700)	86 740	(4 226)
14/08/2026	JPY	NITERRA CO LTD	0,98	(10 500)	915 209	(65 175)
14/08/2026	JPY	NITORI HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	9 200	216 040	(22 666)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	NITTA CORP (TYO)	0,98	300	15 737	(104)
14/08/2026	JPY	NITTO BOSEKI CO LTD (TYO)	0,98	(1 500)	48 126	(8 564)
14/08/2026	JPY	NITTO DENKO CORP	0,98	(33 000)	865 508	(55 096)
14/08/2026	JPY	NOHMI BOSAI LTD	0,98	200	7 419	(187)
14/08/2026	JPY	NOJIMA CORP	0,98	600	7 625	(697)
14/08/2026	JPY	NOMURA CO LTD	0,98	800	7 625	(68)
14/08/2026	JPY	NOMURA HOLDINGS INC	0,98	(46 100)	554 003	(14 338)
14/08/2026	JPY	NOMURA MICRO SCIENCE CO LTD	0,98	(6 200)	233 770	(36 371)
14/08/2026	JPY	NORITAKE CO LTD	0,98	(900)	30 007	(2 019)
14/08/2026	JPY	NORTH PACIFIC BANK LTD	0,98	(15 900)	141 550	(15 134)
14/08/2026	JPY	NS SOLUTIONS CORP	0,98	(3 900)	109 401	(6 199)
14/08/2026	JPY	NS UNITED KAIUN KAISHA LTD	0,98	200	12 324	(796)
14/08/2026	JPY	NTN CORP (TYO)	0,98	23 300	83 704	(2 271)
14/08/2026	JPY	NTT INC	0,98	563 600	719 979	(7 513)
14/08/2026	JPY	NXERA PHARMA CO LTD	0,98	(12 700)	108 961	(700)
14/08/2026	JPY	OBARA GROUP INC	0,98	(200)	10 264	(348)
14/08/2026	JPY	OBIC CO LTD	0,98	72 100	2 429 552	(3 797)
14/08/2026	JPY	OKASAN SECURITIES GROUP INC	0,98	(800)	6 570	(121)
14/08/2026	JPY	OKINAWA CELLULAR TELEPHONE	0,98	1 500	48 964	(986)
14/08/2026	JPY	OKUMA CORP (TYO)	0,98	(1 600)	58 163	(7 041)
14/08/2026	JPY	ONWARD HOLDINGS CO LTD	0,98	1 400	9 079	(230)
14/08/2026	JPY	OPEN HOUSE GROUP CO LTD	0,98	4 100	304 098	(1 274)
14/08/2026	JPY	OPEN UP GROUP INC	0,98	(1 000)	16 409	(726)
14/08/2026	JPY	ORGANO CORP	0,98	(1 300)	172 011	(13 844)
14/08/2026	JPY	ORIENT CORP	0,98	(3 400)	25 016	(1 288)
14/08/2026	JPY	OSAKA GAS CO LTD (TYO)	0,98	13 000	637 097	(18 952)
14/08/2026	JPY	OSAKA SODA CO LTD	0,98	(1 600)	25 178	(1 113)
14/08/2026	JPY	OTSUKA CORP	0,98	59 900	1 488 683	(18 414)
14/08/2026	JPY	PALTAC CORPORATION	0,98	4 800	278 052	(285)
14/08/2026	JPY	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HO	0,98	127 700	953 284	(31 415)
14/08/2026	JPY	PASONA GROUP INC	0,98	(4 800)	62 841	(2 857)
14/08/2026	JPY	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO (TYO)	0,98	(5 900)	85 894	(3 101)
14/08/2026	JPY	PEPTIDREAM INC	0,98	(11 100)	90 341	(12 710)
14/08/2026	JPY	PHC HOLDINGS CORP	0,98	2 200	20 546	(473)
14/08/2026	JPY	PILLAR CORP /JAPON	0,98	(700)	56 514	(9 703)
14/08/2026	JPY	PILOT CORP	0,98	(900)	12 937	(482)
14/08/2026	JPY	PKSHA TECHNOLOGY INC	0,98	(3 200)	73 315	(1 305)
14/08/2026	JPY	PLUS ALPHA CONSULTING CO LTD	0,98	6 400	149 367	(266)
14/08/2026	JPY	PRESTIGE INTERNATIONAL INC (TYO)	0,98	5 700	32 884	(843)
14/08/2026	JPY	PRIMA MEAT PACKERS LTD (TYO)	0,98	(300)	6 172	(103)
14/08/2026	JPY	RAITO KOGYO CO LTD	-	600	20 764	(65)
14/08/2026	JPY	RAIZNEXT CORP	0,98	(2 400)	46 754	(1 798)
14/08/2026	JPY	RENESES ELECTRONICS CORP	0,98	(27 800)	1 062 652	(102 896)
14/08/2026	JPY	RENGO CO LTD	0,98	(800)	9 660	(314)
14/08/2026	JPY	RIKEN KEIKI CO LTD (TYO)	0,98	(1 000)	29 850	(2 377)
14/08/2026	JPY	RIKEN VITAMIN CO LTD (TYO)	0,98	(2 500)	65 351	(1 375)
14/08/2026	JPY	ROLAND CORP	0,98	1 600	59 909	(1 238)
14/08/2026	JPY	ROUND ONE CORP	0,98	(4 900)	43 323	(6 690)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	ROYAL HOLDINGS CO LTD	0,98	6 000	64 727	(882)
14/08/2026	JPY	RYOHIN KEIKAKU CO LTD (TYO)	0,98	16 500	535 146	(26 230)
14/08/2026	JPY	SAKATA INX CORP (TYO)	0,98	(300)	6 132	(193)
14/08/2026	JPY	SAKURA INTERNET INC (TYO)	0,98	(1 200)	28 038	(3 159)
14/08/2026	JPY	SAN-A CO LTD (TYO)	0,98	2 100	59 018	(177)
14/08/2026	JPY	SAN-IN GODO BANK LTD/THE	0,98	(1 000)	18 844	(1 299)
14/08/2026	JPY	SANKEN ELECTRIC CO LTD	0,98	(2 300)	164 027	(64 138)
14/08/2026	JPY	SANRIO CO LTD	0,98	(88 400)	666 775	(185 031)
14/08/2026	JPY	SANYO CHEMICAL INDUSTRIES	0,98	1 300	58 774	(3 488)
14/08/2026	JPY	SCREEN HOLDINGS CO LTD	0,98	(2 600)	316 450	(94 242)
14/08/2026	JPY	SECOM CO LTD	0,98	24 400	1 394 689	(12 534)
14/08/2026	JPY	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	0,98	(7 100)	135 742	(963)
14/08/2026	JPY	SEIKO EPSON CORP (TYO)	0,98	22 000	530 922	(7 438)
14/08/2026	JPY	SEINO HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	7 800	184 424	(1 905)
14/08/2026	JPY	SEIREN CO LTD	0,98	3 000	88 763	(2 113)
14/08/2026	JPY	SEKISUI HOUSE REIT INC	0,98	87	60 443	(35)
14/08/2026	JPY	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	0,98	(93 700)	1 591 458	(8 006)
14/08/2026	JPY	SEVEN BANK LTD	0,98	27 400	69 257	(2 008)
14/08/2026	JPY	SG HOLDINGS CO LTD	0,98	(33 000)	431 172	(12 964)
14/08/2026	JPY	SHIBAURA MACHINE CO LTD	0,98	(1 000)	33 864	(5 846)
14/08/2026	JPY	SHIBAURA MECHATRONICS CORP	0,98	(1 600)	63 749	(722)
14/08/2026	JPY	SHIBUYA CORPORATION	0,98	(400)	13 668	(1 944)
14/08/2026	JPY	SHIGA BANK LTD/THE	0,98	(500)	9 898	(1 525)
14/08/2026	JPY	SHIKOKU KASEI HOLDINGS CORP	0,98	(1 800)	49 330	(6 245)
14/08/2026	JPY	SHIMADZU CORP	0,98	(19 200)	628 627	(63 296)
14/08/2026	JPY	SHINAGAWA REFRA CO LTD	0,98	(2 100)	34 458	(1 587)
14/08/2026	JPY	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	0,98	16 100	992 479	(10 231)
14/08/2026	JPY	SHIN-ETSU POLYMER CO LTD	0,98	(500)	9 911	(693)
14/08/2026	JPY	SHINMAYWA INDUSTRIES LTD (TYO)	0,98	1 700	31 381	(1 720)
14/08/2026	JPY	SHIONOGI & CO LTD (TYO)	0,98	(19 100)	462 687	(1 965)
14/08/2026	JPY	SHIZUOKA FINANCIAL GROUP INC	0,98	58 300	1 552 777	(176)
14/08/2026	JPY	SHOEI CO LTD	0,98	5 800	92 335	(2 714)
14/08/2026	JPY	SIIX CORP (TYO)	0,98	3 000	36 029	(1 369)
14/08/2026	JPY	SIMPLEX HOLDINGS INC	0,98	4 300	37 155	(2 043)
14/08/2026	JPY	SINFONIA TECHNOLOGY CO LTD	0,98	(900)	105 338	(20 472)
14/08/2026	JPY	SINKO INDUSTRIES LTD	-	(1 700)	18 324	(114)
14/08/2026	JPY	SOFTBANK CORP	0,98	993 400	1 851 121	(49 545)
14/08/2026	JPY	SOJITZ CORP (TYO)	0,98	(6 700)	298 545	(3 654)
14/08/2026	JPY	SOMPO HOLDINGS INC	0,98	(23 200)	1 246 351	(29 283)
14/08/2026	JPY	SONY GROUP CORP	0,98	19 300	554 536	(2 837)
14/08/2026	JPY	SOSILA LOGISTICS REIT INC	0,98	(10)	9 950	(135)
14/08/2026	JPY	SOTETSU HOLDINGS INC	0,98	(700)	15 060	(344)
14/08/2026	JPY	SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD (TYO)	0,98	66 400	1 396 683	(2 239)
14/08/2026	JPY	SUBARU CORP	0,98	71 300	1 539 579	(27 349)
14/08/2026	JPY	SUGI HOLDINGS CO LTD	0,98	(600)	15 318	(1 167)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO CORP (TYO)	0,98	90 400	1 234 600	(8 399)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO FORESTRY CO LTD	0,98	(45 600)	531 368	(14 140)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR (TYO)	0,98	(33 800)	1 889 802	(2 862)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	SUMITOMO PHARMA CO LTD	0,98	(8 400)	100 771	(9 236)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES	0,98	3 700	68 704	(317)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO WAREHOUSE CO LTD	0,98	300	10 107	(258)
14/08/2026	JPY	SUN FRONTIER FUDOUSAN CO LTD (TYO)	-	(1 300)	27 004	(463)
14/08/2026	JPY	SURUGA BANK LTD	0,98	(4 200)	86 292	(2 800)
14/08/2026	JPY	SUZUKEN CO LTD	0,98	800	35 289	(876)
14/08/2026	JPY	SUZUKI MOTOR CORP (TYO)	0,98	(28 100)	465 738	(18 755)
14/08/2026	JPY	SWCC CORP	0,98	(300)	31 918	(3 655)
14/08/2026	JPY	SYSMEX CORP (TYO)	0,98	(52 300)	644 276	(30 696)
14/08/2026	JPY	SYSTEMA CORP (TYO)	0,98	6 000	21 052	(346)
14/08/2026	JPY	T HASEGAWA CO LTD	0,98	400	11 189	(69)
14/08/2026	JPY	T&D HOLDINGS INC (TYO)	0,98	(29 200)	1 200 883	(35 550)
14/08/2026	JPY	TAISEI CORP (TYO)	0,98	(3 700)	431 925	(31 762)
14/08/2026	JPY	TAKARA BIO INC (TYO)	0,98	600	5 991	(9)
14/08/2026	JPY	TAMRON CO LTD	-	(6 800)	60 478	(9 150)
14/08/2026	JPY	TECHMATRIX CORPORATION	0,98	2 300	35 712	(1 414)
14/08/2026	JPY	TEIJIN LTD (TYO)	0,98	8 800	125 847	(1 117)
14/08/2026	JPY	TIS INC (TYO)	0,98	(18 300)	492 741	(15 618)
14/08/2026	JPY	TOHO BANK LTD/THE	0,98	(5 400)	36 621	(377)
14/08/2026	JPY	TOHO CO LTD	0,98	60 700	694 682	(6 569)
14/08/2026	JPY	TOHO GAS CO LTD	0,98	7 200	80 437	(3 561)
14/08/2026	JPY	TOHO HOLDINGS CO LTD	0,98	700	24 890	(1 068)
14/08/2026	JPY	TOKYO GAS CO LTD (TYO)	0,98	9 300	509 755	(13 580)
14/08/2026	JPY	TOKYO KIRABOSHI FINANCIAL GR	0,98	(3 200)	40 184	(10 055)
14/08/2026	JPY	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	0,98	(5 200)	464 021	(50 719)
14/08/2026	JPY	TOKYO TATEMONO CO LTD	0,98	(3 700)	106 859	(1 380)
14/08/2026	JPY	TOKYU CORP	0,98	22 500	332 175	(894)
14/08/2026	JPY	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	12 500	144 502	(1 685)
14/08/2026	JPY	TOMONY HOLDINGS INC	0,98	1 000	7 768	(14)
14/08/2026	JPY	TOPPAN HOLDINGS INC	0,98	(39 300)	1 545 941	(213 543)
14/08/2026	JPY	TORAY INDUSTRIES INC	0,98	18 900	188 877	(173)
14/08/2026	JPY	TOSHIBA TEC CORP (TYO)	0,98	1 200	31 997	(2 329)
14/08/2026	JPY	TOWA CORP (TYO)	0,98	(3 800)	97 509	(13 294)
14/08/2026	JPY	TOWA PHARMACEUTICAL CO LTD (TYO)	0,98	(300)	9 832	(88)
14/08/2026	JPY	TOYOBO CO LTD (TYO)	0,98	800	12 149	(764)
14/08/2026	JPY	TOYOTA BOSHOKU CORP	0,98	3 900	73 422	(1 162)
14/08/2026	JPY	TOYOTA TSUSHO CORP (TYO)	0,98	16 100	867 571	(19 773)
14/08/2026	JPY	TRANSCOSMOS INC	0,98	2 900	95 676	(1 633)
14/08/2026	JPY	TRUSCO NAKAYAMA CORP	0,98	(2 300)	44 364	(1 826)
14/08/2026	JPY	TS TECH CO LTD	0,98	500	7 678	(110)
14/08/2026	JPY	TSUBURAYA FIELDS HOLDINGS EN	0,98	(7 600)	90 478	(2 516)
14/08/2026	JPY	TSURUMI MANUFACTURING CO LTD (TYO)	0,98	(1 200)	22 015	(2 214)
14/08/2026	JPY	TV ASAHI HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	1 200	34 563	(1 347)
14/08/2026	JPY	UACJ CORP	0,98	1 800	45 466	(4 959)
14/08/2026	JPY	UBE CORP	-	(3 300)	88 365	(3 062)
14/08/2026	JPY	UNITED SUPER MARKETS HOLDING	0,98	4 200	30 829	(1 546)
14/08/2026	JPY	UT GROUP CO LTD (TYO)	0,98	(24 800)	37 663	(206)
14/08/2026	JPY	WEST HOLDINGS CORP (TYO)	0,98	(8 700)	175 634	(5 361)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	JPY	WINGARC1ST INC	0,98	2 100	43 182	(283)
14/08/2026	JPY	YAMABIKO CORP	0,98	(1 000)	31 770	(1 611)
14/08/2026	JPY	YAMADA HOLDINGS CO LTD	0,98	19 500	115 631	(1 249)
14/08/2026	JPY	YAMAHA MOTOR CO LTD (TYO)	0,98	(44 400)	461 732	(23 009)
14/08/2026	JPY	YAMAZEN CORP	0,98	600	9 280	(489)
14/08/2026	JPY	YASKAWA ELECTRIC CORP	0,98	(31 900)	1 763 803	(190 712)
14/08/2026	JPY	YELLOW HAT LTD	0,98	(6 000)	90 753	(1 355)
14/08/2026	JPY	YOKOGAWA BRIDGE HOLDINGS COR	0,98	(300)	7 253	(327)
14/08/2026	JPY	YUASA TRADING CO LTD	0,98	1 100	51 076	(365)
14/08/2026	JPY	ZACROS CORP	0,98	(800)	8 930	(797)
14/08/2026	JPY	ZERIA PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	2 300	43 019	(1 601)
14/08/2026	JPY	ZOJIRUSHI CORP	0,98	1 400	17 571	(1 043)
14/08/2026	JPY	ALSOK CO LTD	0,98	1 000	9 404	(89)
14/08/2026	JPY	BELC CO LTD	0,98	(400)	22 483	(195)
14/08/2026	JPY	DMG MORI CO LTD	0,98	(1 300)	38 487	(1 487)
14/08/2026	JPY	FIRST BANK OF TOYAMA LTD/THE	0,98	(1 000)	21 794	(360)
14/08/2026	JPY	FUJI CORP/AICHI	0,98	(400)	26 781	(2 642)
14/08/2026	JPY	FUJITEC CO LTD (TYO)	0,98	1 700	84 277	(125)
14/08/2026	JPY	FURUNO ELECTRIC CO LTD	0,98	(300)	14 742	(152)
14/08/2026	JPY	GMO FINANCIAL GATE INC	0,98	(200)	10 474	(1 482)
14/08/2026	JPY	HAKUHODO DY HOLDINGS INC	0,98	5 400	54 130	(129)
14/08/2026	JPY	HAKUTO CO LTD	0,98	(700)	27 340	(486)
14/08/2026	JPY	HAMAMATSU PHOTONICS KK	0,98	(300)	6 534	(455)
14/08/2026	JPY	HAPPINET CORP	0,98	(2 600)	61 520	(6 734)
14/08/2026	JPY	JCU CORP	0,98	(300)	18 224	(1 792)
14/08/2026	JPY	KAGOME CO LTD (TYO)	0,98	(5 400)	121 810	(2 466)
14/08/2026	JPY	KASUMIGASEKI CAPITAL CO LTD	0,98	(400)	20 179	(3 448)
14/08/2026	JPY	KEYENCE CORP (TYO)	0,98	(1 000)	633 824	(73 246)
14/08/2026	JPY	KOITO MANUFACTURING CO LTD	0,98	3 700	87 774	(5 517)
14/08/2026	JPY	KUMAGAI GUMI CO LTD	0,98	(3 900)	46 225	(2 473)
14/08/2026	JPY	LIFEDRINK CO INC	0,98	(8 500)	120 852	(1 256)
14/08/2026	JPY	MAXELL LTD	0,98	700	13 044	(49)
14/08/2026	JPY	MAZDA MOTOR CORP (TYO)	0,98	48 500	478 971	(14 626)
14/08/2026	JPY	MEDIPAL HOLDINGS CORP	0,98	1 300	29 932	(201)
14/08/2026	JPY	MINEBEA MITSUMI INC	0,98	(12 400)	475 563	(38 804)
14/08/2026	JPY	MIXI INC	0,98	(3 900)	90 782	(1 303)
14/08/2026	JPY	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	0,98	(11 500)	759 110	(17 354)
14/08/2026	JPY	MTG CO LTD	0,98	(1 200)	73 943	(4 237)
14/08/2026	JPY	MUNINOVA HOLDINGS INC	0,98	(2 500)	9 143	(427)
14/08/2026	JPY	NANTO BANK LTD/THE	0,98	5 100	79 232	(584)
14/08/2026	JPY	NIKON CORP (TYO)	0,98	(8 200)	144 677	(17 675)
14/08/2026	JPY	NIPPON CORP	0,98	(3 100)	73 486	(2 386)
14/08/2026	JPY	NIPPON PROLOGIS REIT INC	0,98	(162)	120 467	(4 477)
14/08/2026	JPY	NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	0,98	(26 300)	1 032 036	(21 209)
14/08/2026	JPY	ROHTO PHARMACEUTICAL CO LTD	0,98	(9 100)	184 582	(4 876)
14/08/2026	JPY	SAIZERIYA CO LTD	0,98	(300)	13 982	(200)
14/08/2026	JPY	SAKATA SEED CORP	0,98	(2 400)	87 664	(635)
14/08/2026	JPY	SAWAI GROUP HOLDINGS CO LTD	0,98	2 000	29 867	(59)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel	Non réalisé
			%		montant	gain (perte)
					\$	\$
14/08/2026	JPY	SENKO GROUP HOLDINGS CO LTD	0,98	(2 200)	36 915	(1 112)
14/08/2026	JPY	SHIMAMURA CO LTD	0,98	4 100	120 201	(809)
14/08/2026	JPY	SHIZUOKA GAS CO LTD (TYO)	0,98	2 800	31 110	(75)
14/08/2026	JPY	SOCIONEXT INC	0,98	(2 200)	43 491	(5 464)
14/08/2026	JPY	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	0,98	3 900	18 854	(1 384)
14/08/2026	JPY	SUNDRUG CO LTD	0,98	200	6 705	(67)
14/08/2026	JPY	TAKAMATSU CONSTRUCTION GROUP	0,98	(500)	15 056	(606)
14/08/2026	JPY	TAKARA HOLDINGS INC	0,98	(4 200)	79 437	(2 770)
14/08/2026	JPY	TAKASHIMAYA CO LTD (TYO)	0,98	(8 700)	161 662	(28 307)
14/08/2026	JPY	TIMEE INC	0,98	(2 500)	26 337	(7 198)
14/08/2026	JPY	TOKAI CARBON CO LTD	0,98	800	12 687	(607)
14/08/2026	JPY	TOKAI TOKYO FINANCIAL HOLDIN	0,98	(1 200)	7 625	(545)
14/08/2026	JPY	TRIAL HOLDINGS INC	0,98	(1 200)	29 211	(2 450)
14/08/2026	JPY	TSUMURA & CO	0,98	(5 300)	172 265	(442)
14/08/2026	JPY	YAMANASHI CHUO BANK LTD/THE (TYO)	0,98	(500)	26 708	(244)
14/08/2026	JPY	YAMATO KOGYO CO LTD (TYO)	0,98	(100)	10 430	(155)
14/08/2026	JPY	YOKOHAMA RUBBER CO LTD (TYO)	0,98	(12 300)	760 740	(22 012)
05/03/2027	NOK	AKER SOLUTIONS ASA	4,25	19 919	132 972	(3 253)
05/03/2027	NOK	AUSTEVOLL SEAFOOD ASA (OSL)	4,25	4 645	57 671	(4 941)
05/03/2027	NOK	BW LPG LTD (OSL)	4,25	1 517	44 855	(5 297)
05/03/2027	NOK	DNB BANK ASA	4,25	(34 273)	1 465 377	(10 447)
05/03/2027	NOK	DOF GROUP ASA	4,25	2 196	39 314	(2 752)
05/03/2027	NOK	EQUINOR ASA	4,25	34 387	1 731 982	(156 741)
05/03/2027	NOK	EUOPRIS ASA	4,25	618	8 282	(297)
05/03/2027	NOK	FRONTLINE PLC	4,25	(11 140)	578 809	(6 042)
05/03/2027	NOK	KITRON ASA (OSL)	4,25	7 182	114 737	(2 631)
05/03/2027	NOK	MOWI ASA	-	2 645	76 029	(5 589)
05/03/2027	NOK	NORDIC SEMICONDUCTOR ASA	4,25	950	26 175	(855)
05/03/2027	NOK	NORSK HYDRO ASA (OSL)	4,25	42 619	664 459	(104 309)
05/03/2027	NOK	ODFJELL DRILLING LTD (OSL)	4,25	7 555	97 691	(5 013)
05/03/2027	NOK	PROTECTOR FORSIKRING ASA	4,25	(1 967)	137 097	(300)
05/03/2027	NOK	SCATEC ASA	4,25	548	7 977	(175)
05/03/2027	NOK	SPAREBANK 1 SMN (OSL)	4,25	6 730	189 351	(4 247)
05/03/2027	NOK	SPAREBANK 1 SOR-NORGE ASA	4,25	(210)	5 882	(59)
05/03/2027	NOK	STOLT-NIELSEN LTD	4,25	472	21 629	(1 477)
05/03/2027	NOK	TELENOR ASA (OSL)	4,25	35 433	790 199	(54 235)
05/03/2027	NOK	TGS ASA	4,25	4 917	108 208	(14 898)
05/03/2027	NOK	WALLENUS WILHELMSEN ASA	4,25	6 129	124 603	(6 738)
05/03/2027	NOK	YARA INTERNATIONAL ASA (OSL)	4,25	3 702	250 597	(15 445)
05/03/2027	NOK	KONGSBERG MARITIME AS	4,25	11 543	90 370	(4 254)
05/03/2027	NOK	LINK MOBILITY GROUP HOLDING	4,25	(8 802)	30 299	(2 279)
05/03/2027	NOK	NORCONSULT AS	4,25	(4 075)	20 471	(981)
13/08/2030	SGD	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,27	5 600	15 169	(77)
13/08/2030	SGD	GENTING SINGAPORE LTD	1,27	100	66	-
13/08/2030	SGD	KEPPEL LTD	1,27	(53 600)	612 378	(22 582)
13/08/2030	SGD	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	1,27	(62 900)	417 568	(15 280)
13/08/2030	SGD	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,27	(428 000)	1 565 647	(20 406)
13/08/2030	GBP	ASHMORE GROUP PLC	3,73	(4 188)	15 424	(254)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	GBP	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,73	(12 834)	463 697	(16 629)
13/08/2030	GBP	AVIVA PLC	3,73	(6 877)	79 793	(3 753)
13/08/2030	GBP	BOOHOO GROUP PLC	3,73	16 244	6 967	(81)
13/08/2030	GBP	BP PLC	3,73	158 872	1 601 303	(199 357)
13/08/2030	GBP	BREEDON GROUP PLC	3,73	(1 602)	8 448	(565)
13/08/2030	GBP	BUNZL PLC (LSE)	3,73	(7 777)	373 584	(19 450)
13/08/2030	GBP	BURBERRY GROUP PLC	3,73	14 942	311 238	(16 323)
13/08/2030	GBP	C&C GROUP PLC (LSE)	3,73	(12 460)	22 445	(85)
13/08/2030	GBP	CENTRICA PLC (LSE)	3,73	569 674	1 963 174	(154 905)
13/08/2030	GBP	CLARKSON PLC (LSE)	3,73	74	6 566	(841)
13/08/2030	GBP	CMC MARKETS PLC	3,73	(1 043)	8 850	(38)
13/08/2030	GBP	CONVATEC GROUP PLC	3,73	(40 244)	150 844	(10 114)
13/08/2030	GBP	CRANSWICK PLC	3,73	111	11 654	(303)
13/08/2030	GBP	DCC PLC (LSE)	3,73	(30)	3 418	(148)
13/08/2030	GBP	DERWENT LONDON PLC (LSE)	3,73	(1 096)	37 994	(1 597)
13/08/2030	GBP	DIAGEO PLC (LSE)	3,73	(22 793)	641 760	(4 072)
13/08/2030	GBP	DISCOVERIE GROUP PLC	3,73	603	7 703	(22)
13/08/2030	GBP	DR. MARTENS PLC	3,73	7 164	9 873	(673)
13/08/2030	GBP	DRAX GROUP PLC	3,73	3 278	47 252	(991)
13/08/2030	GBP	ENERGEAN PLC	3,73	1 317	18 235	(1 323)
13/08/2030	GBP	ENTAIN PLC	3,73	7 064	79 169	(5 788)
13/08/2030	GBP	FRESNILLO PLC	3,73	24 786	1 303 463	(39 456)
13/08/2030	GBP	GENUS PLC (LSE)	3,73	(193)	7 608	(105)
13/08/2030	GBP	GLENCORE PLC (LSE)	3,73	163 424	1 711 287	(147 066)
13/08/2030	GBP	GRAINGER PLC	3,73	(27 948)	85 733	(2 398)
13/08/2030	GBP	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3,73	(5 308)	31 140	(2 189)
13/08/2030	GBP	HAMMERSON PLC (LSE)	3,73	(1 730)	10 969	(942)
13/08/2030	GBP	HISCOX LTD	3,73	(25 819)	837 668	(50 233)
13/08/2030	GBP	HOCHSCHILD MINING PLC (LSE)	3,73	18 803	175 318	(12 778)
13/08/2030	GBP	HOLLYWOOD BOWL GROUP PLC	3,73	1 485	8 086	(385)
13/08/2030	GBP	HUNTING PLC (LSE)	3,73	3 578	31 393	(1 938)
13/08/2030	GBP	INFORMA PLC (LSE)	3,73	(37 968)	583 069	(68 295)
13/08/2030	GBP	KAINOS GROUP PLC	3,73	1 632	25 245	(1 985)
13/08/2030	GBP	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,73	598	100 465	(9 772)
13/08/2030	GBP	MARSHALLS PLC (LSE)	3,73	(22 269)	53 611	(10 496)
13/08/2030	GBP	MONY GROUP PLC	3,73	2 780	9 648	(73)
13/08/2030	GBP	NATIONAL GRID PLC	3,73	(3 528)	78 915	(5 157)
13/08/2030	GBP	NINETY ONE PLC	3,73	5 558	22 180	(354)
13/08/2030	GBP	PAN AFRICAN RESOURCES PLC (LSE)	3,73	7 438	14 009	(810)
13/08/2030	GBP	PERSIMMON PLC	3,73	(21 633)	419 547	(21 754)
13/08/2030	GBP	PRUDENTIAL PLC (LSE)	3,73	(13 250)	228 850	(18 544)
13/08/2030	GBP	QINETIQ GROUP PLC	3,73	5 177	46 397	(5 784)
13/08/2030	GBP	RATHBONES GROUP PLC	3,73	3 128	111 645	(18 630)
13/08/2030	GBP	RECKITT BENCKISER GROUP PLC (LSE)	3,73	(3 716)	333 823	(8 585)
13/08/2030	GBP	RELX PLC	3,73	11 734	557 540	(31 009)
13/08/2030	GBP	RENEW HOLDINGS PLC (LSE)	3,73	(524)	8 276	(410)
13/08/2030	GBP	RENISHAW PLC (LSE)	3,73	(373)	35 091	(441)
13/08/2030	GBP	SAGE GROUP PLC/THE	3,73	59 868	946 927	(29 622)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	GBP	SHELL PLC (LSE)	3,73	32 746	1 972 469	(172 120)
13/08/2030	GBP	SOFTCAT PLC	3,73	6 046	211 398	(5 673)
13/08/2030	GBP	SSE PLC	3,73	(5 211)	229 331	(6 576)
13/08/2030	GBP	STANDARD CHARTERED PLC (LSE)	3,73	(5 260)	175 676	(24 258)
13/08/2030	GBP	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	3,73	(38 473)	60 229	(2 711)
13/08/2030	GBP	TATE & LYLE PLC	3,73	(55 213)	577 610	(5 660)
13/08/2030	GBP	TAYLOR WIMPEY PLC	3,73	(86 549)	122 241	(7 620)
13/08/2030	GBP	TBC BANK GROUP PLC	3,73	(629)	49 639	(3 545)
13/08/2030	GBP	TELECOM PLUS PLC	3,73	387	7 347	(2 020)
13/08/2030	GBP	TESCO PLC	3,73	179 348	1 569 224	(6 905)
13/08/2030	GBP	TRAINLINE PLC	3,73	1 747	7 122	(499)
13/08/2030	GBP	VICTREX PLC (LSE)	3,73	572	6 453	(196)
13/08/2030	GBP	VISTRY GROUP PLC	3,73	(25 298)	114 165	(6 672)
13/08/2030	GBP	VODAFONE GROUP PLC (LSE)	3,73	279 604	589 869	(63 685)
13/08/2030	GBP	VOLUTION GROUP PLC (LSE)	3,73	(978)	10 943	(176)
13/08/2030	GBP	GROUPE WATCHES OF SWITZERLAND	3,73	(10 114)	132 212	(1 198)
13/08/2030	GBP	WETHERSPOON (J.D.) PLC (LSE)	3,73	(514)	6 221	(312)
13/08/2030	GBP	WHITBREAD PLC	3,73	(3 034)	132 392	(9 858)
13/08/2030	GBP	WORKSPACE GROUP PLC (LSE)	3,73	(3 775)	23 484	(851)
13/08/2030	GBP	XPS PENSIONS GROUP PLC	3,73	1 312	7 572	(70)
13/08/2030	GBP	ABERDEEN GROUP PLC	3,73	(10 829)	48 228	(103)
13/08/2030	GBP	BRIDGEPOINT GROUP	3,73	(6 655)	30 331	(2 180)
13/08/2030	GBP	BYTES TECHNOLOGY GROUP PLC	3,73	(6 073)	42 015	(712)
13/08/2030	GBP	CHESNARA PLC	3,73	(1 615)	9 713	(234)
13/08/2030	GBP	HELIOS TOWERS PLC	3,73	7 230	29 661	(2 773)
13/08/2030	GBP	HSBC HOLDINGS PLC (LSE)	3,73	(28 136)	678 618	(74 868)
13/08/2030	GBP	IMI PLC (LSE)	3,73	(997)	52 662	(2 594)
13/08/2030	GBP	INTERTEK GROUP PLC (LSE)	3,73	208	22 337	(4 891)
13/08/2030	GBP	JD SPORTS FASHION PLC	3,73	(19 132)	30 440	(43)
13/08/2030	GBP	JTC PLC	3,73	(325)	7 988	(17)
13/08/2030	GBP	LEGAL & GENERAL GROUP PLC (LSE)	3,73	(22 571)	116 652	(4 047)
13/08/2030	GBP	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,73	(12 412)	108 389	(2 239)
13/08/2030	GBP	OXFORD INSTRUMENTS PLC (LSE)	3,73	(178)	9 440	(660)
13/08/2030	GBP	SIGMAROC PLC	3,73	(19 933)	42 895	(4 576)
13/08/2030	GBP	SMITH & NEPHEW PLC	3,73	9 019	195 179	(12 396)
13/08/2030	GBP	SMITHS GROUP PLC (LSE)	3,73	(1 620)	76 741	(1 041)
13/08/2030	GBP	WEIR GROUP PLC/THE	3,73	(3 572)	151 472	(8 149)
15/07/2027	SEK	ACTIONS ADDTECH AB-B	1,76	(5 282)	253 413	(12 948)
15/07/2027	SEK	ALLEIMA AB	1,76	1 310	19 052	(1 843)
15/07/2027	SEK	AMBEA AB	1,76	(3 383)	70 287	(4 542)
15/07/2027	SEK	AQ GROUP AB	1,76	2 113	71 307	(2 590)
15/07/2027	SEK	ASSA ABLOY AB-B	1,76	(16 463)	812 107	(21 992)
15/07/2027	SEK	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,76	(84 479)	2 333 525	(116 983)
15/07/2027	SEK	AXFOOD AB (STO)	1,76	1 917	76 215	(3 270)
15/07/2027	SEK	BETSSON AB-B	1,76	7 259	98 246	(7 232)
15/07/2027	SEK	BIOGAIA AB-B SHS(STO)	1,76	807	14 910	(949)
15/07/2027	SEK	BONESUPPORT HOLDING AB	1,76	1 898	64 052	(4 661)
15/07/2027	SEK	BOOZT AB	1,76	(1 301)	26 663	(1 827)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
15/07/2027	SEK	BUFAB AB	1,76	(5 480)	96 939	(5 824)
15/07/2027	SEK	BURE EQUITY AB (STO)	1,76	803	32 271	(606)
15/07/2027	SEK	CASTELLUM AB	1,76	(2 665)	49 457	(744)
15/07/2027	SEK	CATENA AB (STO)	1,76	(124)	7 585	(52)
15/07/2027	SEK	CLOETTA AB-B SHS (STO)	1,76	6 365	46 984	(687)
15/07/2027	SEK	EMBRACER GROUP AB	1,76	(12 119)	110 608	(2 530)
15/07/2027	SEK	EPIROC AB-B	1,76	512	17 294	(266)
15/07/2027	SEK	ERICSSON LM-B SHS(STO)	1,76	128 675	2 207 474	(149 877)
15/07/2027	SEK	EVOLUTION AB	1,76	4 068	432 833	(32 753)
15/07/2027	SEK	GETINGE AB-B SHS(STO)	1,76	(14 263)	415 397	(2 651)
15/07/2027	SEK	GRANGES AB (STO)	1,76	3 682	101 907	(8 317)
15/07/2027	SEK	HEXPOL AB (STO)	1,76	(902)	9 504	(138)
15/07/2027	SEK	HUFVUDSTADEN AB-A SHS(STO)	1,76	4 255	75 396	(144)
15/07/2027	SEK	INDUTRADE AB	1,76	(5 136)	143 979	(8 210)
15/07/2027	SEK	INVISIO AB	1,76	2 389	85 939	(13 349)
15/07/2027	SEK	JM AB (STO)	1,76	(7 297)	124 533	(17 984)
15/07/2027	SEK	LIFCO AB-B SHS	1,76	(12 011)	548 644	(15 256)
15/07/2027	SEK	MIPS AB	1,76	(2 032)	72 011	(5 606)
15/07/2027	SEK	NCAB GROUP AB	1,76	(7 593)	89 921	(4 416)
15/07/2027	SEK	NCC AB-B SHS	1,76	4 119	116 631	(472)
15/07/2027	SEK	NOLATO AB-B SHS	1,76	1 136	8 252	(79)
15/07/2027	SEK	NP3 FASTIGHETER AB	1,76	213	8 677	(279)
15/07/2027	SEK	PARADOX INTERACTIVE AB	1,76	2 851	56 145	(1 197)
15/07/2027	SEK	SAAB AB-B	1,76	11 680	904 114	(35 226)
15/07/2027	SEK	SECTRA AB-B SHS	1,76	2 026	90 801	(8 354)
15/07/2027	SEK	SINCH AB	1,76	(21 618)	120 820	(572)
15/07/2027	SEK	SWECO AB-B SHS	1,76	1 787	35 245	(1 636)
15/07/2027	SEK	TELE2 AB-B SHS(STO)	1,76	36 430	1 010 712	(100 856)
15/07/2027	SEK	TELIA CO AB (STO)	1,76	254 937	1 955 232	(173 457)
15/07/2027	SEK	VBG GROUP AB-B SHS(STO)	1,76	(213)	10 005	(9)
15/07/2027	SEK	VOLVO AB-B SHS	1,76	(17 050)	797 289	(33 900)
15/07/2027	SEK	WIHLBORGS FASTIGHETER AB (STO)	1,76	552	6 541	(398)
15/07/2027	SEK	ASKER HEALTHCARE GROUP AB	1,76	(5 695)	65 035	(1 352)
15/07/2027	SEK	AVARDA BANK AB	1,76	(1 000)	26 534	(44)
15/07/2027	SEK	BEIJER REF AB	1,76	(3 459)	69 963	(2 353)
15/07/2027	SEK	ELECTROLUX AB-B(STO)	1,76	(3 814)	16 743	(624)
15/07/2027	SEK	HEXAGON AB-B SHS(STO)	1,76	(19 871)	233 099	(1 703)
15/07/2027	SEK	LAGERCRANTZ GROUP AB-B SHS	1,76	(1 376)	50 152	(1 725)
15/07/2027	SEK	ACTIONS SKF AB-B	1,76	(5 529)	196 986	(5 786)
15/07/2027	SEK	SYNSAM GROUP AB	1,76	714	6 061	(353)
14/08/2026	CHF	ALCON INC	(0,04)	(6 445)	602 732	(15 010)
14/08/2026	CHF	ALSO HOLDING AG-REG	(0,04)	(213)	69 000	(2 944)
14/08/2026	CHF	AMS-OSRAM AG (SWX)	(0,04)	1 838	59 186	(2 925)
14/08/2026	CHF	AUTONEUM HOLDING AG (SWX)	(0,04)	76	15 631	(1 232)
14/08/2026	CHF	BACHEM HOLDING AG (SWX)	(0,04)	(4 417)	511 964	(75 456)
14/08/2026	CHF	BELIMO HOLDING AG-REG	(0,04)	(242)	371 589	(15 014)
14/08/2026	CHF	BKW AG	(0,04)	1 279	311 568	(5 751)
14/08/2026	CHF	BOSSARD HOLDING AG-REG A (SWX)	(0,04)	(145)	48 855	(783)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
14/08/2026	CHF	BURKHALTER HOLDING AG (SWX)	(0,04)	530	151 973	(8 796)
14/08/2026	CHF	CIE FINANCIÈRE RICHEMO-A REG (SWX)	(0,04)	(4 956)	1 555 999	(66 995)
14/08/2026	CHF	COMET HOLDING AG-REG	(0,04)	(41)	27 398	(2 040)
14/08/2026	CHF	DAETWYLER HOLDING AG-BR	(0,04)	176	49 849	(2 118)
14/08/2026	CHF	DKSH HOLDING AG (SWX)	(0,04)	321	35 150	(125)
14/08/2026	CHF	DOCMORRIS AG	(0,04)	(2 674)	36 883	(5 301)
14/08/2026	CHF	EMMI AG-REG (SWX)	(0,04)	29	44 936	(117)
14/08/2026	CHF	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	379	464 502	(3 755)
14/08/2026	CHF	FORBO HOLDING AG-REG	(0,04)	(46)	59 251	(837)
14/08/2026	CHF	GALENICA AG	(0,04)	2 426	361 654	(2 894)
14/08/2026	CHF	HOLCIM LTD	(0,04)	14 470	1 893 275	(43 339)
14/08/2026	CHF	HUBER + SUHNER AG-REG (SWX)	(0,04)	445	199 912	(25 840)
14/08/2026	CHF	INFICON HOLDING AG-REG	(0,04)	(579)	173 542	(11 657)
14/08/2026	CHF	JULIUS BAER GROUP LTD	(0,04)	(12 405)	1 408 447	(111 586)
14/08/2026	CHF	LEM HOLDING SA-REG	(0,04)	(83)	61 611	(6 059)
14/08/2026	CHF	LEONTEQ AG (SWX)	(0,04)	(531)	14 164	(1 609)
14/08/2026	CHF	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	(0,04)	13 826	2 123 550	(286 560)
14/08/2026	CHF	LONZA GROUP AG-REG	(0,04)	(232)	199 613	(22 684)
14/08/2026	CHF	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	(0,04)	990	26 407	(2 823)
14/08/2026	CHF	ORIOR AG	(0,04)	(258)	6 357	(358)
14/08/2026	CHF	SANDOZ GROUP AG	(0,04)	(640)	75 293	(6 860)
14/08/2026	CHF	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG	(0,04)	34	17 899	(306)
14/08/2026	CHF	SENSIRION HOLDING AG	(0,04)	(847)	116 976	(3 022)
14/08/2026	CHF	SIG GROUP AG	(0,04)	(51 248)	1 070 654	(146 568)
14/08/2026	CHF	SIKA AG-REG	(0,04)	(8 329)	2 281 360	(156 687)
14/08/2026	CHF	SONOVA HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	1 000	352 022	(9 628)
14/08/2026	CHF	STADLER RAIL AG	(0,04)	(2 901)	112 914	(5 649)
14/08/2026	CHF	STRAUMANN HOLDING AG-REG (SWX)	(0,04)	(9 608)	1 578 487	(216 170)
14/08/2026	CHF	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	(0,04)	(706)	1 063 313	(39 203)
14/08/2026	CHF	SWISS RE AG (SWX)	(0,04)	(11 166)	2 366 051	(152 778)
14/08/2026	CHF	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	(0,04)	8 141	563 162	(21 875)
14/08/2026	CHF	TECAN GROUP AG-REG (SWX)	(0,04)	(1 767)	457 370	(44 534)
14/08/2026	CHF	TEMENOS AG - REG	(0,04)	(5 691)	642 848	(17 535)
14/08/2026	CHF	VALIANT HOLDING AG-REG	(0,04)	550	156 550	(1 406)
14/08/2026	CHF	VAT GROUP AG	(0,04)	(608)	707 813	(46 016)
14/08/2026	CHF	VONTOBEL HOLDING AG-REG	(0,04)	(51)	6 390	(182)
14/08/2026	CHF	ZEHNDER GROUP AG-RG (SWX)	(0,04)	747	83 371	(1 602)
14/08/2026	CHF	ARYZTA AG	(0,04)	81	8 500	(529)
14/08/2026	CHF	IDORSIA LTD (SWX)	(0,04)	(5 934)	47 235	(24 467)
14/08/2026	CHF	R&S GROUP HOLDING AG	(0,04)	(1 043)	44 220	(5 713)
13/08/2030	USD	1-800-FLOWERS.COM INC-CL A	3,62	2 960	17 420	(3 154)
13/08/2030	USD	3D SYSTEMS CORP (NYS)	3,62	(22 977)	92 603	(3 972)
13/08/2030	USD	3M CO (État de New York)	3,62	3 175	729 489	(1 695)
13/08/2030	USD	4D MOLECULAR THERAPEUTICS A	3,62	(1 390)	16 903	(8 976)
13/08/2030	USD	908 DEVICES INC	3,62	(5 342)	59 672	(5 059)
13/08/2030	USD	AAON INC	3,62	(9 765)	1 649 386	(75 566)
13/08/2030	USD	ABACUS GLOBAL MANAGEMENT INC	3,62	(7 698)	97 798	(17 227)
13/08/2030	USD	ABBOTT LABORATORIES	3,62	(10 593)	1 317 261	(20 116)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ABEONA THERAPEUTICS INC (NAS)	3,62	(9 764)	72 984	(11 175)
13/08/2030	USD	ABM INDUSTRIES INC	3,62	1 585	99 179	(1 708)
13/08/2030	USD	ABSCI CORP	3,62	(4 519)	40 207	(33 252)
13/08/2030	USD	ACADIA HEALTHCARE CO INC	3,62	(54 449)	1 815 531	(428 843)
13/08/2030	USD	ACADIA PHARMACEUTICALS INC	3,62	(2 294)	67 981	(12 987)
13/08/2030	USD	ACADIAN ASSET MANAGEMENT INC	3,62	1 660	176 122	(11 055)
13/08/2030	USD	ACCENDRA HEALTH INC	3,62	(14 126)	53 976	(13 453)
13/08/2030	USD	ACCENTURE PLC-CL A (NYS)	3,62	7 162	1 635 672	(399 754)
13/08/2030	USD	ACUSHNET HOLDINGS CORP	3,62	(47)	6 197	(1 597)
13/08/2030	USD	ADAPTHEALTH CORP	3,62	(569)	7 879	(375)
13/08/2030	USD	ADC THERAPEUTICS SA	3,62	22 159	33 992	(1 039)
13/08/2030	USD	ADDUS HOMECARE CORP (NSM)	3,62	(482)	62 626	(4 822)
13/08/2030	USD	ADIENT PLC	3,62	1 334	40 406	(6 434)
13/08/2030	USD	ADOBE INC	3,62	12 887	4 194 204	(528 932)
13/08/2030	USD	ADT INC	3,62	32 787	306 345	(8 011)
13/08/2030	USD	ADTALEM GLOBAL EDUCATION INC	3,62	559	101 537	(4 715)
13/08/2030	USD	ADTRAN HOLDINGS INC	3,62	6 405	133 535	(9 925)
13/08/2030	USD	ADVANCE AUTO PARTS INC	3,62	(990)	81 953	(3 798)
13/08/2030	USD	ADVANSIX INC	3,62	1 782	53 255	(4 070)
13/08/2030	USD	AEBI SCHMIDT HOLDING AG	3,62	(2 621)	43 532	(2 260)
13/08/2030	USD	AECOM (NYS)	3,62	(2 012)	192 424	(2 969)
13/08/2030	USD	AEHR TEST SYSTEMS	3,62	(740)	96 303	(2 589)
13/08/2030	USD	AERSALE CORP	3,62	(4 304)	37 093	(755)
13/08/2030	USD	AEVA TECHNOLOGIES INC	3,62	(1 540)	48 729	(13 032)
13/08/2030	USD	AFFIRM HOLDINGS INC (NSM)	3,62	(12 023)	1 053 115	(316 278)
13/08/2030	USD	AFLAC INC	3,62	4 189	684 929	(1 579)
13/08/2030	USD	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC (NYS)	3,62	(2 287)	881 883	(51 717)
13/08/2030	USD	ALASKA AIR GROUP INC (NYS)	3,62	(14 573)	847 053	(214 456)
13/08/2030	USD	ALBANY INTL CORP-CL A	3,62	(150)	14 147	(1 481)
13/08/2030	USD	ALBERTSONS COS INC - CLASSE A	3,62	56 850	1 211 401	(144 432)
13/08/2030	USD	ALCOA CORP	3,62	1 601	146 352	(30 844)
13/08/2030	USD	ALECTOR INC	3,62	(12 448)	26 386	(8 572)
13/08/2030	USD	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,62	(9 694)	707 167	(15 467)
13/08/2030	USD	ALIGHT INC - CATÉGORIE A	3,62	68 444	62 442	(9 319)
13/08/2030	USD	ALKERMES PLC	3,62	(3 330)	203 586	(39 822)
13/08/2030	USD	ALLY FINANCIAL INC	3,62	(6 892)	402 519	(38 597)
13/08/2030	USD	ALPHABET INC-CL A	3,62	(2 559)	1 277 837	(3 583)
13/08/2030	USD	ALPHABET INC-CL C	3,62	5 998	2 955 349	(7 659)
13/08/2030	USD	ALTIMUNE INC	3,62	(9 433)	34 334	(5 658)
13/08/2030	USD	ALTRIA GROUP INC	3,62	8 835	901 024	(6 060)
13/08/2030	USD	ALUMIS INC	3,62	(1 310)	36 647	(14 893)
13/08/2030	USD	AMAZON.COM INC	3,62	214	71 047	(119)
13/08/2030	USD	AMC NETWORKS INC-A	3,62	4 806	68 363	(1 693)
13/08/2030	USD	AMCOR PLC	3,62	(50 080)	2 665 757	(376 861)
13/08/2030	USD	AMDOCS LTD	3,62	5 457	433 545	(46 558)
13/08/2030	USD	AMERESCO INC-CL A	3,62	(2 859)	102 825	(7 048)
13/08/2030	USD	AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	3,62	19	1 407	(3)
13/08/2030	USD	AMERICAN SUPERCONDUCTOR CORP	3,62	(613)	31 442	(4 020)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	AMERICAN TOWER CORP	3,62	1 489	399 723	(58 962)
13/08/2030	USD	AMERICOLD REALTY TRUST INC	3,62	(41 491)	834 350	(88 004)
13/08/2030	USD	AMLYX PHARMACEUTICALS INC	3,62	(2 112)	39 644	(13 354)
13/08/2030	USD	ANGI INC	3,62	(6 043)	47 951	(2 108)
13/08/2030	USD	ANTERIX INC	3,62	(511)	46 163	(27 494)
13/08/2030	USD	ANTERO RESOURCES CORP (NYS)	3,62	10 985	545 150	(8 460)
13/08/2030	USD	AON PLC - CLASSE A	3,62	1 155	543 768	(8 288)
13/08/2030	USD	APA CORP	3,62	7 812	413 808	(61 065)
13/08/2030	USD	API GROUP CORP (NYS)	3,62	(6 832)	394 060	(8 543)
13/08/2030	USD	APOGEE ENTERPRISES INC (NSM)	3,62	(182)	9 782	(1 830)
13/08/2030	USD	APOGEE THERAPEUTICS INC	3,62	(216)	24 917	(15 235)
13/08/2030	USD	APPIAN CORP-A	3,62	8 250	269 678	(7 076)
13/08/2030	USD	APPLE HOSPITALITY REIT INC (NYS)	3,62	(445)	9 842	(674)
13/08/2030	USD	APPLE INC	3,62	14 039	5 709 179	(57 486)
13/08/2030	USD	APPLOVIN CORP - CATÉGORIE A	3,62	(1 818)	1 257 728	(50 212)
13/08/2030	USD	ARBUTUS BIOPHARMA CORP	3,62	(13 425)	77 134	(12 727)
13/08/2030	USD	ARCH CAPITAL GROUP LTD (NSM)	3,62	(2 821)	359 216	(22 043)
13/08/2030	USD	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,62	8 947	1 014 134	(64 764)
13/08/2030	USD	ARCOSA INC	3,62	(139)	23 814	(4 354)
13/08/2030	USD	ARCUS BIOSCIENCES INC	3,62	(544)	16 781	(6 667)
13/08/2030	USD	ARDELYX INC	3,62	6 254	48 928	(4 671)
13/08/2030	USD	ARHAUS INC	3,62	(3 956)	36 963	(9 540)
13/08/2030	USD	ARMADA HOFFLER PROPERTIES À	3,62	(9 643)	92 116	(4 818)
13/08/2030	USD	ARRAY TECHNOLOGIES INC	3,62	(600)	5 719	(472)
13/08/2030	USD	ARROW ELECTRONICS INC (NYS)	3,62	4 572	1 373 969	(15 550)
13/08/2030	USD	ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,62	(7 046)	2 163 095	(93 516)
13/08/2030	USD	ARTISAN PARTNERS ASSET MA -A	3,62	784	37 753	(115)
13/08/2030	USD	ARVINAS INC	3,62	(2 844)	27 683	(5 283)
13/08/2030	USD	ASANA INC - CL A	3,62	25 587	270 472	(21 791)
13/08/2030	USD	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP (NYS)	3,62	(161)	44 485	(557)
13/08/2030	USD	ASP ISOTOPES INC	3,62	(8 827)	72 012	(4 448)
13/08/2030	USD	ASSOCIATED BANC-CORP	3,62	(6 175)	246 457	(20 058)
13/08/2030	USD	ASSURANT INC	3,62	(1 489)	534 363	(24 063)
13/08/2030	USD	ASSURED GUARANTY LTD (NYS)	3,62	(1 993)	211 146	(11 279)
13/08/2030	USD	ASTEC INDUSTRIES INC	3,62	(187)	12 898	(3 072)
13/08/2030	USD	ASTERA LABS INC	3,62	(554)	255 616	(118 424)
13/08/2030	USD	ASTRANA HEALTH INC	3,62	(1 937)	104 619	(20 808)
13/08/2030	USD	AT&T INC	3,62	77 565	2 510 586	(283 301)
13/08/2030	USD	ATI INC	3,62	(998)	255 207	(17 796)
13/08/2030	USD	ATLANTICUS HOLDINGS CORP	3,62	(1 498)	185 068	(28 475)
13/08/2030	USD	ATLASSIAN CORP-CL A	3,62	5 541	707 348	(110 238)
13/08/2030	USD	ATOMERA INC	3,62	(3 668)	41 024	(3 541)
13/08/2030	USD	AURORA INNOVATION INC (NSM)	3,62	(124 451)	1 049 997	(132 607)
13/08/2030	USD	AUTODESK INC	3,62	9 536	2 896 608	(317 592)
13/08/2030	USD	AUTOLIV INC	3,62	1 552	268 660	(18 296)
13/08/2030	USD	AUTOMATIC DATA PROCESSING (NSM)	3,62	7 576	2 433 100	(53 729)
13/08/2030	USD	AVANTOR INC	3,62	(24 666)	331 940	(7 876)
13/08/2030	USD	AVIAT NETWORKS INC	3,62	(1 303)	33 344	(7 017)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	AVIENT CORP	3,62	(11 026)	543 148	(29 180)
13/08/2030	USD	AVISTA CORP (NYS)	3,62	2 443	144 418	(4 087)
13/08/2030	USD	AXCELIS TECHNOLOGIES INC	3,62	(728)	159 828	(32 574)
13/08/2030	USD	AXON ENTERPRISE INC	3,62	(3 356)	2 094 128	(533 035)
13/08/2030	USD	AXOS FINANCIAL INC	3,62	(752)	92 443	(9 603)
13/08/2030	USD	AXSOME THERAPEUTICS INC (NMS)	3,62	673	231 198	(2 189)
13/08/2030	USD	AZENTA INC	3,62	(269)	8 395	(1 175)
13/08/2030	USD	B&G FOODS INC	3,62	(1 717)	9 626	(110)
13/08/2030	USD	BAKER HUGHES CO	3,62	18 000	1 555 540	(163 444)
13/08/2030	USD	BALDWIN INSURANCE GROUP INC/	3,62	(3 929)	106 132	(39 867)
13/08/2030	USD	BALL CORP (NYS)	3,62	(1 467)	115 096	(12 906)
13/08/2030	USD	BANCFIRST CORP	3,62	443	70 458	(1 780)
13/08/2030	USD	BANCORP INC/THE	3,62	(556)	42 607	(5 945)
13/08/2030	USD	BANK OZK	3,62	(7 848)	558 604	(10 226)
13/08/2030	USD	BANKUNITED INC	3,62	(122)	8 185	(37)
13/08/2030	USD	BARNES & NOBLE EDUCATION INC	3,62	(449)	6 775	(1 091)
13/08/2030	USD	BAXTER INTERNATIONAL INC	3,62	(24 397)	694 440	(30 883)
13/08/2030	USD	BEAM THERAPEUTICS INC	3,62	(3 713)	152 698	(24 992)
13/08/2030	USD	BEAZER HOMES USA INC	3,62	(168)	6 185	(376)
13/08/2030	USD	BEL FUSE INC-CL B(NSM)	3,62	(332)	128 225	(26 040)
13/08/2030	USD	BELDEN INC (NYS)	3,62	(4 490)	665 833	(84 805)
13/08/2030	USD	BETTER HOME & FINANCE HOLDIN	3,62	(1 207)	39 943	(6 518)
13/08/2030	USD	BEYOND MEAT INC	3,62	(5 449)	5 185	(591)
13/08/2030	USD	BGC GROUP INC-A	3,62	3 253	50 309	(2 003)
13/08/2030	USD	BICARA THERAPEUTICS INC	3,62	(651)	18 348	(8 694)
13/08/2030	USD	BILL HOLDINGS INC	3,62	(28 020)	1 265 649	(146 213)
13/08/2030	USD	BIOGEN INC (NSM)	3,62	(4 395)	1 190 506	(132 739)
13/08/2030	USD	BIOHAVEN LTD	3,62	(1 232)	19 019	(6 596)
13/08/2030	USD	BIOLIFE SOLUTIONS INC (NAS)	3,62	(1 524)	56 660	(3 267)
13/08/2030	USD	BIO-TECHNE CORP (NSM)	3,62	(10 592)	775 481	(269 990)
13/08/2030	USD	BIT DIGITAL INC	3,62	(48 642)	115 317	(6 553)
13/08/2030	USD	BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS	3,62	4 879	629 303	(38 234)
13/08/2030	USD	BLACKLINE INC	3,62	(1 907)	73 479	(997)
13/08/2030	USD	BLACKROCK INC	3,62	1 753	2 470 755	(117 158)
13/08/2030	USD	BLEND LABS INC-A	3,62	(15 670)	36 275	(1 015)
13/08/2030	USD	BLOCK INC	3,62	(12 493)	1 160 835	(162 636)
13/08/2030	USD	BLOOMIN' BRANDS INC (NSM)	3,62	(1 997)	20 636	(4 838)
13/08/2030	USD	BLUE OWL CAPITAL INC	3,62	(5 105)	62 743	(590)
13/08/2030	USD	BOISE CASCADE CO	3,62	(386)	36 771	(5 117)
13/08/2030	USD	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,62	7 087	752 862	(152 291)
13/08/2030	USD	BORGWARNER INC	3,62	17 450	1 734 835	(122 396)
13/08/2030	USD	BOSTON BEER COMPANY INC-A	3,62	3 905	963 075	(1 911)
13/08/2030	USD	BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,62	27 846	1 877 170	(228 697)
13/08/2030	USD	BOX INC - CATÉGORIE A	3,62	941	34 749	(19)
13/08/2030	USD	BRANDYWINE REALTY TRUST	3,62	3 193	14 293	(223)
13/08/2030	USD	BRIGHTVIEW HOLDINGS INC	3,62	(887)	15 932	(1 579)
13/08/2030	USD	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS (NYS)	3,62	6 178	1 261 658	(79 429)
13/08/2030	USD	BROADSTONE NET LEASE INC	3,62	2 178	64 027	(686)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	BROWN & BROWN INC (NYS)	3,62	(13 760)	1 154 795	(74 421)
13/08/2030	USD	BROWN-FORMAN CORP - CATÉGORIE B	3,62	(50 100)	1 853 570	(20 375)
13/08/2030	USD	BUCKLE INC/THE (NYS)	3,62	160	9 891	(512)
13/08/2030	USD	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3,62	(8 638)	898 882	(179 449)
13/08/2030	USD	BURFORD CAPITAL LTD (NYS)	3,62	7 209	42 324	(762)
13/08/2030	USD	BURLINGTON STORES INC	3,62	1 048	476 291	(12 983)
13/08/2030	USD	BUSINESS FIRST BANCSHARES	3,62	(170)	6 851	(423)
13/08/2030	USD	BUTTERFLY NETWORK INC	3,62	(1 901)	14 289	(8 118)
13/08/2030	USD	BWX TECHNOLOGIES INC (NYS)	3,62	(1 505)	384 080	(23 770)
13/08/2030	USD	BXP INC	3,62	(20 586)	1 879 813	(39 736)
13/08/2030	USD	BYRNA TECHNOLOGIES INC	3,62	(7 698)	67 310	(4 647)
13/08/2030	USD	C3.AI INC-A	3,62	2 067	31 131	(5 098)
13/08/2030	USD	CADIZ INC (NMS)	3,62	(10 065)	54 741	(3 851)
13/08/2030	USD	CALIFORNIA RESOURCES CORP (NYS)	3,62	176	14 449	(1 505)
13/08/2030	USD	CALIX INC	3,62	869	46 766	(1 699)
13/08/2030	USD	CAMDEN PROPERTY TRUST (NYS)	3,62	5 574	896 330	(1 953)
13/08/2030	USD	CAMPING WORLD HOLDINGS INC-A	3,62	(6 182)	62 244	(3 421)
13/08/2030	USD	CANDEL THERAPEUTICS INC	3,62	(746)	8 687	(2 047)
13/08/2030	USD	CARETRUST REIT INC	3,62	(1 238)	68 369	(2 191)
13/08/2030	USD	CARGURUS INC	3,62	(178)	6 975	(1 492)
13/08/2030	USD	CARMAX INC (NYS)	3,62	(10 408)	714 936	(53 163)
13/08/2030	USD	CARRIER GLOBAL CORP	3,62	(15 049)	1 426 458	(110 167)
13/08/2030	USD	CARS.COM INC	3,62	(2 893)	38 690	(5 432)
13/08/2030	USD	CARTER'S INC (NYS)	3,62	(1 735)	95 161	(4 235)
13/08/2030	USD	CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A (NSM)	3,62	(1 249)	158 555	(10 113)
13/08/2030	USD	CASEY'S GENERAL STORES INC (NSM)	3,62	1 036	1 322 593	(180 811)
13/08/2030	USD	CATHAY GENERAL BANCORP (NSM)	3,62	(199)	16 509	(662)
13/08/2030	USD	CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,62	8 134	3 318 255	(569 887)
13/08/2030	USD	CDW CORP/DE(NSM)	3,62	(1 751)	317 702	(25 805)
13/08/2030	USD	CECO ENVIRONMENTAL CORP	3,62	886	114 031	(2 295)
13/08/2030	USD	CELSIUS HOLDINGS INC (NAS)	3,62	(27 976)	1 114 530	(28 293)
13/08/2030	USD	CENCORA INC	3,62	(4 312)	1 691 180	(6 238)
13/08/2030	USD	CENTENE CORP	3,62	67 718	6 170 457	(130 089)
13/08/2030	USD	CENTERSPACE	3,62	91	7 421	(232)
13/08/2030	USD	CENTRUS ENERGY CORP - CLASSE A	3,62	(178)	36 393	(5 271)
13/08/2030	USD	CENTURY ALUMINUM COMPANY (NSM)	3,62	482	39 685	(9 011)
13/08/2030	USD	CERENCE INC	3,62	(712)	9 880	(1 356)
13/08/2030	USD	CERTARA INC	3,62	(70 497)	509 254	(135 506)
13/08/2030	USD	CEVA INC (NSM)	3,62	(1 271)	72 804	(10 752)
13/08/2030	USD	CG ONCOLOGY INC	3,62	(709)	54 301	(16 051)
13/08/2030	USD	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A (NSM)	3,62	(1 296)	249 033	(7 475)
13/08/2030	USD	CHEMOURS CO/THE (État de New York)	3,62	(754)	21 356	(271)
13/08/2030	USD	CHENIERE ENERGY INC	3,62	1 092	369 393	(5 906)
13/08/2030	USD	CHESAPEAKE UTILITIES CORP	3,62	44	7 641	(110)
13/08/2030	USD	CHEVRON CORP	3,62	8 036	2 118 067	(269 122)
13/08/2030	USD	CHEWY INC - CLASSE A	3,62	71 473	1 991 460	(38 953)
13/08/2030	USD	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,62	(8 401)	356 389	(41 654)
13/08/2030	USD	CHOICE HOTELS INTL INC (NYS)	3,62	(13 880)	2 017 513	(114 123)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	CHOICEONE FINANCIAL SVCS INC	3,62	(765)	34 747	(1 780)
13/08/2030	USD	CHORD ENERGY CORP	3,62	2 668	514 381	(91 984)
13/08/2030	USD	CHURCH & DWIGHT CO INC	3,62	9 252	1 266 884	(20 898)
13/08/2030	USD	CHURCHILL DOWNS INC (NSM)	3,62	(8 031)	994 101	(8 123)
13/08/2030	USD	CINEMARK HOLDINGS INC (NYS)	3,62	2 917	134 444	(5 536)
13/08/2030	USD	CINTAS CORP (NSM)	3,62	1 629	409 184	(23 235)
13/08/2030	USD	CIPHER MINING INC	3,62	(847)	24 828	(4 099)
13/08/2030	USD	CIRRUS LOGIC INC (NSM)	3,62	5 305	1 166 502	(71 629)
13/08/2030	USD	CITIGROUP INC (NYS)	3,62	(1 164)	216 510	(8 701)
13/08/2030	USD	CIVISTA BANCSHARES INC	3,62	(535)	20 010	(1 009)
13/08/2030	USD	CLARITEV CORP	3,62	(631)	26 170	(3 850)
13/08/2030	USD	CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDIN	3,62	(12 722)	42 757	(69)
13/08/2030	USD	CLEARFIELD INC (NMS)	3,62	(563)	29 670	(1 516)
13/08/2030	USD	CLEARPOINT NEURO INC	3,62	(6 482)	124 293	(37 234)
13/08/2030	USD	CLEARWATER PAPER CORP	3,62	2 697	62 246	(3 514)
13/08/2030	USD	CLEVELAND-CLIFFS INC	3,62	(8 540)	113 699	(12)
13/08/2030	USD	CLIMB GLOBAL SOLUTIONS INC	3,62	(2 656)	85 042	(723)
13/08/2030	USD	CLOVER HEALTH INVESTMENTS CO	3,62	(8 589)	58 571	(4 106)
13/08/2030	USD	CME GROUP INC	3,62	7 374	2 712 768	(445 282)
13/08/2030	USD	CNB FINANCIAL CORP/PA	3,62	(1 892)	85 197	(4 094)
13/08/2030	USD	CNH INDUSTRIAL NV	3,62	(60 768)	862 694	(88 121)
13/08/2030	USD	COASTAL FINANCIAL CORP/WA	3,62	(510)	50 724	(4 340)
13/08/2030	USD	COCA-COLA CONSOLIDATED INC	3,62	5 544	1 477 313	(5 694)
13/08/2030	USD	CODEXIS INC	3,62	4 929	16 153	(678)
13/08/2030	USD	COEUR MINING INC	3,62	(21 064)	467 658	(11 202)
13/08/2030	USD	COGNEX CORP (NSM)	3,62	(8 024)	656 733	(154 169)
13/08/2030	USD	COHEN & STEERS INC	3,62	584	61 953	(125)
13/08/2030	USD	COHERENT CORP	3,62	(2 345)	1 160 176	(128 331)
13/08/2030	USD	COLUMBIA SPORTSWEAR CO	3,62	6 580	591 540	(26 525)
13/08/2030	USD	COMCAST CORP - CLASSE A	3,62	(27 089)	905 514	(19 961)
13/08/2030	USD	COMMScope HOLDING CO INC (NSM)	3,62	(5 083)	85 558	(4 883)
6/1/2031	USD	COMPASS GROUP PLC	3,62	6 860	317 420	(4 359)
13/08/2030	USD	COMPASS INC - CATÉGORIE A	3,62	(6 185)	68 226	(38 540)
13/08/2030	USD	COMPOSECURE INC-A	3,62	(1 816)	29 174	(11 063)
13/08/2030	USD	COMSTOCK RESOURCES INC	3,62	(3 113)	58 042	(6 688)
13/08/2030	USD	CONCENTRIX CORP	3,62	5 242	188 238	(25 408)
13/08/2030	USD	CONDUENT INC	3,62	(7 487)	14 095	(1 130)
13/08/2030	USD	CONNECTONE BANCORP INC	3,62	(584)	26 021	(1 164)
13/08/2030	USD	CONOCOPHILLIPS	3,62	7 723	1 291 552	(178 288)
13/08/2030	USD	CONSOLIDATED WATER CO-ORD SH	3,62	3 034	127 313	(2 910)
13/08/2030	USD	CONSTELLATION ENERGY	3,62	(1 922)	652 361	(11 952)
13/08/2030	USD	CONSTELLIUM SE	3,62	2 917	132 817	(3 634)
13/08/2030	USD	CONSTRUCTION PARTNERS INC-A	3,62	(875)	127 221	(17 621)
13/08/2030	USD	CONTANGO ORE INC (ASE)	3,62	(2 668)	55 661	(2 981)
13/08/2030	USD	COOPER-STANDARD HOLDING	3,62	1 234	49 097	(2 737)
13/08/2030	USD	COPART INC (NSM)	3,62	34 845	1 520 469	(156 782)
13/08/2030	USD	CORVUS PHARMACEUTICALS INC	3,62	(1 184)	18 427	(6 292)
13/08/2030	USD	COSTCO WHOLESALE CORP	3,62	4 379	5 996 890	(301 236)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	CRA INTERNATIONAL INC (NSM)	3,62	327	67 983	(3 114)
13/08/2030	USD	CRANE CO	3,62	(2 082)	570 630	(76 882)
13/08/2030	USD	CRANE NXT CO	3,62	(12 468)	653 587	(237 772)
13/08/2030	USD	CREDIT ACCEPTANCE CORP (NSM)	3,62	(1 203)	934 800	(133 187)
13/08/2030	USD	CRH PLC (NYSE)	3,62	(2 444)	340 760	(24 747)
13/08/2030	USD	CRICUT INC - CLASSE A	3,62	12 573	77 674	(945)
13/08/2030	USD	CRINETICS PHARMACEUTICALS À	3,62	(1 338)	64 038	(5 709)
13/08/2030	USD	CRYOPORT INC (NAS)	3,62	(1 175)	24 202	(1 485)
13/08/2030	USD	CSW INDUSTRIALS INC	3,62	(330)	122 303	(5 536)
13/08/2030	USD	CSX CORP (NSM)	3,62	(6 820)	441 398	(11 022)
13/08/2030	USD	CTS CORP (NYS)	3,62	(131)	11 840	(47)
13/08/2030	USD	CUBESMART	3,62	1 348	78 352	(3 879)
13/08/2030	USD	CULLEN/FROST BANKERS INC	3,62	(5 295)	1 067 009	(80 105)
13/08/2030	USD	CUSTOMERS BANCORP INC	3,62	(335)	35 463	(1 421)
13/08/2030	USD	CVRX INC	3,62	(2 465)	16 603	(1 038)
13/08/2030	USD	CYTEK BIOSCIENCES INC	3,62	(1 416)	7 997	(742)
13/08/2030	USD	CYTOKINETICS INC	3,62	(2 781)	260 114	(70 636)
13/08/2030	USD	DARDEN RESTAURANTS INC	3,62	(1 799)	510 891	(4 661)
13/08/2030	USD	DAVE INC (NMS)	3,62	(144)	54 401	(20 599)
13/08/2030	USD	DECKERS OUTDOOR CORP	3,62	12 024	1 825 835	(161 080)
13/08/2030	USD	DEERE & CO (NYSE)	3,62	(2 241)	1 750 261	(236 382)
13/08/2030	USD	DEVON ENERGY CORP	3,62	22 486	1 444 051	(145 109)
13/08/2030	USD	DEXCOM INC (NSM)	3,62	17 615	1 827 183	(178 462)
13/08/2030	USD	DIAMEDICA THERAPEUTICS INC (NAS)	3,62	(1 176)	8 741	(2 828)
13/08/2030	USD	DIANTHUS THERAPEUTICS INC	3,62	(703)	74 920	(20 774)
13/08/2030	USD	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,62	(9 270)	2 779 020	(164 339)
13/08/2030	USD	DIGI INTERNATIONAL INC (NSM)	3,62	(266)	23 878	(3 923)
13/08/2030	USD	DIGITAL TURBINE INC (NAS)	3,62	(4 208)	59 974	(15 838)
13/08/2030	USD	DILLARDS INC-CL A	3,62	1 382	1 118 501	(103 324)
13/08/2030	USD	ACTIONS DE DIME COMMUNITY BANK EN	3,62	(139)	7 604	(260)
13/08/2030	USD	DINE BRANDS GLOBAL INC	3,62	(3 044)	137 878	(15 242)
13/08/2030	USD	DIVERSIFIED ENERGY CO	3,62	297	5 939	(202)
13/08/2030	USD	FONDS DIVERSIFIÉ DANS LE SECTEUR DE LA SANTÉ	3,62	(3 501)	43 306	(2 019)
13/08/2030	USD	DOCUSIGN INC	3,62	21 208	1 333 930	(23 574)
13/08/2030	USD	DOMINION ENERGY INC	3,62	(3 483)	324 316	(14 509)
13/08/2030	USD	DOMINO'S PIZZA INC	3,62	3 090	1 348 423	(68 113)
13/08/2030	USD	DORIAN LPG LTD	3,62	1 770	107 053	(21 855)
13/08/2030	USD	DORMAN PRODUCTS INC (NSM)	3,62	(402)	71 102	(5 295)
13/08/2030	USD	DOUGLAS ELLIMAN INC	3,62	(15 332)	37 417	(338)
13/08/2030	USD	DOUGLAS EMMETT INC	3,62	3 021	52 325	(2 113)
13/08/2030	USD	DOVER CORP (NYS)	3,62	(2 261)	674 002	(33 566)
13/08/2030	USD	DOW INC	3,62	10 657	508 865	(100 844)
13/08/2030	USD	DOXIMITY INC - CLASSE A	3,62	(21 069)	599 771	(10 826)
13/08/2030	USD	DR HORTON INC	3,62	(2 125)	434 763	(47 497)
13/08/2030	USD	DRAFTKINGS INC-CL A	3,62	88 215	3 541 752	(451 388)
13/08/2030	USD	DREAM FINDERS HOMES INC - A	3,62	(7 436)	149 637	(29 415)
13/08/2030	USD	DTE ENERGY COMPANY (NYS)	3,62	(959)	195 350	(9 630)
13/08/2030	USD	DUKE ENERGY CORP (NYS)	3,62	(1 232)	215 131	(1 995)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	DUOLINGO(NSM)	3,62	3 416	576 909	(29 222)
13/08/2030	USD	DUPONT DE NEMOURS INC	3,62	(4 652)	876 927	(3 081)
13/08/2030	USD	DUTCH BROS INC - CATÉGORIE A	3,62	(17 671)	1 485 486	(283 723)
13/08/2030	USD	D-WAVE QUANTUM INC	3,62	(2 317)	75 125	(2 246)
13/08/2030	USD	DXC TECHNOLOGY CO	3,62	(10 646)	130 945	(110)
13/08/2030	USD	DYCOM INDUSTRIES INC	3,62	(2 176)	1 353 071	(180 328)
13/08/2030	USD	DYNE THERAPEUTICS INC	3,62	(1 938)	47 756	(12 338)
13/08/2030	USD	EAGLE BANCORP INC	3,62	(6 582)	256 459	(3 524)
13/08/2030	USD	BIENS IMMOBILIERS DU GOUVERNEMENT D'EASTERLY	3,62	(250)	8 325	(350)
13/08/2030	USD	EASTMAN KODAK CO (NYS)	3,62	8 494	115 018	(5 873)
13/08/2030	USD	EATON CORP PLC	3,62	(4 626)	2 439 429	(308 498)
13/08/2030	USD	EBAY INC (NSM)	3,62	(345)	54 274	(167)
13/08/2030	USD	ECHOSTAR CORP-A (NSM)	3,62	1 654	248 862	(12 648)
13/08/2030	USD	ECOVYST INC	3,62	2 425	43 118	(1 159)
13/08/2030	USD	EDGEWELL PERSONAL CARE CO	3,62	(457)	13 760	(3 472)
13/08/2030	USD	EDITAS MEDICINE INC	3,62	(2 608)	9 020	(2 785)
13/08/2030	USD	EL POLLO LOCO HOLDINGS INC	3,62	(2 725)	57 230	(7 183)
13/08/2030	USD	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,62	(33 201)	1 061 403	(76 542)
13/08/2030	USD	ELASTIC NV	3,62	23 030	1 952 040	(128 933)
13/08/2030	USD	ELEDON PHARMACEUTICALS INC	3,62	(10 293)	49 665	(6 866)
13/08/2030	USD	ELEMENT SOLUTIONS INC	3,62	(15 352)	856 432	(167 422)
13/08/2030	USD	ELF BEAUTY INC	3,62	(16 467)	1 334 671	(366 532)
13/08/2030	USD	EMBECTA CORP	3,62	(4 011)	17 955	(256)
13/08/2030	USD	EMERGENT BIOSOLUTIONS INC	3,62	(4 293)	49 331	(724)
13/08/2030	USD	EMERSON ELECTRIC CO	3,62	(6 953)	1 329 461	(55 859)
13/08/2030	USD	ENANTA PHARMACEUTICALS INC	3,62	(1 321)	21 554	(5 333)
13/08/2030	USD	ENCOMPASS HEALTH CORP	3,62	2 178	313 908	(7 909)
13/08/2030	USD	ENCORE ENERGY CORP (NAS)	3,62	(26 675)	47 616	(1 012)
13/08/2030	USD	ENERGIZER HOLDINGS INC	3,62	(691)	18 695	(1 946)
13/08/2030	USD	ENERGY RECOVERY INC	3,62	(5 842)	64 524	(8 925)
13/08/2030	USD	ENLIVEN THERAPEUTICS INC	3,62	(358)	18 472	(6 919)
13/08/2030	USD	ENNIS INC (NYS)	3,62	(1 303)	37 941	(585)
13/08/2030	USD	ENOVIS CORP	3,62	2 129	65 229	(4 023)
13/08/2030	USD	ENTEGRIIS INC	3,62	(6 216)	1 117 199	(445 111)
13/08/2030	USD	ENTERPRISE FINANCIAL SERVICE	3,62	(2 068)	181 832	(8 813)
13/08/2030	USD	EOG RESOURCES INC (NYS)	3,62	5 923	1 152 335	(84 622)
13/08/2030	USD	EPLUS INC	3,62	54	6 275	(8)
13/08/2030	USD	EPR PROPERTIES	3,62	12 558	1 039 557	(17 689)
13/08/2030	USD	EQUIFAX INC (NYS)	3,62	1 785	411 914	(16 421)
13/08/2030	USD	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,62	(2 743)	887 382	(27 953)
13/08/2030	USD	ESAB CORP	3,62	(6 291)	759 249	(108 746)
13/08/2030	USD	ESQUIRE FINANCIAL HOLDINGS I	3,62	(200)	31 224	(1 947)
13/08/2030	USD	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	3,62	215	9 232	(230)
13/08/2030	USD	ESSEX PROPERTY TRUST INC (NYS)	3,62	(3 121)	1 238 864	(39 006)
13/08/2030	USD	ETON PHARMACEUTICALS INC	3,62	(1 917)	82 740	(14 039)
13/08/2030	USD	EVE HOLDING INC	3,62	11 794	42 270	(1 134)
13/08/2030	USD	EVERUS CONSTRUCTION GROUP	3,62	(636)	121 262	(25 989)
13/08/2030	USD	EVGO INC	3,62	(9 982)	26 310	(221)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	EVOLVENT HEALTH INC - A	3,62	(4 381)	27 310	(5 824)
13/08/2030	USD	EVOLV TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,62	2 159	17 583	(174)
13/08/2030	USD	EXLSERVICE HOLDINGS INC (NSM)	3,62	33 776	1 366 909	(155 127)
13/08/2030	USD	EXP WORLD HOLDINGS INC	3,62	(4 930)	32 313	(4 876)
13/08/2030	USD	EXPEDITORS INTL WASH INC	3,62	2 676	614 667	(5 746)
13/08/2030	USD	EYEPOINT INC	3,62	(6 319)	108 654	(17 344)
13/08/2030	USD	F&G ANNUITIES & LIFE INC	3,62	236	9 426	(642)
13/08/2030	USD	FASTLY INC - CLASSE A	3,62	1 389	36 126	(673)
13/08/2030	USD	FEDERAL AGRIC MTG CORP-CL C	3,62	(442)	110 889	(12 842)
13/08/2030	USD	FEDERATED HERMES INC	3,62	19 127	1 529 195	(61 804)
13/08/2030	USD	FEDEX CORP (NYS)	3,62	2 335	1 039 566	(19 997)
13/08/2030	USD	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,62	10 256	680 799	(1 969)
13/08/2030	USD	FIGS INC - CLASSE A	3,62	1 049	16 794	(1 910)
13/08/2030	USD	FINANCE OF AMERICA COS INC-A	3,62	(1 091)	29 455	(12 538)
13/08/2030	USD	FINANCIAL INSTITUTIONS INC	3,62	(462)	24 373	(893)
13/08/2030	USD	FIRST ADVANTAGE CORP	3,62	(2 010)	44 400	(6 177)
13/08/2030	USD	FIRST AMERICAN FINANCIAL	3,62	(3 814)	351 733	(15 351)
13/08/2030	USD	FIRST BUSEY CORP	3,62	(870)	34 372	(1 352)
13/08/2030	USD	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,62	6 376	554 928	(7 753)
13/08/2030	USD	FIRST INTERSTATE BANCYSYS-A(NSM)	3,62	(161)	8 132	(512)
13/08/2030	USD	FIRST MERCHANTS CORP (NSM)	3,62	(1 230)	70 602	(4 870)
13/08/2030	USD	CINQ DE MOINS	3,62	1 840	486 237	(21 865)
13/08/2030	USD	FLAGSTAR BANK NA	3,62	(47 699)	963 190	(29 198)
13/08/2030	USD	FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A	3,62	(9 490)	652 979	(132 948)
13/08/2030	USD	FLUENCE ENERGY INC	3,62	2 336	70 431	(5 982)
13/08/2030	USD	FLUOR CORP	3,62	(14 823)	968 249	(113 193)
13/08/2030	USD	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI (NYS)	3,62	2 107	331 854	(33 479)
13/08/2030	USD	FMC CORP	3,62	(44 127)	664 690	(46 856)
13/08/2030	USD	FNB CORP (NYS)	3,62	1 278	34 664	(91)
13/08/2030	USD	FORESTAR GROUP INC	3,62	(856)	33 807	(3 949)
13/08/2030	USD	FORTIVE CORP	3,62	(21 279)	1 782 258	(28 181)
13/08/2030	USD	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3,62	(5 605)	316 019	(113 921)
13/08/2030	USD	FORUM ENERGY TECHNOLOGIES IN (NYS)	3,62	1 901	137 509	(4 822)
13/08/2030	USD	FORWARD AIR CORP	3,62	(886)	15 136	(1 539)
13/08/2030	USD	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,62	2 032	71 297	(1 069)
13/08/2030	USD	FRANKLIN COVEY CO	3,62	1 072	36 761	(198)
13/08/2030	USD	FRANKLIN RESOURCES INC (NYS)	3,62	(11 269)	489 371	(37 960)
13/08/2030	USD	FREEDOM HOLDING CORP/NV	3,62	2 192	424 933	(27 831)
13/08/2030	USD	FREEMPORT-MCMORAN INC (NYS)	3,62	(160)	14 240	(27)
13/08/2030	USD	FRESH DEL MONTE PRODUCE INC (État de New York)	3,62	3 011	122 107	(4 064)
13/08/2030	USD	FRESHPET INC	3,62	(4 106)	289 737	(48 634)
13/08/2030	USD	FRONTIER GROUP HOLDINGS INC	3,62	(11 577)	89 361	(38 693)
13/08/2030	USD	FRONTVIEW REIT INC	3,62	(1 006)	27 525	(1 104)
13/08/2030	USD	FTAI INFRASTRUCTURE INC	3,62	(2 073)	12 373	(1 110)
13/08/2030	USD	FULGENT GENETICS INC	3,62	(524)	13 833	(1 146)
13/08/2030	USD	FUNKO INC - CLASSE A	3,62	(9 585)	69 641	(8 914)
13/08/2030	USD	IMMOBILIER DE JEUX ET DE LOISIRS	3,62	1 912	129 079	(9 574)
13/08/2030	USD	GAP INC/THE (NYS)	3,62	17 287	498 310	(48 582)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	GARTNER INC	3,62	11 035	2 328 242	(338 971)
13/08/2030	USD	GATES INDUSTRIAL CORP PLC	3,62	(4 448)	157 565	(15 762)
13/08/2030	USD	GATX CORP	3,62	(1 431)	346 786	(8 722)
13/08/2030	USD	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	3,62	(13 099)	1 164 717	(1 596)
13/08/2030	USD	GEN DIGITAL INC	3,62	(24 490)	841 008	(7 163)
13/08/2030	USD	GENEDX HOLDINGS CORP	3,62	(378)	28 634	(7 595)
13/08/2030	USD	GENERAC HOLDINGS INC (NYS)	3,62	(2 006)	668 902	(150 380)
13/08/2030	USD	GENERAL MOTORS CO	3,62	19 282	2 135 043	(65 609)
13/08/2030	USD	GENPACT LTD	3,62	24 914	1 118 404	(162 115)
13/08/2030	USD	GENTEX CORP (NSM)	3,62	(14 521)	499 532	(11 398)
13/08/2030	USD	GERON CORP (NSM)	3,62	(38 564)	59 157	(9 669)
13/08/2030	USD	GEVO INC	3,62	(45 592)	94 735	(430)
13/08/2030	USD	G-III APPAREL GROUP LTD (NSM)	3,62	220	10 453	(117)
13/08/2030	USD	GILEAD SCIENCES INC	3,62	(11 484)	1 945 504	(86 913)
13/08/2030	USD	GINKGO BIOWORKS HOLDINGS INC	3,62	(1 831)	20 274	(5 056)
13/08/2030	USD	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,62	2 685	47 778	(1 564)
13/08/2030	USD	GLADSTONE LAND CORP (NMS)	3,62	557	7 076	(447)
13/08/2030	USD	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,62	(2 404)	124 042	(2 854)
13/08/2030	USD	GLOBAL PAYMENTS INC (NYS)	3,62	(1 233)	125 410	(1 440)
13/08/2030	USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC (NYS)	3,62	(900)	1 256 714	(15 111)
13/08/2030	USD	GOODRX HOLDINGS INC - CATÉGORIE A	3,62	(21 586)	77 063	(9 582)
13/08/2030	USD	GOOSEHEAD INSURANCE INC -A	3,62	(654)	35 223	(9 068)
13/08/2030	USD	GRAHAM HOLDINGS CO - CATÉGORIE B	3,62	264	422 200	(3 259)
13/08/2030	USD	GRAND CANYON EDUCATION INC (NSM)	3,62	4 126	867 115	(46 862)
13/08/2030	USD	GRANITE CONSTRUCTION INC	3,62	(38)	7 194	(1 189)
13/08/2030	USD	GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	3,62	(11 516)	171 491	(818)
13/08/2030	USD	GRAY MEDIA INC	3,62	(2 171)	12 231	-
13/08/2030	USD	GREAT SOUTHERN BANCORP INC	3,62	(870)	91 468	(4 016)
13/08/2030	USD	GREEN BRICK PARTNERS INC (NYS)	3,62	(652)	63 647	(9 104)
13/08/2030	USD	GROCERY OUTLET HOLDING CORP	3,62	(5 187)	66 838	(5 261)
13/08/2030	USD	GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	3,62	15	6 821	(752)
13/08/2030	USD	GXO LOGISTICS INC	3,62	(11 589)	775 268	(43 069)
13/08/2030	USD	H.B. FULLER CO.	3,62	89	7 595	(389)
13/08/2030	USD	HA INFRASTRUCTURES DURABLES	3,62	(2 123)	107 678	(7 768)
13/08/2030	USD	HACKETT GROUP INC/THE (NSM)	3,62	456	6 944	(51)
13/08/2030	USD	HAEMONETICS CORP/MASS (État de New York)	3,62	2 547	279 891	(14 520)
13/08/2030	USD	HAINE CELESTIAL GROUP INC	3,62	6 395	5 655	(686)
13/08/2030	USD	HALOZYME THERAPEUTICS INC	3,62	(14 359)	1 411 716	(154 482)
13/08/2030	USD	HAMILTON LANE INC - CATÉGORIE A	3,62	(7 945)	865 214	(12 780)
13/08/2030	USD	HANCOCK WHITNEY CORP	3,62	(6 047)	597 383	(35 975)
13/08/2030	USD	HARLEY-DAVIDSON INC	3,62	(23 454)	798 724	(5 394)
13/08/2030	USD	HARMONIC INC	3,62	(3 238)	60 960	(12 816)
13/08/2030	USD	HAWAIIAN ELECTRIC INDS (NYS)	3,62	(3 189)	58 125	(1 926)
13/08/2030	USD	HEALTH CATALYST INC	3,62	(18 237)	40 692	(9 979)
13/08/2030	USD	HEARTLAND EXPRESS INC	3,62	597	13 138	(497)
13/08/2030	USD	HEICO CORP (NYSE)	3,62	(3 702)	1 656 583	(180 786)
13/08/2030	USD	HELMERICH & PAYNE	3,62	616	33 821	(5 882)
13/08/2030	USD	HENRY SCHEIN INC	3,62	(19 865)	2 184 361	(125 640)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	HERC HOLDINGS INC	3,62	(238)	46 924	(770)
13/08/2030	USD	HERITAGE INSURANCE HOLDINGS	3,62	(400)	12 384	(2 166)
13/08/2030	USD	HERON THERAPEUTICS INC	3,62	(50 540)	28 784	(1 254)
13/08/2030	USD	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	3,62	22 587	1 436 175	(8 919)
13/08/2030	USD	HILTON GRAND VACATIONS INC	3,62	(15 334)	1 066 635	(51 220)
13/08/2030	USD	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS EN	3,62	3 837	1 809 010	(42 077)
13/08/2030	USD	HNI CORP (NYS)	3,62	(3 028)	134 408	(36 451)
13/08/2030	USD	HOLLEY INC	3,62	(11 600)	40 765	(387)
13/08/2030	USD	HOME DEPOT INC (NYS)	3,62	(5 709)	2 539 077	(285 198)
13/08/2030	USD	HOPE BANCORP INC	3,62	(384)	6 903	(412)
13/08/2030	USD	HORMEL FOODS CORP (NYS)	3,62	(37 275)	1 262 639	(24 632)
13/08/2030	USD	HOULIHAN LOKEY INC	3,62	6 514	1 235 074	(15 122)
13/08/2030	USD	HP INC (NYS)	3,62	30 552	1 029 073	(85 894)
13/08/2030	USD	HUBBELL INC	3,62	(2 439)	1 590 417	(192 757)
13/08/2030	USD	HUBSPOT INC	3,62	8 243	2 205 869	(111 252)
13/08/2030	USD	HUMANA INC	3,62	(719)	365 437	(33 310)
13/08/2030	USD	HUNTINGTON BANCSHARES INC	3,62	(67 166)	1 577 341	(95 273)
13/08/2030	USD	HUNTSMAN CORP (NYS)	3,62	52 858	1 048 938	(268 366)
13/08/2030	USD	HUT 8 CORP	3,62	(317)	46 718	(4 251)
13/08/2030	USD	HYATT HOTELS CORP - CL A	3,62	(7 038)	1 871 004	(28 070)
13/08/2030	USD	I3 VERTICALS INC - CLASSE A	3,62	(2 371)	66 196	(4 329)
13/08/2030	USD	IBEX LTD	3,62	252	10 820	(182)
13/08/2030	USD	IBOTTA INC-CL A	3,62	(1 142)	50 548	(3 803)
13/08/2030	USD	ICU MEDICAL INC (NSM)	3,62	(71)	13 845	(645)
13/08/2030	USD	IDEX CORP	3,62	(5 741)	1 717 311	(96 685)
13/08/2030	USD	IMAX CORP (NYSE)	3,62	551	32 411	(1 910)
13/08/2030	USD	IMMUNOME INC	3,62	(1 992)	50 447	(8 421)
13/08/2030	USD	IMMUNOVANT INC	3,62	(962)	41 830	(9 901)
13/08/2030	USD	INDEPENDENT BANK CORP/MA(NSM)	3,62	(211)	23 931	(843)
13/08/2030	USD	INDIE SEMICONDUCTOR INC-A	3,62	(6 849)	37 632	(5 290)
13/08/2030	USD	INGERSOLL-RAND INC	3,62	(12 213)	1 201 723	(194 596)
13/08/2030	USD	INGREDION INC (NYS)	3,62	9 943	1 421 821	(114 448)
13/08/2030	USD	INNODATA INC (NMS)	3,62	260	36 218	(9 062)
13/08/2030	USD	INNOSPEC INC	3,62	729	84 736	(2 278)
13/08/2030	USD	INNOVIVA INC	3,62	3 519	112 871	(1 778)
13/08/2030	USD	INSIGHT ENTERPRISES INC (NSM)	3,62	(401)	60 999	(7 069)
13/08/2030	USD	INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC	3,62	(2 609)	153 831	(8 074)
13/08/2030	USD	INSTEEL INDUSTRIES INC	3,62	(1 157)	44 887	(3 830)
13/08/2030	USD	INTEGER HOLDINGS CORP (NYS)	3,62	(563)	71 737	(1 473)
13/08/2030	USD	INTEGRA LIFESCIENCES HOLDING	3,62	(3 395)	80 913	(3 968)
13/08/2030	USD	MARCHÉ INTERCONTINENTAL À	3,62	15 248	2 919 712	(296 829)
13/08/2030	USD	INTERNATIONAL SEAWAYS INC	3,62	704	81 103	(1 704)
13/08/2030	USD	INTL BUSINESS MACHINES CORP (NYS)	3,62	(1 090)	414 003	(12 509)
13/08/2030	USD	INTREPID POTASH INC (NYS)	3,62	739	34 833	(1 175)
13/08/2030	USD	INTUIT INC	3,62	3 322	1 277 627	(67 793)
13/08/2030	USD	INVESCO LTD	3,62	41 133	1 575 161	(67 145)
13/08/2030	USD	INVESTORS TITLE CO	3,62	(56)	19 728	(1 657)
13/08/2030	USD	IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,62	(11 413)	1 166 991	(93 445)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	IPG PHOTONICS CORP	3,62	(4 152)	617 239	(63 188)
13/08/2030	USD	IRADIMED CORP	3,62	288	38 557	(290)
13/08/2030	USD	IRIDIUM COMMUNICATIONS INC (NSM)	3,62	(1 674)	106 475	(21 697)
13/08/2030	USD	ITT INC	3,62	(1 749)	478 529	(9 984)
13/08/2030	USD	JACK IN THE BOX INC	3,62	(4 209)	72 608	(20 365)
13/08/2030	USD	JACKSON FINANCIAL INC-A	3,62	113	16 805	(608)
13/08/2030	USD	JAKKS PACIFIC INC (NSM)	3,62	(1 002)	30 769	(2 063)
13/08/2030	USD	JANUS INTERNATIONAL GROUP À	3,62	(3 538)	25 410	(1 937)
13/08/2030	USD	JANUX THERAPEUTICS INC	3,62	(2 682)	49 183	(8 265)
13/08/2030	USD	JBG SMITH PROPERTIES	3,62	752	15 437	(98)
13/08/2030	USD	JBT MAREL CORP	3,62	(627)	104 052	(22 815)
13/08/2030	USD	JELD-WEN HOLDING INC	3,62	29 616	67 321	(5 665)
13/08/2030	USD	JM SMUCKER CO/THE	3,62	9 598	1 566 701	(66 433)
13/08/2030	USD	JOBY AVIATION INC	3,62	(4 767)	58 900	(247)
13/08/2030	USD	JOHN B. SANFILIPPO & SON INC (NSM)	3,62	(270)	29 350	(2 999)
13/08/2030	USD	JPMORGAN CHASE & CO	3,62	(3 974)	1 713 236	(97 371)
13/08/2030	USD	KADANT INC	3,62	(19)	7 383	(938)
13/08/2030	USD	KB HOME	3,62	(8 181)	595 084	(119 172)
13/08/2030	USD	KIMBERLY-CLARK CORP (NSM)	3,62	(10 359)	1 467 439	(135 163)
13/08/2030	USD	KINDERCARE LEARNING COS INC	3,62	(5 117)	27 759	(2 535)
13/08/2030	USD	KINSALE CAPITAL GROUP INC	3,62	(683)	298 668	(14 975)
13/08/2030	USD	KIRBY CORP (NYS)	3,62	1 598	311 008	(9 058)
13/08/2030	USD	KITE REALTY GROUP TRUST	3,62	3 773	151 746	(2 908)
13/08/2030	USD	KKR & CO INC	3,62	8 791	1 164 897	(43 832)
13/08/2030	USD	KNIFE RIVER CORP	3,62	(5 936)	600 338	(91 857)
13/08/2030	USD	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,62	13 889	1 534 986	(28 268)
13/08/2030	USD	KOHL'S CORP	3,62	(2 929)	64 823	(8 020)
13/08/2030	USD	KONTOOR BRANDS INC	3,62	(970)	102 725	(10 535)
13/08/2030	USD	KORN FERRY	3,62	753	76 972	(7 397)
13/08/2030	USD	KORRO BIO INC	3,62	(1 492)	22 034	(5 421)
13/08/2030	USD	KOSMOS ENERGY LTD	3,62	13 144	54 623	(16 349)
13/08/2030	USD	KRAFT HEINZ CO/THE	3,62	20 672	693 317	(4 645)
13/08/2030	USD	KROGER CO (NYS)	3,62	33 975	3 054 104	(438 654)
13/08/2030	USD	KULR TECHNOLOGY GROUP INC	3,62	(9 026)	44 307	(3 964)
13/08/2030	USD	KURA SUSHI USA INC - CATÉGORIE A	3,62	(989)	61 237	(18 269)
13/08/2030	USD	KYMERA THERAPEUTICS INC	3,62	(952)	103 859	(48 861)
13/08/2030	USD	LABCORP HOLDINGS INC	3,62	(3 757)	1 407 440	(60 720)
13/08/2030	USD	LANDSTAR SYSTEM INC	3,62	8 379	2 558 066	(151 271)
13/08/2030	USD	LANTHEUS HOLDINGS INC (NMS)	3,62	(6 637)	927 784	(98 111)
13/08/2030	USD	LARIMAR THERAPEUTICS INC	3,62	11 029	52 909	(6 259)
13/08/2030	USD	LAS VEGAS SANDS CORP (NYS)	3,62	13 408	950 052	(90 615)
13/08/2030	USD	LATHAM GROUP INC	3,62	(5 908)	43 914	(9 424)
13/08/2030	USD	LAUREATE EDUCATION INC	3,62	137	6 972	(54)
13/08/2030	USD	LEGACY HOUSING CORP	3,62	(3 141)	106 835	(8 084)
13/08/2030	USD	LEIDOS HOLDINGS INC	3,62	2 764	461 994	(65 344)
13/08/2030	USD	LEMONADE INC	3,62	(885)	68 941	(11 342)
13/08/2030	USD	LENNOX INTERNATIONAL INC	3,62	(3 216)	2 263 964	(310 712)
13/08/2030	USD	LEONARDO DRS INC	3,62	7 622	487 641	(34 481)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	LEXEO THERAPEUTICS INC	3,62	(8 839)	50 908	(6 429)
13/08/2030	USD	LGI HOMES INC (NSM)	3,62	(2 119)	155 318	(32 969)
13/08/2030	USD	LIBERTY GLOBAL LTD-A	3,62	73 868	1 213 489	(46 503)
13/08/2030	USD	LIBERTY LATIN AMERIC-CL C	3,62	5 297	58 209	(827)
13/08/2030	USD	LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-A	3,62	(1 671)	190 385	(13 329)
13/08/2030	USD	LIFEMD INC	3,62	7 441	51 573	(9 004)
13/08/2030	USD	LIGHTBRIDGE CORP (NAS)	3,62	(2 311)	28 103	(151)
13/08/2030	USD	LIMBACH HOLDINGS INC (NAS)	3,62	(1 163)	124 299	(255)
13/08/2030	USD	LINEAGE INC	3,62	7 812	482 941	(8 334)
13/08/2030	USD	LIQUIDIA CORP	3,62	(391)	35 579	(7 924)
13/08/2030	USD	LIVE OAK BANCSHARES INC	3,62	(1 130)	60 213	(4 100)
13/08/2030	USD	LKQ CORP	3,62	(15 365)	545 752	(17 275)
13/08/2030	USD	LOAR HOLDINGS INC	3,62	(10 698)	967 789	(235 856)
13/08/2030	USD	LOCKHEED MARTIN CORP (NYS)	3,62	1 862	1 363 294	(35 683)
13/08/2030	USD	LOVESAC CO/THE	3,62	(2 363)	54 307	(569)
13/08/2030	USD	LOWE'S COS INC (NYS)	3,62	(475)	143 207	(2 514)
13/08/2030	USD	LSB INDUSTRIES INC	3,62	2 023	33 516	(3 165)
13/08/2030	USD	LSI INDUSTRIES INC (NSM)	3,62	(2 740)	94 113	(7 317)
13/08/2030	USD	LTC PROPERTIES INC (NYS)	3,62	(138)	7 186	(236)
13/08/2030	USD	LUMENTUM HOLDINGS INC	3,62	(466)	554 500	(1 682)
13/08/2030	USD	LXP INDUSTRIAL TRUST	3,62	(91)	6 694	(169)
13/08/2030	USD	LYFT INC-A	3,62	(29 993)	561 110	(49 084)
13/08/2030	USD	LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,62	15 175	1 378 724	(272 726)
13/08/2030	USD	MACERICH CO/THE (NYS)	3,62	(1 468)	49 993	(1 824)
13/08/2030	USD	MACY'S INC (NYS)	3,62	(30 549)	986 665	(22 421)
13/08/2030	USD	MAGNITE INC	3,62	(4 840)	105 767	(22 405)
13/08/2030	USD	MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	3,62	2 037	79 000	(6 667)
13/08/2030	USD	MALIBU BOATS INC - A(NMS)	3,62	(1 795)	66 598	(1 919)
13/08/2030	USD	MAMA'S CREATIONS INC	3,62	(5 053)	96 116	(29 851)
13/08/2030	USD	MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,62	17 276	3 495 526	(151 791)
13/08/2030	USD	MANNKIND CORP	3,62	(7 535)	38 144	(6 624)
13/08/2030	USD	MARAVAI LIFESCIENCES HLDGS-A	3,62	(10 269)	72 749	(16 688)
13/08/2030	USD	MARKEL GROUP INC	3,62	(365)	926 878	(65 861)
13/08/2030	USD	MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,62	(690)	110 879	(358)
13/08/2030	USD	MARQETA INC-A	3,62	(2 643)	14 117	(824)
13/08/2030	USD	MARRIOTT VACATIONS WORLD	3,62	(5 859)	716 813	(115 284)
13/08/2030	USD	MARSH & MCLENNAN COS	3,62	2 572	599 531	(3 510)
13/08/2030	USD	MARTEN TRANSPORT LTD	3,62	457	11 274	(220)
13/08/2030	USD	MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,62	(19)	14 783	(483)
13/08/2030	USD	MARVELL TECHNOLOGY INC	3,62	(1 728)	608 687	(107 848)
13/08/2030	USD	MASTEC INC	3,62	(1 144)	535 373	(128 955)
13/08/2030	USD	MASTERBRAND INC	3,62	(2 995)	36 755	(6 227)
13/08/2030	USD	MASTERCRAFT BOAT HOLDINGS EN	3,62	(716)	22 177	(3 603)
13/08/2030	USD	MATIV HOLDINGS INC	3,62	1 247	13 703	(439)
13/08/2030	USD	MATSON INC (NYS)	3,62	69	18 613	(173)
13/08/2030	USD	MATTHEWS INTL CORP - CATÉGORIE A	3,62	(2 757)	98 349	(4 972)
13/08/2030	USD	MAYVILLE ENGINEERING CO INC	3,62	(2 610)	123 170	(13 059)
13/08/2030	USD	MBIA INC	3,62	(3 487)	30 003	(1 651)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	MBX BIOSCIENCES INC	3,62	(1 386)	59 899	(47 360)
13/08/2030	USD	MCDONALD'S CORP (NYS)	3,62	2 405	947 542	(41 339)
13/08/2030	USD	MCKESSON CORP (NYS)	3,62	4 106	4 526 077	(211 754)
13/08/2030	USD	MDU RESOURCES GROUP INC	3,62	(21 662)	638 613	(4 773)
13/08/2030	USD	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3,62	20 240	140 564	(8 528)
13/08/2030	USD	MEDIFAST INC (NYS)	3,62	591	10 006	(1 309)
13/08/2030	USD	MERCANTILE BANK CORP	3,62	(439)	33 292	(2 047)
13/08/2030	USD	MERCHANTS BANCORP/IN	3,62	(1 138)	78 715	(617)
13/08/2030	USD	MERITAGE HOMES CORP (NYS)	3,62	(1 250)	122 999	(24 055)
13/08/2030	USD	MESA LABORATORIES INC (NSM)	3,62	205	30 652	(2 275)
13/08/2030	USD	META PLATFORMS INC - CLASSE A	3,62	1 500	1 194 390	(18 930)
13/08/2030	USD	METHODE ELECTRONICS INC (NYS)	3,62	(602)	8 857	(7 156)
13/08/2030	USD	METLIFE INC	3,62	9 525	1 144 072	(23 936)
13/08/2030	USD	MGM RESORTS INTERNATIONAL (NYSE)	3,62	(4 072)	266 383	(4 485)
13/08/2030	USD	MGP INGREDIENTS INC	3,62	(4 353)	99 677	(6 527)
13/08/2030	USD	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,62	(2 361)	289 447	(10 043)
13/08/2030	USD	MICROSOFT CORP	3,62	1 819	1 007 051	(62 118)
13/08/2030	USD	MICROVAST HOLDINGS INC	3,62	(5 223)	8 231	(276)
13/08/2030	USD	MID PENN BANCORP INC	3,62	(502)	23 620	(721)
13/08/2030	USD	MIDDLEBY CORP (NSM)	3,62	(3 439)	737 363	(86 795)
13/08/2030	USD	MIDDLESEX WATER CO	3,62	(126)	9 439	(412)
13/08/2030	USD	MILLER INDUSTRIES INC/TENN	3,62	(366)	24 397	(1 672)
13/08/2030	USD	MILLERKNOLL INC	3,62	(661)	13 679	(5 402)
13/08/2030	USD	MILLROSE PROPERTIES	3,62	(6 429)	258 208	(10 710)
13/08/2030	USD	MINERALS TECHNOLOGIES INC	3,62	635	67 257	(1 895)
13/08/2030	USD	MODERNA INC	3,62	(5 924)	379 938	(200 331)
13/08/2030	USD	MODINE MANUFACTURING CO (État de New York)	3,62	(131)	47 164	(1 511)
13/08/2030	USD	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	3,62	40 327	2 300 135	(94 268)
13/08/2030	USD	MONGODB INC	3,62	2 265	1 101 599	(42 672)
13/08/2030	USD	MONOPAR THERAPEUTICS INC	3,62	(608)	50 381	(28 512)
13/08/2030	USD	MONRO INC	3,62	(1 173)	23 245	(5 221)
13/08/2030	USD	MONTROSE ENVIRONMENTAL GROUP	3,62	(2 968)	69 577	(14 117)
13/08/2030	USD	MOONLAKE IMMUNOTHERAPEUTICS	3,62	(228)	5 561	(624)
13/08/2030	USD	MORGAN STANLEY (NYS)	3,62	(5 284)	1 522 837	(13 577)
13/08/2030	USD	MORNINGSTAR INC	3,62	7 490	1 942 735	(323 282)
13/08/2030	USD	MP MATERIALS CORP	3,62	(6 858)	511 186	(23 595)
13/08/2030	USD	MSA SAFETY INC	3,62	(2 489)	542 453	(63 096)
13/08/2030	USD	MSC INDUSTRIAL DIRECT CO-A	3,62	(2 808)	450 955	(13 893)
13/08/2030	USD	MSCI INC (NYS)	3,62	2 688	2 281 068	(191 248)
13/08/2030	USD	MUELLER INDUSTRIES INC (NYS)	3,62	10 610	1 959 605	(144 278)
13/08/2030	USD	MURPHY OIL CORP (NYS)	3,62	6 904	383 578	(72 288)
13/08/2030	USD	MURPHY USA INC	3,62	1 012	863 932	(107 547)
13/08/2030	USD	MYERS INDUSTRIES INC (NYS)	3,62	(462)	16 101	(6 801)
13/08/2030	USD	MYOMO INC	3,62	3 118	6 696	(2 226)
13/08/2030	USD	NABORS INDUSTRIES LTD	3,62	783	112 327	(21 233)
13/08/2030	USD	NASDAQ INC	3,62	4 064	491 481	(45 415)
13/08/2030	USD	NATIONAL BANK HOLD-CL A	3,62	(1 271)	76 039	(3 133)
13/08/2030	USD	NATIONAL BEVERAGE CORP	3,62	2 248	116 338	(19 165)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	NATIONAL VISION HOLDINGS INC	3,62	(346)	8 483	(679)
13/08/2030	USD	NATURAL GAS SERVICES GROUP (NYS)	3,62	(1 428)	82 723	(3 018)
13/08/2030	USD	NATURAL GROCERS BY VITAMIN C (État de New York)	3,62	2 816	123 506	(2 079)
13/08/2030	USD	NAVIENT CORP	3,62	(2 592)	28 556	(2 753)
13/08/2030	USD	NCINO INC	3,62	(53 762)	1 155 346	(68 695)
13/08/2030	USD	NCR VOYIX CORP	3,62	(8 740)	85 075	(14 505)
13/08/2030	USD	IMMEUBLE DE BUREAUX À LOYER NET	3,62	1 758	28 929	(1 754)
13/08/2030	USD	NETAPP INC	3,62	6 491	1 454 298	(58 536)
13/08/2030	USD	NETGEAR INC (NSM)	3,62	857	28 588	(776)
13/08/2030	USD	NEUROGENE INC	3,62	(1 603)	62 615	(7 641)
13/08/2030	USD	NEURONETICS INC	3,62	(29 619)	51 218	(2 434)
13/08/2030	USD	NEW YORK TIMES CO-A	3,62	30 876	3 141 852	(135 723)
13/08/2030	USD	NEWAMSTERDAM PHARMA CO NV	3,62	(1 138)	46 547	(7 229)
13/08/2030	USD	NEWELL BRANDS INC (NSM)	3,62	(78 302)	489 198	(190 548)
13/08/2030	USD	NEWMARKET CORP	3,62	252	289 554	(11 564)
13/08/2030	USD	NEWS CORP - CLASSE A	3,62	11 406	428 991	(35 807)
13/08/2030	USD	NEWTEKONE INC	3,62	(3 184)	60 032	(6 518)
13/08/2030	USD	NEXPOINT RÉSIDENTIEL	3,62	183	7 289	(70)
13/08/2030	USD	NEXTERA ENERGY INC	3,62	(15 763)	1 871 133	(68 210)
13/08/2030	USD	NEXTPOWER INC-CL A	3,62	(9 172)	1 442 393	(79 130)
13/08/2030	USD	NORDSON CORP (NSM)	3,62	(2 563)	995 674	(84 284)
13/08/2030	USD	NORTHEAST BANK	3,62	(142)	25 110	(1 087)
13/08/2030	USD	NORTHERN OIL AND GAS INC	3,62	326	9 706	(1 329)
13/08/2030	USD	NORTHRIM BANCORP INC (NSM)	3,62	(570)	20 198	(1 959)
13/08/2030	USD	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	3,62	(77 500)	1 949 068	(332 755)
13/08/2030	USD	NOV INC	3,62	33 920	997 150	(117 055)
13/08/2030	USD	NOVANTA INC	3,62	(6 498)	1 400 771	(66 703)
13/08/2030	USD	NOVOCURE LTD	3,62	920	21 362	(2 018)
13/08/2030	USD	NRG ENERGY INC	3,62	(8 052)	1 354 769	(286 024)
13/08/2030	USD	NURIX THERAPEUTICS INC	3,62	(1 077)	22 980	(13 609)
13/08/2030	USD	NUSCALE POWER CORP	3,62	(3 681)	47 689	(3 723)
13/08/2030	USD	NUVALENT INC-A	3,62	659	113 360	(195)
13/08/2030	USD	NUVATION BIO INC	3,62	(6 935)	44 294	(10 681)
13/08/2030	USD	NVE CORP (NAS)	3,62	171	24 968	(112)
13/08/2030	USD	NVIDIA CORP	3,62	21 474	6 001 891	(23 816)
13/08/2030	USD	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,62	39 217	3 109 977	(458 331)
13/08/2030	USD	OCEANFIRST FINANCIAL CORP	3,62	(3 661)	93 379	(6 189)
13/08/2030	USD	OIL STATES INTERNATIONAL INC (NYS)	3,62	9 059	105 993	(5 185)
13/08/2030	USD	OKTA INC	3,62	(1 538)	246 482	(45 269)
13/08/2030	USD	OLD NATIONAL BANCORP (NSM)	3,62	(14 951)	508 112	(34 143)
13/08/2030	USD	OLEMA PHARMACEUTICALS INC	3,62	(1 592)	21 802	(6 013)
13/08/2030	USD	OLIN CORP	3,62	11 549	386 473	(67 749)
13/08/2030	USD	OMNICELL INC (NSM)	3,62	(942)	50 156	(4 327)
13/08/2030	USD	OMNICOM GROUP	3,62	2 428	250 494	(2 000)
13/08/2030	USD	ON SEMICONDUCTOR	3,62	2 221	332 268	(40 018)
13/08/2030	USD	ONEMAIN HOLDINGS INC	3,62	(5 562)	422 884	(49 686)
13/08/2030	USD	ONESPAN INC	3,62	(912)	17 971	(238)
13/08/2030	USD	ONESPAWORLD HOLDINGS LTD	3,62	(232)	7 703	(1 435)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ONEWATER MARINE INC-CL A	3,62	(3 080)	45 014	(3 330)
13/08/2030	USD	ONTO INNOVATION INC	3,62	(1 909)	717 009	(293 072)
13/08/2030	USD	OOMA INC (NYS)	3,62	(479)	11 710	(1 117)
13/08/2030	USD	OPENDOOR TECHNOLOGIES INC (NSM)	3,62	(6 278)	39 222	(1 144)
13/08/2030	USD	OPKO HEALTH INC (NSM)	3,62	(15 889)	31 908	(1 268)
13/08/2030	USD	OPORTUN FINANCIAL CORP	3,62	(3 660)	25 010	(4 132)
13/08/2030	USD	OPTIMIZERX CORP (NAS)	3,62	(4 085)	28 939	(3 637)
13/08/2030	USD	ORASURE TECHNOLOGIES INC (NSM)	3,62	(12 796)	71 914	(7 602)
13/08/2030	USD	ORGANON & CO	3,62	(78 664)	1 467 798	(16 348)
13/08/2030	USD	ORIC PHARMACEUTICALS INC	3,62	(1 869)	19 652	(8 659)
13/08/2030	USD	ORION GROUP HOLDINGS INC	3,62	(2 522)	46 847	(12 374)
13/08/2030	USD	ORION SA	3,62	5 441	54 632	(4 407)
13/08/2030	USD	ORTHOFIX MEDICAL INC	3,62	3 004	40 761	(2 629)
13/08/2030	USD	ORTHOPEDIATRICS CORP	3,62	(913)	23 504	(805)
13/08/2030	USD	OUSTER INC	3,62	(1 150)	61 567	(39 162)
13/08/2030	USD	OUTFRONT MEDIA INC	3,62	(276)	11 682	(1 029)
13/08/2030	USD	OUTSET MEDICAL INC	3,62	5 391	34 733	(2 394)
13/08/2030	USD	PACIFIC BIOSCIENCES OF CALIF	3,62	(8 995)	17 185	(3 909)
13/08/2030	USD	PACIRA BIOSCIENCES INC	3,62	(817)	26 684	(2 189)
13/08/2030	USD	PACKAGING CORP OF AMERICA	3,62	(4 160)	1 256 800	(132 975)
13/08/2030	USD	PAGERDUTY INC	3,62	(10 481)	128 623	(12 294)
13/08/2030	USD	PALO ALTO NETWORKS INC	3,62	(1 236)	594 636	(5 679)
13/08/2030	USD	PAPA JOHN'S INTL INC (NSM)	3,62	(1 444)	63 896	(10 168)
13/08/2030	USD	PAR TECHNOLOGY CORP/DEL (NYS)	3,62	(1 622)	30 491	(8 970)
13/08/2030	USD	PARK HOTELS & RESORTS INC	3,62	(8 731)	169 487	(6 717)
13/08/2030	USD	PATRICK INDUSTRIES INC (NSM)	3,62	(854)	99 623	(7 148)
13/08/2030	USD	PATTERSON-UTI ENERGY INC	3,62	6 083	101 966	(24 021)
13/08/2030	USD	PAYLOCITY HOLDING CORP (NSM)	3,62	3 653	566 387	(35 121)
13/08/2030	USD	PAYONEER GLOBAL INC	3,62	(2 805)	26 091	(1 719)
13/08/2030	USD	PAYPAL HOLDINGS INC (NSM)	3,62	(16 252)	926 770	(54 408)
13/08/2030	USD	PAYSAFE LTD (NYS)	3,62	(1 502)	14 390	(1 240)
13/08/2030	USD	PAYSIGN INC	3,62	(2 626)	25 452	(4 546)
13/08/2030	USD	PBF ENERGY INC - CATÉGORIE A	3,62	(23 812)	1 413 623	(95 983)
13/08/2030	USD	PC CONNECTION INC (NSM)	3,62	1 407	145 414	(2 648)
13/08/2030	USD	PDF SOLUTIONS INC (NSM)	3,62	(434)	34 862	(8 015)
13/08/2030	USD	PEABODY ENERGY CORP	3,62	1 158	42 407	(5 276)
13/08/2030	USD	PEAPACK GLADSTONE FINL CORP	3,62	(119)	7 562	(277)
13/08/2030	USD	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,62	(1 175)	28 233	(3 569)
13/08/2030	USD	PEGASYSTEMS INC	3,62	34 832	1 586 070	(134 032)
13/08/2030	USD	PENGUIN SOLUTIONS INC (NSM)	3,62	(93)	7 590	(2 284)
13/08/2030	USD	PENNANT GROUP INC/THE	3,62	(969)	43 648	(6 269)
13/08/2030	USD	PENNYMAC FINANCIAL SERVICES	3,62	(1 096)	122 396	(10 579)
13/08/2030	USD	PEOPLES BANCORP INC	3,62	(167)	8 398	(534)
13/08/2030	USD	PEPSICO INC	3,62	7 522	1 513 889	(86 135)
13/08/2030	USD	PERDOCEO EDUCATION CORP	3,62	1 584	77 800	(7 160)
13/08/2030	USD	PERELLA WEINBERG PARTNERS	3,62	(859)	17 621	(1 558)
13/08/2030	USD	PERFORMANCE FOOD GROUP CO	3,62	(4 043)	567 989	(61 754)
13/08/2030	USD	PERIMETER SOLUTIONS INC	3,62	(880)	41 504	(2 168)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	PERMA-FIX ENVIRONMENTAL SVCS (NAS)	3,62	(1 484)	19 557	(10 126)
13/08/2030	USD	PERMIAN RESOURCES CORP	3,62	14 143	381 299	(14 880)
13/08/2030	USD	PERSONALIS INC	3,62	(2 521)	33 785	(13 449)
13/08/2030	USD	PERSPECTIVE THERAPEUTICS INC	3,62	(14 000)	57 595	(8 978)
13/08/2030	USD	PHIBRO ANIMAL HEALTH CORP-A(NMS)	3,62	(141)	6 131	(52)
13/08/2030	USD	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,62	6 080	1 551 208	(11 350)
13/08/2030	USD	PIPER SANDLER COS	3,62	1 472	157 099	(8 897)
13/08/2030	USD	PJT PARTNERS INC - A	3,62	523	114 690	(4 853)
13/08/2030	USD	PLANET FITNESS INC - CL A	3,62	(5 323)	375 613	(10 850)
13/08/2030	USD	PLAYTIKA HOLDING CORP	3,62	(3 238)	14 224	(2 576)
13/08/2030	USD	POOL CORP	3,62	(3 536)	936 938	(122 355)
13/08/2030	USD	PORCH GROUP INC	3,62	(862)	11 312	(6 844)
13/08/2030	USD	PORTILLO'S INC-CL A	3,62	(8 568)	50 064	(6 549)
13/08/2030	USD	POST HOLDINGS INC (NYS)	3,62	4 286	559 033	(33 626)
13/08/2030	USD	PRECIGEN INC	3,62	(11 714)	63 546	(29 849)
13/08/2030	USD	PREFERRED BANK/LOS ANGELES	3,62	(68)	9 549	(511)
13/08/2030	USD	PRESTIGE CONSUMER HEALTHCARE	3,62	715	48 988	(2 025)
13/08/2030	USD	PRIMEENERGY RESOURCES CORP	3,62	34	9 078	(1 210)
13/08/2030	USD	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,62	6 623	1 008 675	(9 875)
13/08/2030	USD	PROCEPT BIOROBOTICS CORP	3,62	452	18 337	(4 215)
13/08/2030	USD	PROCORE TECHNOLOGIES INC	3,62	26 542	1 611 596	(114 399)
13/08/2030	USD	PROTAGONIST THERAPEUTICS INC	3,62	(382)	56 346	(8 946)
13/08/2030	USD	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,62	(474)	69 717	(1 491)
13/08/2030	USD	PTC THERAPEUTICS INC	3,62	(552)	56 464	(6 275)
13/08/2030	USD	PUBMATIC INC - CLASSE A	3,62	(5 137)	80 091	(13 912)
13/08/2030	USD	PULTEGROUP INC (NYS)	3,62	(7 329)	1 211 046	(193 776)
13/08/2030	USD	PURSUIT ATTRACTIONS AND HOSP	3,62	(1 026)	66 332	(13 791)
13/08/2030	USD	QNITY ELECTRONICS INC	3,62	(3 700)	721 035	(121 966)
13/08/2030	USD	QUANEX BUILDING PRODUCTS	3,62	(320)	7 078	(1 269)
13/08/2030	USD	QUANTERIX CORP	3,62	(11 845)	50 712	(20 845)
13/08/2030	USD	QUANTUM COMPUTING INC	3,62	(11 952)	158 843	(2 764)
13/08/2030	USD	QUANTUMSCAPE CORP	3,62	(42 272)	412 653	(32 137)
13/08/2030	USD	QUEST DIAGNOSTICS INC	3,62	(4 045)	1 149 514	(43 877)
13/08/2030	USD	QUIDELORTHO CORP	3,62	(566)	10 656	(3 193)
13/08/2030	USD	QXO INC	3,62	(51 171)	1 074 689	(158 853)
13/08/2030	USD	RADNET INC	3,62	(718)	58 235	(3 424)
13/08/2030	USD	RALLIANT CORP	3,62	(3 518)	306 381	(55 111)
13/08/2030	USD	RAMBUS INC (NSM)	3,62	5 611	1 080 764	(45 936)
13/08/2030	USD	RANPAK HOLDINGS CORP (NYS)	3,62	(3 561)	33 371	(2 884)
13/08/2030	USD	RAPID7 INC (NMS)	3,62	(8 018)	80 619	(9 911)
13/08/2030	USD	RAPPORT THERAPEUTICS INC	3,62	(645)	31 671	(5 818)
13/08/2030	USD	RAYONIER ADVANCED MATERIALS	3,62	2 681	29 686	(398)
13/08/2030	USD	RAYONIER INC (NYS)	3,62	(15 997)	466 144	(14 255)
13/08/2030	USD	RECURSION PHARMACEUTICALS-A	3,62	(16 632)	70 510	(14 697)
13/08/2030	USD	REDDIT INC-CL A	3,62	(1 076)	258 407	(1 019)
13/08/2030	USD	REGAL REXNORD CORP	3,62	(2 979)	836 667	(154 639)
13/08/2030	USD	RENASANT CORP	3,62	(966)	56 512	(988)
13/08/2030	USD	REPLIGEN CORP (NSM)	3,62	(3 914)	713 723	(29 583)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	REPLIMUNE GROUP INC	3,62	(1 205)	14 233	(4 398)
13/08/2030	USD	RESIDEO TECHNOLOGIES INC	3,62	(494)	20 681	(700)
13/08/2030	USD	RESOLUTE HOLDINGS MANAG	3,62	(488)	81 930	(16 474)
13/08/2030	USD	REVVITY INC	3,62	(8 716)	1 231 170	(119 942)
13/08/2030	USD	REZOLUTE INC	3,62	(1 849)	9 824	(3 613)
13/08/2030	USD	RH	3,62	(6 857)	1 421 838	(151 911)
13/08/2030	USD	RIBBON COMMUNICATIONS INC	3,62	7 126	26 036	(2 903)
13/08/2030	USD	RIGEL PHARMACEUTICALS INC	3,62	(2 287)	98 582	(26 335)
13/08/2030	USD	RILEY EXPLORATION PERMIAN A	3,62	1 267	63 414	(5 440)
13/08/2030	USD	RIOT PLATFORMS INC	3,62	(907)	30 458	(4 153)
13/08/2030	USD	ROBERT HALF INC	3,62	13 821	602 122	(2 238)
13/08/2030	USD	ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,62	(12 740)	1 534 321	(245 389)
13/08/2030	USD	ROCKET COS INC - CLASSE A	3,62	(53 209)	930 501	(238 844)
13/08/2030	USD	ROCKET PHARMACEUTICALS INC	3,62	(2 067)	7 495	(2 380)
13/08/2030	USD	ROLLINS INC (NYS)	3,62	2 657	173 177	(18 715)
13/08/2030	USD	ROOT INC/OH - CLASSE A	3,62	(1 097)	82 549	(2 833)
13/08/2030	USD	ROPER TECHNOLOGIES INC (NSM)	3,62	(2 834)	1 320 415	(13 798)
13/08/2030	USD	ROSS STORES INC (NSM)	3,62	10 041	3 213 423	(230 859)
13/08/2030	USD	RPM INTERNATIONAL INC	3,62	(3 736)	543 303	(34 913)
13/08/2030	USD	RXSIGHT INC	3,62	(991)	6 357	(292)
13/08/2030	USD	RYAN SPECIALTY HOLDINGS INC	3,62	(12 791)	618 433	(54 198)
13/08/2030	USD	RYDER SYSTEM INC	3,62	3 471	1 308 141	(31 870)
13/08/2030	USD	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,62	(148)	24 493	(2 257)
13/08/2030	USD	S & T BANCORP INC	3,62	(136)	8 959	(331)
13/08/2030	USD	SABRE CORP (NSM)	3,62	(5 532)	12 729	(3 414)
13/08/2030	USD	SAFEHOLD INC	3,62	(879)	19 307	(108)
13/08/2030	USD	SANA BIOTECHNOLOGY INC	3,62	(3 372)	13 261	(3 166)
13/08/2030	USD	SAREPTA THERAPEUTICS INC (NSM)	3,62	(19 286)	421 801	(63 229)
13/08/2030	USD	SATELLOGIC INC-A	3,62	9 518	83 356	(7 794)
13/08/2030	USD	SCANSOURCE INC	3,62	(148)	10 084	(651)
13/08/2030	USD	SCHNEIDER NATIONAL INC-CL B	3,62	32 748	1 692 483	(25 618)
13/08/2030	USD	SCORPIO TANKERS INC	3,62	1 668	177 854	(16 569)
13/08/2030	USD	SCOTTS MIRACLE-GRO CO	3,62	(3 520)	291 486	(42 654)
13/08/2030	USD	SEAPORT ENTERTAINMENT GROUP	3,62	(1 760)	59 200	(6 036)
13/08/2030	USD	SELECT WATER SOLUTIONS INC	3,62	(3 651)	93 684	(7 931)
13/08/2030	USD	SEMPRA	3,62	(11 920)	1 513 195	(35 508)
13/08/2030	USD	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,62	(12 379)	812 498	(9 626)
13/08/2030	USD	SENSIENT TECHNOLOGIES CORP	3,62	(302)	50 446	(1 372)
13/08/2030	USD	SERVICE PROPERTIES TRUST	3,62	(25 401)	58 802	(927)
13/08/2030	USD	SERVICENOW INC (NYS)	3,62	17 330	2 563 211	(173 647)
13/08/2030	USD	SEZZLE INC (NAS)	3,62	(366)	61 749	(26 083)
13/08/2030	USD	SHARKNINJA INC	3,62	(5 301)	950 877	(175 125)
13/08/2030	USD	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,62	(722)	339 393	(11 513)
13/08/2030	USD	SHIFT4 PAYMENTS INC - CATÉGORIE A	3,62	(4 904)	243 669	(89 864)
13/08/2030	USD	SHOALS TECHNOLOGIES GROUP -A	3,62	(7 200)	92 877	(6 373)
13/08/2030	USD	SHORE BANCSHARES INC	3,62	(295)	9 104	(377)
13/08/2030	USD	SIGA TECHNOLOGIES INC (NMS)	3,62	5 332	32 420	(5 536)
13/08/2030	USD	SILGAN HOLDINGS INC (NYS)	3,62	(17 304)	949 811	(174 898)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	SIMMONS FIRST NATL CORP-CL A	3,62	(4 022)	123 115	(4 891)
13/08/2030	USD	SIMON PROPERTY GROUP INC (NYS)	3,62	(5 128)	1 521 930	(91 036)
13/08/2030	USD	SIMPSON MANUFACTURING CO INC (NYS)	3,62	(2 232)	579 635	(71 518)
13/08/2030	USD	SIMULATIONS PLUS INC (NSM)	3,62	(950)	21 118	(3 132)
13/08/2030	USD	SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,62	(47 488)	1 827 131	(126 445)
13/08/2030	USD	SITEONE LANDSCAPE SUPPLY INC	3,62	(1 144)	169 706	(13 184)
13/08/2030	USD	SKYWARD SPECIALTY INSURANCE	3,62	(848)	57 887	(11 140)
13/08/2030	USD	SL GREEN REALTY CORP	3,62	(2 808)	199 907	(4 812)
13/08/2030	USD	SLM CORP (NSM)	3,62	(21 371)	634 802	(142 732)
13/08/2030	USD	SM ENERGY CO (NYS)	3,62	271	12 407	(2 546)
13/08/2030	USD	SOFI TECHNOLOGIES INC	3,62	(57 724)	1 277 520	(164 820)
13/08/2030	USD	SOLARIS ENERGY INFRASTRUCTURE	3,62	(1 107)	105 347	(19 055)
13/08/2030	USD	SOLID BIOSCIENCES INC	3,62	(2 849)	26 262	(13 570)
13/08/2030	USD	SOMNIGROUP INTERNATIONAL INC	3,62	(10 129)	967 397	(139 637)
13/08/2030	USD	SONOCO PRODUCTS CO (État de New York)	3,62	(14 316)	978 055	(146 694)
13/08/2030	USD	SONOS INC	3,62	5 472	111 946	(9 174)
13/08/2030	USD	SOUTHERN CO/THE	3,62	(3 543)	464 543	(7 272)
13/08/2030	USD	SOUTHSIDE BANCSHARES INC	3,62	(352)	16 641	(600)
13/08/2030	USD	SOUTHWEST AIRLINES CO (NYS)	3,62	(18 327)	1 058 098	(261 973)
13/08/2030	USD	SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC	3,62	12 592	1 558 992	(6 392)
13/08/2030	USD	SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC (NYS)	3,62	(90)	10 191	(613)
13/08/2030	USD	SPIRE INC	3,62	764	85 512	(1 356)
13/08/2030	USD	SPROUT SOCIAL INC - CLASSE A	3,62	(969)	9 554	(635)
13/08/2030	USD	SPS COMMERCE INC	3,62	(973)	75 552	(1 860)
13/08/2030	USD	SPX TECHNOLOGIES INC	3,62	(362)	115 632	(8 059)
13/08/2030	USD	SPYRE THERAPEUTICS INC	3,62	(1 043)	109 205	(19 933)
13/08/2030	USD	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS (NSM)	3,62	14 201	1 345 372	(116 729)
13/08/2030	USD	ST JOE CO/THE (État de New York)	3,62	791	71 226	(2 235)
13/08/2030	USD	STAG INDUSTRIAL INC (NYS)	3,62	(4 797)	254 140	(2 439)
13/08/2030	USD	STANDEX INTERNATIONAL CORP (NYS)	3,62	(189)	76 625	(17 723)
13/08/2030	USD	STANLEY BLACK & DECKER INC	3,62	(3 508)	390 644	(72 646)
13/08/2030	USD	STARBUCKS CORP	3,62	(9 800)	1 349 712	(44 013)
13/08/2030	USD	STERLING INFRASTRUCTURE INC	3,62	(3)	3 547	(36)
13/08/2030	USD	STIFEL FINANCIAL CORP	3,62	14 178	1 393 130	(12 273)
13/08/2030	USD	STOCK YARDS BANCORP INC	3,62	(72)	7 456	(239)
13/08/2030	USD	STONEX GROUP INC	3,62	154	26 781	(1 438)
13/08/2030	USD	STRATEGIC EDUCATION INC	3,62	672	76 395	(4 881)
13/08/2030	USD	STRIDE INC	3,62	142	19 771	(2 790)
13/08/2030	USD	STURM RUGER & CO INC (NYS)	3,62	2 350	127 450	(3 843)
13/08/2030	USD	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC (NYS)	3,62	(9 222)	78 707	(11 430)
13/08/2030	USD	SUN COMMUNITIES INC	3,62	4 925	869 784	(42 834)
13/08/2030	USD	SUNCOKE ENERGY INC	3,62	5 308	67 435	(8 171)
13/08/2030	USD	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC (NYS)	3,62	(1 628)	25 950	(184)
13/08/2030	USD	SURGERY PARTNERS INC	3,62	(1 943)	38 476	(7 055)
13/08/2030	USD	T ROWE PRICE GROUP INC (NSM)	3,62	(5 148)	764 184	(60 342)
13/08/2030	USD	T1 ENERGY INC	3,62	(5 463)	58 890	(13 382)
13/08/2030	USD	TALOS ENERGY INC	3,62	2 409	51 669	(8 576)
13/08/2030	USD	TANGER INC	3,62	150	8 284	(52)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	TANGO THERAPEUTICS INC	3,62	(1 740)	69 593	(6 171)
13/08/2030	USD	TAYSHA GENE THERAPIES INC	3,62	(4 891)	36 832	(9 668)
13/08/2030	USD	TD SYNEX CORP	3,62	3 155	1 178 312	(6 546)
13/08/2030	USD	TE CONNECTIVITY PLC	3,62	2 949	830 731	(2 054)
13/08/2030	USD	TECHNIPFMC PLC	3,62	24 761	2 415 405	(135 022)
13/08/2030	USD	TEJON RANCH CO (État de New York)	3,62	311	8 436	(355)
13/08/2030	USD	TELADOC HEALTH INC	3,62	(4 527)	44 381	(9 179)
13/08/2030	USD	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC (NYS)	3,62	(827)	693 533	(74 979)
13/08/2030	USD	SYSTÈMES DE TÉLÉPHONIE ET DE DONNÉES (NYS)	3,62	606	33 736	(2 569)
13/08/2030	USD	TERADATA CORP (NYS)	3,62	(1 468)	67 701	(2 763)
13/08/2030	USD	TERAWULF INC (NAS)	3,62	(1 509)	48 800	(3 082)
13/08/2030	USD	TEREX CORP (NYSE)	3,62	(16 710)	1 390 478	(301 184)
13/08/2030	USD	TERRENO REALTY CORP	3,62	249	22 987	(416)
13/08/2030	USD	TETRA TECHNOLOGIES INC (NYS)	3,62	(1 214)	17 573	(1 589)
13/08/2030	USD	LE GROUPE CIGNA	3,62	1 765	728 101	(49 144)
13/08/2030	USD	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,62	(933)	627 190	(24 138)
13/08/2030	USD	THOR INDUSTRIES INC (NYS)	3,62	(7 275)	759 485	(1 252)
13/08/2030	USD	THRYV HOLDINGS INC	3,62	(5 860)	30 727	(1 415)
13/08/2030	USD	TIC SOLUTIONS INC	3,62	(6 027)	66 735	(1 099)
13/08/2030	USD	TIDEWATER INC	3,62	463	47 419	(4 604)
13/08/2030	USD	TIMKEN CO (NYS)	3,62	(3 777)	697 327	(67 319)
13/08/2030	USD	TITAN INTERNATIONAL INC	3,62	(1 651)	16 646	(1 078)
13/08/2030	USD	TITAN MACHINERY INC (NSM)	3,62	(1 012)	28 169	(1 590)
13/08/2030	USD	TJX COMPANIES INC	3,62	19 322	4 517 682	(455 732)
13/08/2030	USD	TMC THE METALS CO INC	3,62	5 047	33 995	(2 966)
13/08/2030	USD	T-MOBILE US INC	3,62	8 205	2 124 842	(205 961)
13/08/2030	USD	TOLL BROTHERS INC (NYS)	3,62	(1 254)	248 701	(40 024)
13/08/2030	USD	TRACTOR SUPPLY COMPANY (NSM)	3,62	(13 173)	575 264	(8 908)
13/08/2030	USD	TRADEWEB MARKETS INC - CLASSE A	3,62	10 722	1 510 039	(22 773)
13/08/2030	USD	TRANSCAT INC	3,62	(392)	48 128	(2 498)
13/08/2030	USD	TRANSDIGM GROUP INC	3,62	(918)	1 552 060	(151 437)
13/08/2030	USD	TRANSOCEAN LTD (NYS)	3,62	12 259	102 746	(19 747)
13/08/2030	USD	TRANSUNION	3,62	(6 971)	657 425	(44 097)
13/08/2030	USD	TRAVEL + LEISURE CO	3,62	(4 058)	413 724	(22 727)
13/08/2030	USD	TREACE MEDICAL CONCEPTS INC	3,62	4 328	25 531	(1 608)
13/08/2030	USD	TREX COMPANY INC	3,62	(11 442)	714 056	(87 159)
13/08/2030	USD	TRIMBLE INC (NSM)	3,62	(18 297)	1 291 135	(11 708)
13/08/2030	USD	TRINITY INDUSTRIES INC	3,62	(1 810)	85 164	(1 925)
13/08/2030	USD	TRIPADVISOR INC	3,62	(4 673)	75 399	(13 961)
13/08/2030	USD	TRIUMPH FINANCIAL INC	3,62	(1 169)	119 121	(5 053)
13/08/2030	USD	TRUPANION INC (NMS)	3,62	(236)	7 695	(444)
13/08/2030	USD	TRUSTCO BANK CORP NY (NSM)	3,62	(138)	10 525	(90)
13/08/2030	USD	TSS INC	3,62	(1 017)	16 806	(606)
13/08/2030	USD	TTM TECHNOLOGIES	3,62	(1 412)	338 922	(28 797)
13/08/2030	USD	TYLER TECHNOLOGIES INC (NYS)	3,62	286	120 773	(4 539)
13/08/2030	USD	U.S. PHYSICAL THERAPY INC (NYS)	3,62	(610)	53 448	(4 861)
13/08/2030	USD	UFP TECHNOLOGIES INC	3,62	(202)	65 489	(9 174)
13/08/2030	USD	UGI CORP	3,62	(7 252)	351 841	(372)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ULTA BEAUTY INC	3,62	445	292 136	(13 331)
13/08/2030	USD	UMH PROPERTIES INC	3,62	1 770	37 865	(132)
13/08/2030	USD	UNDER ARMOUR INC - CLASSE A (NYS)	3,62	(91 207)	724 999	(87 225)
13/08/2030	USD	UNIQUE NV	3,62	(1 014)	37 925	(27 520)
13/08/2030	USD	UNISYS CORP (NYS)	3,62	14 000	72 238	(1 007)
13/08/2030	USD	UNITED NATURAL FOODS INC (NYS)	3,62	90	6 350	(646)
13/08/2030	USD	UNITED PARKS & RESORTS INC	3,62	(702)	43 153	(3 525)
13/08/2030	USD	UNITED RENTALS INC	3,62	(768)	1 131 366	(80 197)
13/08/2030	USD	UNITED STATES ANTIMONY CORP	3,62	(14 953)	143 050	(8 205)
13/08/2030	USD	UNITED THERAPEUTICS CORP	3,62	424	323 323	(1 262)
13/08/2030	USD	UNITEDHEALTH GROUP INC	3,62	(2 627)	1 492 723	(35 148)
13/08/2030	USD	UNITY SOFTWARE INC	3,62	(22 483)	837 334	(57 819)
13/08/2030	USD	UNIVERSAL CORP/VA (État de New York)	3,62	682	51 672	(2 238)
13/08/2030	USD	INSTITUT TECHNIQUE UNIVERSEL	3,62	(972)	53 881	(4 021)
13/08/2030	USD	UNUM GROUP	3,62	4 997	632 453	(11 375)
13/08/2030	USD	UPSTART HOLDINGS INC	3,62	(2 707)	114 384	(19 392)
13/08/2030	USD	URANIUM ENERGY CORP	3,62	(4 068)	53 440	(6 986)
13/08/2030	USD	URBAN EDGE PROPERTIES	3,62	1 726	57 190	(1 881)
13/08/2030	USD	URBAN OUTFITTERS INC (NSM)	3,62	704	71 364	(2 044)
13/08/2030	USD	UROGEN PHARMA LTD	3,62	(1 262)	49 278	(15 597)
13/08/2030	USD	US GOLD CORP	3,62	(1 120)	22 679	(1 239)
13/08/2030	USD	USA RARE EARTH INC	3,62	(1 642)	46 553	(2 779)
13/08/2030	USD	USANA HEALTH SCIENCES INC (NYS)	3,62	(3 274)	87 526	(9 885)
13/08/2030	USD	UTZ BRANDS INC	3,62	(631)	6 239	(585)
13/08/2030	USD	V2X INC	3,62	235	28 069	(3 776)
13/08/2030	USD	VAIL RESORTS INC (NYS)	3,62	(845)	160 132	(2 569)
13/08/2030	USD	VALLEY NATIONAL BANCORP	3,62	(40 219)	794 198	(32 104)
13/08/2030	USD	VALMONT INDUSTRIES	3,62	(322)	230 201	(29 360)
13/08/2030	USD	VALVOLINE INC	3,62	(8 459)	428 449	(37 300)
13/08/2030	USD	VAREX IMAGING CORP	3,62	993	14 582	(184)
13/08/2030	USD	VAXCYTE INC	3,62	(218)	13 808	(3 888)
13/08/2030	USD	VERISIGN INC	3,62	13 982	5 550 030	(661 122)
13/08/2030	USD	VERISK ANALYTICS INC	3,62	7 617	1 945 259	(39 912)
13/08/2030	USD	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,62	1 150	74 876	(7 212)
13/08/2030	USD	VERRA MOBILITY CORP	3,62	7 182	46 873	(4 514)
13/08/2030	USD	VESTIS CORP	3,62	(4 587)	83 286	(9 532)
13/08/2030	USD	VIANTECHNOLOGY INC-A	3,62	(4 466)	72 121	(6 655)
13/08/2030	USD	VICTORIA'S SECRET & CO	3,62	(439)	45 450	(5 622)
13/08/2030	USD	VIKING THERAPEUTICS INC	3,62	(5 387)	208 470	(85 240)
13/08/2030	USD	VIRTU FINANCIAL INC - CATÉGORIE A	3,62	(16 841)	1 304 626	(97 840)
13/08/2030	USD	VISHAY PRECISION GROUP	3,62	(160)	27 277	(6 194)
13/08/2030	USD	VISTEON CORP	3,62	862	141 487	(22 609)
13/08/2030	USD	VISTRA CORP	3,62	(3 577)	691 080	(99 956)
13/08/2030	USD	VITA COCO CO INC/THE	3,62	165	18 118	(3 002)
13/08/2030	USD	VITAL FARMS INC	3,62	(5 991)	88 059	(9 044)
13/08/2030	USD	VITESSE ENERGY INC	3,62	736	18 383	(1 894)
13/08/2030	USD	VONTIER CORP	3,62	(18 328)	724 237	(15 878)
13/08/2030	USD	VORNADO REALTY TRUST (NYS)	3,62	(8 141)	434 594	(10 641)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	VOYA FINANCIAL INC (NYS)	3,62	(2 069)	257 198	(4 772)
13/08/2030	USD	VOYAGER THERAPEUTICS INC	3,62	(7 929)	36 711	(1 920)
13/08/2030	USD	VSE CORP	3,62	(251)	60 619	(19 497)
13/08/2030	USD	W&T OFFSHORE INC	3,62	27 209	162 402	(43 985)
13/08/2030	USD	WABASH NATIONAL CORP	3,62	(5 804)	66 856	(42 885)
13/08/2030	USD	WALMART INC	3,62	8 929	1 501 579	(99 155)
13/08/2030	USD	WARRIOR MET COAL INC	3,62	261	34 662	(5 305)
13/08/2030	USD	WASTE MANAGEMENT INC	3,62	2 658	827 460	(1 583)
13/08/2030	USD	WATERS CORP (NYS)	3,62	(4 666)	2 361 856	(74 419)
13/08/2030	USD	WAVE LIFE SCIENCES LTD	3,62	(1 178)	9 298	(225)
13/08/2030	USD	WEIS MARKETS INC	3,62	848	97 042	(4 787)
13/08/2030	USD	WENDY'S CO/THE	3,62	(118 086)	1 091 807	(303 017)
13/08/2030	USD	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,62	(952)	439 333	(36 645)
13/08/2030	USD	WESTERN ALLIANCE BANCORP	3,62	(5 178)	589 015	(2 763)
13/08/2030	USD	WESTERN UNION CO (NYS)	3,62	(107 441)	1 101 235	(86 349)
13/08/2030	USD	WEX INC	3,62	(4 171)	802 245	(19 626)
13/08/2030	USD	WEYERHAEUSER CO	3,62	7 147	240 799	(1 146)
13/08/2030	USD	WILLIAMS COS INC	3,62	(8 007)	806 867	(27 433)
13/08/2030	USD	WILLIAMS-SONOMA INC (NYS)	3,62	(1 855)	535 331	(67 036)
13/08/2030	USD	WILLIS LEASE FINANCE CORP	3,62	(260)	65 725	(17 329)
13/08/2030	USD	WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,62	1 016	373 924	(3 365)
13/08/2030	USD	WILLSCOT HOLDINGS CORP	3,62	(62 316)	2 300 317	(210 916)
13/08/2030	USD	WINGSTOP INC	3,62	(4 254)	863 700	(165 260)
13/08/2030	USD	WINNEBAGO INDUSTRIES	3,62	(1 084)	41 708	(6 033)
13/08/2030	USD	WORKDAY INC - CLASSE A (NSM)	3,62	2 263	433 837	(49 712)
13/08/2030	USD	WORKIVA INC	3,62	3 692	253 830	(4 870)
13/08/2030	USD	WORTHINGTON ENTERPRISES INC	3,62	97	7 777	(514)
13/08/2030	USD	WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	3,62	(9 732)	1 041 090	(106 231)
13/08/2030	USD	XCEL ENERGY INC (NSM)	3,62	(2 411)	262 593	(8 849)
13/08/2030	USD	XENCOR INC	3,62	(518)	8 546	(3 111)
13/08/2030	USD	XPEL INC	3,62	(776)	49 033	(4 590)
13/08/2030	USD	YETI HOLDINGS INC	3,62	(18 835)	1 267 877	(30 985)
13/08/2030	USD	YEXT INC	3,62	(8 619)	45 675	(10 504)
13/08/2030	USD	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,62	(4 767)	1 453 807	(298 676)
13/08/2030	USD	ZIPRECRUITER INC-A	3,62	(3 508)	17 269	(1 050)
13/08/2030	USD	ZOOM COMMUNICATIONS INC	3,62	5 370	702 787	(59 123)
13/08/2030	USD	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	3,62	(65 731)	247 496	(20 739)
13/08/2030	USD	ZUMIEZ INC (NSM)	3,62	2 172	55 733	(2 010)
13/08/2030	USD	ACLARIS THERAPEUTICS INC	3,62	(7 405)	42 339	(12 371)
13/08/2030	USD	ACNB CORP (NAS)	3,62	(161)	12 816	(702)
13/08/2030	USD	ACV AUCTIONS INC-A	3,62	(5 854)	48 492	(10 238)
13/08/2030	USD	AIRJOULE TECHNOLOGIES CORP	3,62	(9 406)	54 108	(18 720)
13/08/2030	USD	ALBEMARLE CORP	3,62	2 141	430 331	(25 740)
13/08/2030	USD	ALLIANT ENERGY CORP	3,62	(115)	11 707	(505)
13/08/2030	USD	AMES NATIONAL CORP (NAS)	3,62	519	21 829	(469)
13/08/2030	USD	AMGEN INC	3,62	(2 964)	1 395 989	(97 575)
13/08/2030	USD	AMPRIUS TECHNOLOGIES INC	3,62	1 507	34 529	(5 586)
13/08/2030	USD	ANIKA THERAPEUTICS INC	3,62	2 539	52 917	(1 287)

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	ANTERIS TECHNOLOGIES GLOBAL	3,62	(4 278)	56 676	(1 989)
13/08/2030	USD	ARCTURUS THERAPEUTICS HOLDIN	3,62	2 601	24 992	(703)
13/08/2030	USD	ATAIBECKLEY INC	3,62	(1 915)	10 095	(4 016)
13/08/2030	USD	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,62	(162)	42 154	(3 459)
13/08/2030	USD	BAKKT INC	3,62	(5 657)	60 587	(916)
13/08/2030	USD	BEACON FINANCIAL CORP	3,62	(2 831)	117 136	(2 819)
13/08/2030	USD	BECTON DICKINSON AND CO	3,62	(4 548)	937 345	(27 164)
13/08/2030	USD	BENITEC BIOPHARMA INC	3,62	(562)	8 143	(2 360)
13/08/2030	USD	BETA BIONICS INC	3,62	(2 689)	51 449	(7 291)
13/08/2030	USD	BIOAGE LABS INC	3,62	(1 235)	26 661	(15 720)
13/08/2030	USD	BKV CORPORATION	3,62	(299)	10 762	(630)
13/08/2030	USD	BRISTOW GROUP INC	3,62	455	27 157	(1 035)
13/08/2030	USD	CCC INTELLIGENT SOLUTIONS HO	3,62	(96 120)	635 724	(57 023)
13/08/2030	USD	CELCUITY INC	3,62	(175)	21 535	(4 006)
13/08/2030	USD	CELLDEX THERAPEUTICS INC	3,62	(189)	7 736	(2 084)
13/08/2030	USD	CENTERPOINT ENERGY INC	3,62	(7 859)	469 646	(12 453)
13/08/2030	USD	CHARLES RIVER LABORATORIES (NYS)	3,62	(2 470)	647 114	(135 266)
13/08/2030	USD	COLUMBUS MCKINNON CORP/NY	3,62	(2 719)	45 956	(11 463)
13/08/2030	USD	SOLUTION CLOUD CONSENSUS	3,62	(690)	32 937	(3 747)
13/08/2030	USD	ADVANTAGE SOLUTIONS INC	3,62	(652)	35 033	(4 277)
13/08/2030	USD	COREBRIDGE FINANCIAL INC	3,62	(5 513)	208 964	(11 948)
13/08/2030	USD	CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	3,62	(925)	306 597	(43 900)
13/08/2030	USD	CRESCENT ENERGY INC-A	3,62	2 165	35 355	(5 898)
13/08/2030	USD	CREXENDO INC	3,62	(1 182)	11 440	(857)
13/08/2030	USD	CYTOMX THERAPEUTICS INC	3,62	(5 808)	23 570	(6 851)
13/08/2030	USD	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A (NYS)	3,62	6 849	811 590	(57 065)
13/08/2030	USD	EXXON MOBIL CORP (NYS)	3,62	7 243	1 504 086	(127 613)
13/08/2030	USD	FARMERS NATL BANC CORP	3,62	(7 287)	147 757	(2 005)
13/08/2030	USD	FERGUSON ENTERPRISES INC	3,62	(1 538)	481 640	(28 475)
13/08/2030	USD	FIFTH THIRD BANCORP (NYS)	3,62	(14 882)	1 092 682	(83 992)
13/08/2030	USD	FIRST INTERNET BANCORP	3,62	(258)	9 207	(806)
13/08/2030	USD	FIRST TRACKS BIOTHERAPEUTICS	3,62	(257)	5 885	(1 332)
13/08/2030	USD	FIRST WATCH RESTAURANT GROUP	3,62	(1 918)	29 369	(5 110)
13/08/2030	USD	GENERAL MILLS INC (NYS)	3,62	(31 388)	1 495 989	(29 161)
13/08/2030	USD	GIBRALTAR INDUSTRIES INC	3,62	(2 064)	107 909	(21 959)
13/08/2030	USD	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,62	(351 306)	1 642 520	(209 015)
13/08/2030	USD	GRAIL INC	3,62	(259)	21 162	(3 496)
13/08/2030	USD	HARROW INC	3,62	(962)	48 162	(8 828)
13/08/2030	USD	INSTITUTION HINGHAM POUR LES SVGS	3,62	(102)	41 171	(2 471)
13/08/2030	USD	HIPPO HOLDINGS INC	3,62	(695)	24 909	(2 457)
13/08/2030	USD	HOST HOTELS & RESORTS INC	3,62	1	34	-
13/08/2030	USD	HUDSON TECHNOLOGIES INC (NAS)	3,62	(16 241)	123 436	(6 341)
13/08/2030	USD	GROUPE DES SERVICES D'INFORMATION (NMS)	3,62	2 086	12 480	(455)
13/08/2030	USD	INGLES MARKETS INC - CLASSE A	3,62	216	28 197	(1 620)
13/08/2030	USD	INGRAM MICRO HOLDING CORP	3,62	4 958	196 708	(7 756)
13/08/2030	USD	INHIBIKASE THERAPEUTICS INC	3,62	(5 796)	13 417	(3 007)
13/08/2030	USD	INOGEN INC (NSM)	3,62	4 755	43 699	(1 071)
13/08/2030	USD	IRON MOUNTAIN INC	3,62	35	6 275	(7)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	JAMES HARDIE IND PLC	3,62	(43 531)	1 336 142	(253 388)
13/08/2030	USD	JOURNEY MEDICAL CORP	3,62	(688)	5 824	(976)
13/08/2030	USD	KARMAN HOLDINGS INC	3,62	(8 541)	586 197	(13 110)
13/08/2030	USD	KEURIG DR PEPPER INC	3,62	(58 777)	2 611 135	(88 267)
13/08/2030	USD	KINGSTONE COS INC	3,62	(1 332)	29 423	(5 943)
13/08/2030	USD	LANDBRIDGE CO LLC-A	3,62	(105)	9 644	(1 994)
13/08/2030	USD	LIFECORE BIOMEDICAL INC	3,62	2 333	18 512	(1 508)
13/08/2030	USD	LILAK 9,0 % 31 décembre 2049 A - PFD	3,62	530	19 383	(3 195)
13/08/2030	USD	LIFE360 INC (NSM)	3,62	(756)	47 284	(11 142)
13/08/2030	USD	LIFEWAY FOODS INC (NMS)	3,62	(1 502)	49 915	(12 654)
13/08/2030	USD	LOANDEPOT INC - CLASSE A	3,62	(18 514)	28 401	(3 863)
13/08/2030	USD	M & T BANK CORP (NYS)	3,62	(2 210)	690 142	(46 964)
13/08/2030	USD	M-TRON INDUSTRIES INC	3,62	(413)	54 064	(2 947)
13/08/2030	USD	MAPLEBEAR INC	3,62	(7 921)	455 215	(67 688)
13/08/2030	USD	MARATHON PETROLEUM CORP (NYS)	3,62	3 610	1 327 471	(44 186)
13/08/2030	USD	MAZE THERAPEUTICS INC	3,62	(750)	24 746	(6 502)
13/08/2030	USD	MCCORMICK & CO - ACTIONS NON VOTANTES	3,62	(22 853)	1 583 499	(19 756)
13/08/2030	USD	MCEWEN INC	3,62	(255)	6 149	(286)
13/08/2030	USD	MEDTRONIC PLC	3,62	10 500	1 176 503	(23 600)
13/08/2030	USD	METALLUS INC	3,62	1 970	54 313	(3 178)
13/08/2030	USD	MISTRAS GROUP INC (NYS)	3,62	1 399	35 449	(1 495)
13/08/2030	USD	NEKTAR THERAPEUTICS	3,62	(322)	25 497	(5 876)
13/08/2030	USD	NEOGENOMICS INC (NAS)	3,62	(1 152)	18 122	(5 357)
13/08/2030	USD	NEWSMAX INC	3,62	500	6 255	(505)
13/08/2030	USD	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	3,62	(1 628)	11 511	(875)
13/08/2030	USD	NKARTA INC	3,62	(2 421)	8 305	(1 245)
13/08/2030	USD	NORTHPOINTE BANCSHARES INC	3,62	(1 003)	25 205	(1 584)
13/08/2030	USD	NORTHROP GRUMMAN CORP	3,62	671	507 304	(30 699)
13/08/2030	USD	ONCOLOGY INSTITUTE INC/THE (NAS)	3,62	(4 168)	27 202	(4 352)
13/08/2030	USD	OPEN LENDING CORP	3,62	(7 512)	22 209	(10 469)
13/08/2030	USD	OPPI INC	3,62	(579)	6 678	(1 345)
13/08/2030	USD	PACS GROUP INC	3,62	(743)	35 571	(8 653)
13/08/2030	USD	PANGAEA LOGISTICS SOLUTIONS	3,62	3 102	31 579	(3 613)
13/08/2030	USD	PENTAIR PLC	3,62	(3 375)	336 861	(23 552)
13/08/2030	USD	PHILLIPS 66	3,62	3 081	779 307	(55 786)
13/08/2030	USD	PINTEREST INC - CLASSE A	3,62	8 325	252 742	(9 439)
13/08/2030	USD	POWER SOLUTIONS INTERNATIONAL (NAS)	3,62	(592)	31 611	(418)
13/08/2030	USD	PPG INDUSTRIES INC	3,62	(256)	41 996	(1 422)
13/08/2030	USD	PRIORITY TECHNOLOGY HOLDINGS	3,62	(1 390)	11 727	(1 188)
13/08/2030	USD	PROTARA THERAPEUTIC INC	3,62	(2 202)	11 608	(93)
13/08/2030	USD	PULSE BIOSCIENCES INC	3,62	(521)	18 157	(2 020)
13/08/2030	USD	RBB BANCORP	3,62	(669)	22 857	(2 703)
13/08/2030	USD	RED RIVER BANCSHARES INC	3,62	890	115 539	(2 348)
13/08/2030	USD	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,62	(2 547)	1 011 093	(125 616)
13/08/2030	USD	S&P GLOBAL INC	3,62	119	70 758	(3 429)
13/08/2030	USD	SAILPOINT INC	3,62	(5 025)	101 165	(1 339)
13/08/2030	USD	SANDRIDGE ENERGY INC	3,62	844	18 008	(1 964)
13/08/2030	USD	SEABOARD CORP	3,62	23	165 933	(23 593)

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Annexe 2 – Contrats de swap sur actions* (suite)

Au 30 juin 2026 (non audité)

Date de règlement	Devise	Titre sous-jacent	Taux d'intérêt	Quantité	Notionnel montant	Non réalisé gain (perte)
			%		\$	\$
13/08/2030	USD	SIERRA BANCORP (NSM)	3,62	(613)	34 348	(414)
13/08/2030	USD	SILVACO GROUP INC	3,62	(1 822)	29 169	(5 888)
13/08/2030	USD	SIONNA THERAPEUTICS INC	3,62	(216)	10 251	(3 020)
13/08/2030	USD	SKYYX PLATFORMS CORP	3,62	(3 902)	5 298	(717)
13/08/2030	USD	SMITHFIELD FOODS INC	3,62	7 347	274 403	(26 932)
13/08/2030	USD	SONIDA SENIOR LIVING INC	3,62	(1 787)	89 340	(12 309)
13/08/2030	USD	STANDARD AERO INC	3,62	(11 374)	408 936	(67 219)
13/08/2030	USD	STOKE THERAPEUTICS INC (NSM)	3,62	(525)	20 851	(3 098)
13/08/2030	USD	SUNOCOCORP LLC	3,62	(2 449)	225 817	(4 800)
13/08/2030	USD	SWEETGREEN INC - CLASSE A	3,62	(7 006)	84 024	(1 858)
13/08/2030	USD	TALEN ENERGY CORP	3,62	(839)	394 136	(55 196)
13/08/2030	USD	TERRESTRIAL ENERGY INC	3,62	(2 101)	20 041	(663)
13/08/2030	USD	TEXTRON INC	3,62	(6 503)	833 772	(1 570)
13/08/2030	USD	THIRD COAST BANCSHARES INC	3,62	(527)	29 463	(156)
13/08/2030	USD	TONIX PHARMACEUTICALS HOLDIN	3,62	(756)	11 555	(1 910)
13/08/2030	USD	TREVI THERAPEUTICS INC	3,62	(2 058)	38 458	(15 198)
13/08/2030	USD	TRILOGY METALS INC	3,62	8 403	41 483	(487)
13/08/2030	USD	U-HAUL HOLDING CO – SANS DROIT DE VOTE	3,62	(488)	37 110	(2 002)
13/08/2030	USD	UIPATH INC - CLASSE A	3,62	(52 849)	794 829	(7 322)
13/08/2030	USD	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,62	(1 344)	193 538	(7 554)
13/08/2030	USD	UPSTREAM BIO INC	3,62	(1 927)	16 876	(1 705)
13/08/2030	USD	VERSANT MEDIA GROUP INC	3,62	4 476	246 497	(23 012)
13/08/2030	USD	VERTEX PHARMACEUTICALS INC (NSM)	3,62	(1 055)	641 038	(89 455)
13/08/2030	USD	WEAVE COMMUNICATIONS INC	3,62	(6 474)	50 378	(3 634)
13/08/2030	USD	WEBULL CORP	3,62	(6 042)	51 566	(3 278)
13/08/2030	USD	WESTLAKE CORP	3,62	3 137	381 124	(61 915)
13/08/2030	USD	XPERI INC	3,62	(1 536)	16 172	(1 437)
13/08/2030	USD	XPONENTIAL FITNESS INC-A	3,62	(752)	6 282	(975)
13/08/2030	USD	YORK WATER CO (NSM)	3,62	(209)	8 823	(157)
13/08/2030	USD	YUM! BRANDS INC (NYS)	3,62	(2 126)	479 451	(2 423)
Total des pertes latentes sur les swaps d'actions						(62 097 240)
Gain net non réalisé sur les swaps d'actions						6 575 901

* Tous les swaps sur actions sont réévalués chaque mois.

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)
Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Le Fonds Oak Hill AQR Delphi Long-Short Equity (le « Fonds ») est un fonds commun de placement alternatif constitué sous la forme d'une fiducie à capital variable régie par les lois de la province de l'Ontario et établie en vertu de la déclaration de fiducie principale datée du 5 janvier 2023, modifiée et mise à jour le 19 avril 2023 et le 21 mars 2025 (la « Convention de fiducie principale »). Le Fonds a commencé ses activités le 11 août 2025. L'adresse enregistrée du Fonds est la suivante : 2, rue Bloor Ouest, bureau 2900, Toronto (Ontario) M4W 3E2.

Oak Hill Asset Management Inc. (le « Gestionnaire »), société constituée en vertu du droit canadien, est le gestionnaire, le fiduciaire et le conseiller en placement du Fonds. Le Gestionnaire est chargé de la gestion et de l'administration du Fonds, y compris de la gestion et de l'orientation des placements de celui-ci. Le Gestionnaire a retenu les services d'AQR Capital Management, LLC (« AQR ») en tant que sous-conseiller en gestion de portefeuille pour le Fonds. AQR fournit des services de gestion discrétionnaire de portefeuille conformément aux directives d'investissement du Fonds et aux termes de la convention de sous-conseil en gestion de portefeuille applicable.

SS&C Fund Administration Company (l'« Administrateur ») a été désignée par le Gestionnaire comme administrateur du Fonds. The Northern Trust Company, succursale du Canada (le « Dépositaire ») a été désignée comme dépositaire du Fonds.

L'objectif d'investissement du Fonds est d'offrir aux investisseurs des rendements provenant des gains potentiels liés à ses positions longues et courtes. Le Fonds vise la plus-value du capital principalement en investissant à long terme dans des actifs à valorisation attractive, de haute qualité et à faible bêta, et à court terme dans des actifs onéreux, de faible qualité et à bêta élevé. Le Fonds tiendra également compte d'autres caractéristiques des titres lors de l'évaluation de l'attrait d'un investissement.

Le Fonds répond à la définition d'un « fonds commun de placement alternatif » énoncée dans la Norme nationale 81-102, *Fonds d'investissement* (« NI 81-102 »), car il est autorisé à recourir à des stratégies généralement interdites aux autres types de fonds communs de placement, telles que la possibilité d'investir plus de 10 % de sa valeur liquidative (« VL ») dans des titres d'un même émetteur, soit directement, soit par le biais d'instruments dérivés spécifiés ; la possibilité d'emprunter des liquidités, à hauteur de 50 % de sa VL, à des fins d'investissement ; la possibilité de vendre des titres à découvert (le niveau combiné des emprunts de liquidités et des ventes à découvert est limité à 50 % de sa VL au total) ; et la possibilité de recourir à l'effet de levier par le biais d'emprunts de liquidités, de ventes à découvert et d'instruments dérivés spécifiés.

2. PRINCIPES DE PRÉSENTATION

Les présents états financiers ont été établis conformément aux normes comptables IFRS® (« normes comptables IFRS ») telles que publiées par l'International Accounting Standards Board (« IASB »).

Les méthodes comptables appliquées dans les présents états financiers sont fondées sur les normes comptables IFRS publiées et en vigueur au 30 juin 2026. Les états financiers ont été approuvés par le Gestionnaire le 21 août 2026.

Devise fonctionnelle et de présentation

La monnaie fonctionnelle et de présentation du Fonds est le dollar canadien.

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)
Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Base d'évaluation

Les présents états financiers ont été établis selon le principe du coût historique, à l'exception des actifs financiers et des passifs financiers évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat (« FVTPL »), qui sont présentés à leur juste valeur. Le coût historique repose généralement sur la juste valeur de la contrepartie versée en échange des actifs et des passifs.

3. RÉSUMÉ DES PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES

Évaluation des placements

La juste valeur des actifs financiers et des passifs financiers négociés sur des marchés actifs est fondée sur les cours du marché. Conformément aux dispositions du Contrat-cadre de fiducie, les positions d'investissement sont évaluées sur la base du dernier cours de marché négocié afin de déterminer la valeur liquidative par part aux fins des souscriptions et des rachats. À des fins d'information financière, le Fonds utilise le dernier cours de marché négocié tant pour les actifs financiers que pour les passifs financiers lorsque ce dernier s'inscrit dans l'écart entre le cours acheteur et le cours vendeur de la journée. Lorsque le dernier cours négocié ne se situe pas dans la fourchette acheteur-vendeur, le Gestionnaire détermine, en fonction des faits et circonstances spécifiques, le point de cette fourchette qui reflète le mieux la juste valeur. Lorsque le Fonds détient des instruments dérivés dont les risques de marché se compensent, il utilise les cours moyens du marché comme base pour établir la juste valeur des positions de risque compensatoires et applique ce cours acheteur ou vendeur à la position ouverte nette, selon le cas.

La juste valeur des actifs financiers et des passifs financiers qui ne sont pas négociés sur un marché actif est déterminée à l'aide de techniques d'évaluation. Le Fonds utilise diverses méthodes et formule des hypothèses fondées sur les conditions de marché existant à chaque date d'établissement du bilan. Les techniques d'évaluation utilisées comprennent le recours à des transactions comparables récentes réalisées dans des conditions de pleine concurrence, l'analyse des flux de trésorerie actualisés, les modèles d'évaluation des options et d'autres techniques d'évaluation couramment utilisées par les acteurs du marché.

Les swaps sont évalués à l'aide de modèles de valorisation dont les données d'entrée sont pour la plupart observables à partir des données de marché, mais peuvent également inclure des données non observables.

Le Fonds peut recourir à des contrats à terme pour se couvrir contre les pertes liées aux fluctuations des taux de change. La juste valeur des contrats de change à terme est déterminée à partir des taux de change à terme cotés à la date de clôture, tels qu'ils sont obtenus auprès d'une source indépendante.

Placements et autres instruments financiers

Le Fonds comptabilise les instruments financiers à leur juste valeur lors de leur comptabilisation initiale, majorée des coûts de transaction dans le cas des instruments financiers non évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat. Les achats et ventes courants d'actifs financiers sont comptabilisés à leur date de transaction. Les placements détenus et vendus à découvert par le Fonds, ainsi que les instruments dérivés, sont évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

Conformément à la norme IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »), le Fonds classe ses placements et ses instruments dérivés à la juste valeur par le biais du compte de résultat (FVTPL) en fonction de son modèle économique de gestion de ces actifs financiers, conformément à sa stratégie d'investissement documentée. Le portefeuille de placements est géré, et sa performance est évaluée, sur la base de la juste valeur. Le portefeuille n'est ni détenu dans le but de percevoir des flux de trésorerie contractuels, ni détenu dans le but de percevoir des flux de trésorerie contractuels et de vendre des actifs financiers. Le Fonds se concentre principalement sur les informations relatives à la juste valeur et utilise ces informations pour évaluer la performance et prendre des décisions d'investissement.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Les contrats à terme sont évalués au gain ou à la perte qui résulterait de la clôture de la position à la date d'évaluation. Les swaps sur actions sont évalués sur la base de la variation nette de la juste valeur des actions ou indices de référence sous-jacents à la date d'évaluation. Les créances ou dettes liées aux contrats à terme, ainsi que celles découlant du règlement des swaps sur actions ou des montants réévalués, sont comptabilisées séparément dans les états de la situation financière. Les plus-values ou moins-values latentes sur les contrats à terme et les swaps sur actions sont comptabilisées dans la rubrique « Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des placements, y compris les instruments dérivés et les ajustements de change ». Les plus-values ou moins-values réalisées sur les contrats à terme et les swaps sur actions sont incluses dans la rubrique « Plus-value (moins-value) nette réalisée sur la cession de placements, y compris les instruments dérivés et les ajustements de change » du compte de résultat global.

Tous les autres actifs financiers et passifs financiers sont initialement comptabilisés à leur juste valeur, puis évalués au coût amorti lorsque les deux conditions suivantes sont remplies :

- (a) L'actif financier est détenu dans le cadre d'un modèle économique dont l'objectif est de détenir des actifs financiers afin de percevoir des flux de trésorerie contractuels ; et
- (b) Les modalités contractuelles de l'actif financier donnent lieu, à des dates déterminées, à des flux de trésorerie qui correspondent exclusivement au remboursement du principal et au paiement des intérêts sur le montant en cours.

Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisé, le cas échéant, au taux d'intérêt effectif du contrat. La juste valeur de ces instruments financiers est approximée par leur valeur comptable.

Les coûts de transaction, tels que les commissions de courtage, engagés par le Fonds dans le cadre de l'achat et de la vente de placements à leur juste valeur sont comptabilisés dans l'état du résultat global de la période ou de l'exercice au cours duquel ils ont été engagés.

Classification des parts du Fonds

Le Fonds comptabilise ses parts rachetables en tant que passif. La norme IAS 32, *Instruments financiers : présentation* (« IAS 32 »), exige que les parts d'une entité qui comportent une obligation contractuelle pour l'émetteur de les racheter ou de les rembourser en trésorerie ou en un autre actif financier soient classées en tant que passif financier, sauf si des critères spécifiques sont remplis. Le Gestionnaire a déterminé que les parts du Fonds répondent aux critères de l'IAS 32 pour être classées en tant que passifs, car les différentes séries de parts présentent des caractéristiques distinctes, assorties d'une obligation de remise de trésorerie dans des conditions défavorables, et les flux de trésorerie attendus sont fondés sur les variations de leur juste valeur.

Comptabilisation et décomptabilisation des actifs financiers et des passifs financiers

Le Fonds comptabilise les actifs financiers et les passifs financiers à la date de transaction, c'est-à-dire la date à laquelle il s'engage à acheter ou à vendre à découvert les instruments. À compter de cette date, les gains et pertes résultant des variations de la juste valeur des actifs ou des passifs sont comptabilisés dans l'état du résultat global.

Les actifs financiers ne sont décomptabilisés que lorsque les droits contractuels sur les flux de trésorerie liés à l'actif expirent ou lorsque le Fonds transfère l'actif financier ainsi que la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de cet actif à une autre entité. Le Fonds décomptabilise les passifs financiers lorsque ses obligations sont éteintes, annulées ou arrivent à échéance.

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Opérations d'investissement et comptabilisation des produits

Les revenus de dividendes sont comptabilisés à la date de détachement du dividende. Les dividendes déclarés sur des titres vendus à découvert sont comptabilisés en charges de dividendes à la date de détachement du dividende. Les gains et pertes réalisés sur les opérations d'investissement sont calculés sur la base du coût moyen.

Les produits d'intérêts destinés à être distribués et présentés dans l'état du résultat global correspondent aux intérêts de coupon perçus par le Fonds, comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'exercice. Le Fonds n'amortit pas les primes versées ni les décotes reçues lors de l'achat de titres à revenu fixe.

Compensation des instruments financiers

Les actifs financiers et les passifs financiers sont compensés et le montant net est présenté dans l'état de la situation financière lorsqu'il existe un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il y a l'intention de régler sur une base nette ou de réaliser les actifs et de régler le passif simultanément. Dans le cadre de ses activités courantes, le Fonds conclut divers accords-cadres de compensation ou accords similaires qui ne répondent pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent néanmoins de compenser les montants correspondants dans certaines circonstances, telles qu'une faillite ou la résiliation des contrats.

Autres actifs et passifs

La trésorerie et les équivalents de trésorerie, les créances sur les courtiers et les dividendes à recevoir sont classés comme évalués au coût amorti et sont comptabilisés à ce coût. Les dettes envers les courtiers, les intérêts à payer, les dividendes à payer, les commissions de gestion à payer, les frais administratifs à payer, les honoraires professionnels à payer, les commissions de performance à payer, ainsi que les charges à payer et autres passifs sont désignés comme des passifs financiers évalués au coût amorti. Les passifs financiers sont généralement réglés dans les trois mois suivant leur émission.

Évaluation des parts rachetables

La valeur des parts rachetables est déterminée à la date de règlement désignée à laquelle (i) se tient une séance régulière de la bourse ; (ii) le marché primaire ou la bourse sur lequel la majorité des titres détenus par le Fonds est ouvert quotidiennement à la négociation ; et (iii) ou tout autre jour convenu de temps à autre par le Gestionnaire (« Date d'évaluation »). La valeur des parts rachetables à une date d'évaluation est obtenue en divisant l'actif net d'une série spécifique de parts par le nombre total de parts en circulation de cette série à la clôture des marchés à la date d'évaluation. Les frais directement imputables à une série sont imputés à cette série, tandis que les frais communs du Fonds sont répartis entre chaque série de manière raisonnable, telle que déterminée par le Gestionnaire. Les autres revenus ainsi que les plus-values et moins-values réalisées et latentes sont répartis entre chaque série du Fonds en fonction de la part proportionnelle de cette série dans l'actif net total du Fonds.

Conversion des devises étrangères

La juste valeur des placements étrangers et des autres actifs et passifs libellés en devises étrangères est convertie en dollars canadiens aux taux de change en vigueur à 16 h, heure normale de l'Est (le «taux de clôture»), à chaque date d'évaluation. Les achats et les ventes de titres étrangers libellés en devises étrangères, ainsi que les revenus qui s'y rapportent, sont convertis en dollars canadiens aux taux de change en vigueur aux dates respectives de ces opérations.

Actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part

L'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part est calculé en divisant l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables de chaque série par le nombre de parts rachetables en circulation de cette série. L'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part et par série

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

est déterminé à la fin de la période de référence et présenté au bas de l'état de la situation financière. Se reporter également à la note 6.

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par série, par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables est calculée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables, afférente à chaque série de parts, par le nombre moyen pondéré de parts en circulation de cette série au cours de la période considérée. L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par part et par série est présentée au bas de l'état du résultat global. Se reporter également à la note 10.

Montants à payer pour les placements achetés / montants à recevoir pour les placements vendus

Les montants à recevoir au titre des placements cédés et les montants à payer au titre des placements acquis qui ont fait l'objet d'un contrat sont comptabilisés dans les états de la situation financière à leur montant de réception ou de remise.

Trésorerie et équivalents de trésorerie

La trésorerie et les équivalents de trésorerie comprennent les dépôts en espèces auprès d'établissements financiers et les équivalents de trésorerie facilement convertibles en espèces ; ils sont comptabilisés au coût, qui se rapproche de la juste valeur. Les garanties constituées sous forme de trésorerie sont classées en trésorerie soumise à restrictions dans les états de la situation financière, car elles ne sont pas à la disposition du Fonds pour un usage général tant que les positions sur dérivés correspondantes restent ouvertes. Les soldes de trésorerie soumise à restrictions rapportent des intérêts, le cas échéant, aux taux spécifiés dans les contrats de garantie. Le montant de la trésorerie soumise à restrictions requis fluctue quotidiennement en fonction de la juste valeur des positions sur dérivés du Fonds et des exigences de marge. Lors du règlement ou de la résiliation des contrats dérivés concernés, la garantie est restituée au Fonds et reclassée en trésorerie non soumise à restrictions.

Opérations sur dérivés

Le Fonds peut recourir à des contrats dérivés afin d'optimiser ses rendements et de gérer les risques liés à ses placements. Les instruments dérivés sont désignés comme détenus à des fins de transaction ; par conséquent, les contrats sont évalués à leur juste valeur à la date d'évaluation et les gains et pertes qui en résultent, qu'ils soient réalisés ou non, sont comptabilisés dans l'état du résultat global.

Distribution du résultat net et des plus-values

Le revenu net de placement (à l'exclusion des dividendes à recevoir) et les plus-values nettes réalisées du Fonds sont distribués aux porteurs de parts inscrits au Fonds à la clôture des marchés le dernier jour de l'exercice fiscal du Fonds, proportionnellement à la part de chaque porteur de parts dans le Fonds, déduction faite de tout impôt devant être retenu. Toutes les distributions sont automatiquement réinvesties dans des parts supplémentaires du Fonds, sauf si le Gestionnaire a décidé d'offrir aux porteurs de parts la possibilité d'opter pour une distribution en espèces et que le porteur de parts a demandé le versement de la distribution en espèces.

Entité d'investissement

Le Fonds a déterminé qu'il s'agit d'une entité d'investissement au sens de la norme IFRS 10, *États financiers consolidés* (« IFRS 10 »), et des modifications apportées à l'IFRS 10, car les conditions suivantes sont réunies :

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

- (a) Le Fonds a obtenu des fonds auprès d'un ou plusieurs investisseurs dans le but de leur fournir des services de gestion d'investissement ;
- (b) Le Fonds a informé ses investisseurs que son objet social consiste à investir des fonds dans le seul but d'obtenir des rendements provenant de la plus-value du capital et des revenus d'investissement ; et
- (c) Le Fonds mesure et évalue la performance de la quasi-totalité de ses placements sur la base de la juste valeur.

En tant qu'entité d'investissement, le Fonds est dispensé de l'obligation de consolidation et de l'application de la norme IFRS 3, *Regroupements d'entreprises*, pour l'évaluation de ses placements dans des entités contrôlées et sous influence notable ; il est en revanche tenu d'évaluer ces placements à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (FVTPL).

Modifications futures des méthodes comptables

Les nouvelles normes, amendements et interprétations suivants ont été publiés par l'IASB mais ne sont pas encore applicables au Fonds. Le Fonds n'a pas adopté ces textes de manière anticipée et évalue actuellement leur impact sur ses états financiers.

Entrée en vigueur au 1er janvier 2027 :

IFRS 18 – *Présentation et informations à fournir dans les états financiers*

La norme IFRS 18 remplace la norme IAS 1, « *Présentation des états financiers* », et introduit de nouvelles exigences concernant la structure, la présentation et le classement des catégories de produits et de charges. Cette norme vise à assurer une présentation plus cohérente et plus comparable des états financiers d'une entité à l'autre. La direction s'attend à des changements liés à la présentation du compte de résultat global et des notes annexes correspondantes, mais ne prévoit pas d'incidence sur l'évaluation des actifs ou des passifs.

4. ESTIMATIONS ET JUGEMENTS COMPTABLES CRITIQUES

L'établissement des états financiers exige de la direction qu'elle fasse preuve de discernement dans l'application de ses principes comptables et qu'elle formule des estimations et des hypothèses concernant l'avenir. Le jugement le plus important émis par le Fonds lors de l'établissement de ces états financiers concerne l'évaluation à la juste valeur des placements qui ne sont pas cotés sur un marché actif.

De temps à autre, le Fonds peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas négociés sur des marchés actifs, tels que des titres non cotés ou privés et certains instruments dérivés. Les méthodes d'évaluation appliquées à ces instruments sont décrites dans la note 3. Les valeurs de ces titres sont évaluées de manière indépendante par le Gestionnaire afin de s'assurer qu'elles sont raisonnables. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente aux évaluations, la juste valeur estimée de ces titres peut différer de manière significative des valeurs qui auraient été utilisées s'il avait existé un marché actif pour ces placements.

5. FRAIS

Toutes les charges du Fonds sont prises en charge par le Fonds ou pour le compte de celui-ci, y compris, sans s'y limiter : tous les honoraires et frais liés à son fonctionnement, notamment les honoraires et frais de l'agent de registre et de transfert, d'audit, de comptabilité, d'administration (à l'exception des frais de publicité et de promotion qui sont pris en charge par le Gestionnaire), de tenue des registres et les frais juridiques, les frais de fiduciaire, de garde et de conservation, tous les coûts et frais liés à l'agrément pour

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

la vente des parts (à l'exception des frais de constitution et d'organisation ainsi que des frais liés à la préparation et au dépôt du prospectus simplifié), la fourniture de rapports financiers et autres aux porteurs de parts ainsi que la convocation et la tenue des assemblées des porteurs de parts, toutes les taxes, cotisations ou autres redevances publiques prélevées à la charge du Fonds, les intérêts, tous les frais de courtage et autres frais liés à l'achat et à la vente des actifs du Fonds, ainsi que les honoraires et frais du comité d'examen indépendant. Les honoraires annuels versés à chaque membre du comité d'examen indépendant s'élèvent à 5 000 \$ et à 7 000 \$ pour le président, auxquels s'ajoutent les taxes applicables ou autres retenues. Les frais engagés par les membres du comité d'examen indépendant dans le cadre de l'exercice de leurs fonctions sont également à la charge du Fonds. Le Gestionnaire prendra en charge tous les frais liés à l'identification et à la gestion des placements du Fonds (à l'exception des frais directs tels que les intérêts sur les emprunts sur marge et les frais de courtage, qui sont à la charge du Fonds).

Les frais susmentionnés seront répartis par le Gestionnaire entre chaque série de parts du Fonds selon les principes suivants : (i) tous les frais de série seront imputés uniquement à la série de parts du Fonds pour laquelle ces frais ont été engagés, et (ii) chaque type de frais communs sera réparti entre les séries de parts du Fonds selon les modalités déterminées par le Gestionnaire, à sa seule discrétion.

6. PARTS RACHETABLES DU FONDS

Le Gestionnaire dispose d'un pouvoir discrétionnaire exclusif pour déterminer si les droits de jouissance du Fonds doivent être répartis en une ou plusieurs séries de parts, les caractéristiques qui seront attachées à chaque série de parts et si les parts d'une série donnée doivent être reclassées en parts d'une autre série, le cas échéant, de temps à autre. Le nombre de parts et de séries de parts du Fonds pouvant être émises est illimité. Au 31 décembre 2025, le Fonds a créé des parts de série A (couvertes), des parts de série A (en dollars américains), des parts de série X (fondateurs), des parts de série X (fondateurs en dollars américains), des parts de série F (couvertes), des parts de série F (en dollars américains), des parts de série I (institutionnelles) et des parts de série I (institutionnelles en dollars américains).

(a) Parts de série A :

Les parts de série A (couvertes) et les parts de série A (en dollars américains) (collectivement, les « parts de série A ») sont accessibles à tous les investisseurs. Le représentant agréé peut facturer des frais d'entrée, qui peuvent faire l'objet d'une négociation entre l'investisseur et le courtier. Les frais d'entrée sont déduits du montant investi par l'investisseur dans le Fonds. Leur taux peut atteindre 5 %.

La série A (couverte) vise à refléter le rendement du Fonds après couverture de la quasi-totalité de l'exposition au risque de change et s'adresse aux investisseurs qui souhaitent s'exposer à des placements étrangers tout en cherchant à éliminer l'impact des placements en devises étrangères par rapport au dollar canadien sur leurs placements.

(b) Parts de série X, parts de série F et parts de série I :

les parts de série X (Fondateurs) et les parts de série X (Fondateurs en USD) (collectivement, les « parts de série X »), les parts de série F (couvertes) et les parts de série F (en USD) (collectivement, les « parts de série F »), ainsi que les parts de série I (institutionnelles) et les parts de série I (institutionnelles en dollars américains) (collectivement, les « parts de série I ») sont proposées aux investisseurs inscrits à des programmes de gestion globale parrainés par des courtiers ou à des comptes à honoraires, aux investisseurs titulaires d'un compte auprès d'un courtier à escompte, ou à d'autres investisseurs, à la seule discrétion du gestionnaire.

Les parts de série X ne peuvent être acquises que jusqu'à ce que le Fonds atteigne une valeur liquidative de 25 millions de dollars (la « période d'investissement des fondateurs »). Pendant la période d'investissement des fondateurs, les parts de série X seront proposées aux investisseurs inscrits à des programmes de gestion globale parrainés par des courtiers ou à des comptes à honoraires, aux investisseurs titulaires d'un compte auprès d'un courtier à bas prix, ou à d'autres investisseurs, à la seule discrétion du gestionnaire.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Les parts de série F ne peuvent être achetées que par l'intermédiaire d'un courtier ayant conclu une entente avec le Fonds et moyennant une autorisation préalable. Au lieu de payer des frais d'acquisition et des commissions de suivi, les investisseurs peuvent verser des frais annuels ou d'autres frais directement à leur courtier. Ces frais sont négociés entre l'investisseur et le courtier. Les titres de série F sont assortis de frais de gestion inférieurs à ceux des autres séries, car le Fonds ne verse pas de commissions de suivi sur cette série de titres. Les courtiers à escompte ne fournissent ni recommandations ni conseils en matière d'investissement à leurs clients.

La série F (couverte) vise à refléter le rendement du fonds après couverture de la quasi-totalité de l'exposition au risque de change et s'adresse aux investisseurs qui souhaitent s'exposer à des placements étrangers tout en cherchant à éliminer l'impact des placements en devises étrangères par rapport au dollar canadien sur leurs placements.

Le courtier est chargé de déterminer si les investisseurs sont éligibles à l'achat et à la détention continue de parts de série F, de série X ou de série I. Si les investisseurs ne sont plus éligibles à la détention de parts de série F, de série X ou de série I, le courtier est tenu d'informer les investisseurs afin qu'ils convertissent leurs parts en parts de série A ou qu'ils les rachètent.

Les parts d'une série donnée d'un Fonds peuvent, au choix du porteur ou du gestionnaire, être reclassées en parts de toute autre série du Fonds sur la base de la valeur liquidative applicable à chacune des deux séries à la date du reclassement. Chaque part est sans valeur nominale et chaque part entière d'une série donnée donne droit à son porteur à une voix à toutes les assemblées des porteurs de parts du Fonds.

Chaque part d'une série donnée donne à son détenteur le droit de participer au prorata à l'ensemble des distributions versées à cette série et, en cas de liquidation du Fonds, de participer au prorata avec les autres détenteurs de parts de cette même série à la valeur liquidative de la série du Fonds restant après le règlement des dettes en cours du Fonds et de la série. Les parts d'une série du Fonds ne sont pas cessibles par un porteur de parts, sauf de plein droit ou avec le consentement écrit du Gestionnaire.

Les variations du nombre de parts rachetables en circulation au cours de la période close le 30 juin 2026 sont résumées comme suit :

30 juin 2026

	Parts, au début de la période	Émission de parts	Rachat de parts	Transfert entrée/sortie de unités	Parts, fin de période
Parts de série A (couvertes)	505 006	200 353	(111 693)	(13 563)	580 104
Parts de série A (en dollars américains)	21 998	2 484	(9 888)	-	14 595
Parts de série F (couvertes)	5 298 151	4 314 175	(2 700 326)	9 796	6 921 796
Parts de série F (en dollars américains)	697 864	722 684	(101 906)	-	1 318 641
Parts de série I (institutionnelles)	1 060 937	503 012	-	-	1 563 948
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)	2 198 426	-	-	-	2 198 426
Parts de la série X (Fondateurs)	16 125 319	3 941 262	(3 899 726)	3 659	16 170 514
Parts de série X (Founders US\$)	1 145 341	366 399	(344 157)	-	1 167 583

Rachat de parts

Chaque porteur de parts du Fonds a le droit, à tout moment et de temps à autre, d'exiger du Fonds le rachat de tout ou partie de ses parts à une date de rachat spécifiée (la « Date de rachat », qui correspond à toute Date d'évaluation) à la valeur liquidative par part de la série concernée. Dès le paiement au porteur

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

de parts demandant le rachat de la valeur liquidative par part de la série correspondant aux parts rachetées, le Fonds est libéré de toute obligation envers ce porteur de parts au titre des parts rachetées.

Les rachats sont autorisés quotidiennement. Le Fiduciaire est en droit, à tout moment et de temps à autre, à son entière discrétion, de racheter d'office ou de faire racheter tout ou partie des parts détenues par un tel porteur de parts, conformément aux législations en matière de sécurité, telles que déterminées de temps à autre à sa discrétion, à la valeur liquidative de la série applicable.

Distributions

Le Gestionnaire déclarera et créditera, au titre de chaque année civile, l'intégralité du revenu net du Fonds pour l'année fiscale se terminant au cours de cette année civile, ainsi qu'un montant suffisant des plus-values nettes du Fonds pour l'année fiscale se terminant au cours de cette année civile, de sorte que le Fonds n'ait aucune obligation de payer de l'impôt en vertu de la loi fiscale. Les distributions seront payables aux personnes qui sont détenteurs de parts au 31 décembre de cette année, et ce montant sera automatiquement réinvesti dans des parts supplémentaires de la même série de parts du Fonds sur laquelle le montant a été réputé avoir été déclaré. Immédiatement après ce réinvestissement, le nombre de parts de la série concernée en circulation sera automatiquement consolidé de sorte que la valeur liquidative par part de la série après le réinvestissement soit la même qu'elle l'était immédiatement avant que le montant ne soit réputé avoir été déclaré comme dû et payable par le Fonds (avant toute reclassification de parts d'une série à une autre), à moins que le gestionnaire n'ait décidé d'offrir aux porteurs de parts une option de distribution en espèces et que le porteur de parts n'ait demandé par écrit au gestionnaire le paiement de sa distribution en espèces.

Tous les porteurs de parts du Fonds participent aux distributions et chaque série du Fonds est sur un pied d'égalité avec les autres séries du Fonds en ce qui concerne le paiement de ces distributions.

Informations sur le capital

Le capital du Fonds est représenté par des parts émises et rachetables. Les porteurs de parts ont droit aux distributions, le cas échéant, ainsi qu'au paiement d'une part proportionnelle calculée sur la base de la valeur liquidative du Fonds par part rachetable au moment du rachat. Le Fonds n'impose aucune restriction ni exigence spécifique en matière de capital concernant les souscriptions et les rachats de parts. Le Fonds s'efforce d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés tout en conservant une liquidité suffisante pour faire face aux rachats.

7. SOLDES ET TRANSACTIONS AVEC DES PARTIES LIÉES

Frais de gestion

En contrepartie des services fournis par le gestionnaire, le Fonds verse à ce dernier des frais de gestion, mensuellement à terme échu. Les frais de gestion sont calculés quotidiennement, chaque jour ouvrable, sous forme de pourcentage de la valeur liquidative de chaque série de parts composant le Fonds. Les frais de gestion sont soumis aux taxes applicables, y compris la TPS/TVH. Les frais de gestion peuvent varier d'une série à l'autre et seront déduits à titre de charge du Fonds lors du calcul des bénéfices nets de celui-ci.

Les frais de gestion pour chacune des séries de parts existantes sont indiqués ci-dessous :

Série A (couverte) et série A (en dollars américains) : 1/365e de 2,15 % (2,15 % par an) de la valeur liquidative totale des parts de la série A (couverte) et de la série A (en dollars américains) au jour ouvrable précédent.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Série X (Fondateurs) et Série X (Fondateurs en dollars américains) : 1/365 de 0,90 % (0,90 % par an) de la valeur liquidative totale des parts de la Série X (Fondateurs) et de la Série X (Fondateurs en dollars américains) au jour ouvrable précédent.

Série F (couverte) et Série F (en dollars américains) : 1/365 de 1,15 % (1,15 % par an) de la valeur liquidative totale des parts de la Série F (couverte) et de la Série F (en dollars américains) au jour ouvrable précédent.

Série I (institutionnelle) et Série I (institutionnelle en dollars américains) : 1/365 de 1,00 % (1,00 % par an) de la valeur liquidative totale des parts de la Série I (institutionnelle) et de la Série I (institutionnelle en dollars américains) au jour ouvrable précédent.

Le Gestionnaire peut, à sa discrétion, accepter de facturer des frais de gestion réduits par rapport aux frais auxquels il aurait normalement droit de la part du Fonds, pour les investissements dans le Fonds effectués par des porteurs de parts qui détiennent un nombre minimum de parts au cours d'une période donnée et/ou qui répondent à d'autres critères fixés de temps à autre par le Gestionnaire. Dans ce cas, un montant égal à la différence entre les frais de gestion normalement exigibles et les frais réduits payables par le Fonds sera régulièrement distribué par le Fonds à ces porteurs de parts sous forme de « distributions au titre des frais de gestion ». Le Gestionnaire se réserve le droit, à sa discrétion, de mettre fin ou de modifier les distributions au titre des frais de gestion à tout moment. Les conséquences fiscales d'une distribution au titre des frais de gestion seront généralement supportées par le porteur de parts qui reçoit la distribution.

La commission de gestion totale pour la période close le 30 juin 2026 s'élevait à 1 610 643 \$, dont 282 637 \$ (257 347 \$ au 31 décembre 2025) restaient dus au 30 juin 2026.

Commission de performance

Le gestionnaire a droit à une commission de performance versée par le Fonds. La commission de performance pour chacune des séries d'parts existantes est indiquée ci-dessous :

Série A (couverte), série F (couverte), série X (fondateurs) et série I (institutionnelle) : un montant égal à 20 % de l'excédent du rendement total de la série de parts par rapport à l'indice de référence pondéré, composé à 50 % de l'indice MSCI World Net Total Return Hedged en CAD et à 50 % des bons du Trésor canadiens à 3 mois, ainsi qu'à son « high water mark » perpétuel (défini ci-dessous) pour chaque série de parts concernée ;

Parts de série A (en USD), de série F (en USD), de série X (fondateurs en USD) et de série I (institutionnelles en dollars américains) : un montant égal à 20 % de l'écart entre le rendement total de la série de parts et l'indice de référence mixte composé à 50 % de l'indice MSCI World Net Total Return Hedged en dollars américains et à 50 % de l'indice ICE BofA US 3-Month T-Bill, ainsi que de son « high water mark » perpétuel pour chaque série de parts concernée.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Chaque fois qu'une commission de performance est versée au Fonds, un « seuil de référence » est fixé ; celui-ci correspond à la valeur liquidative du Fonds à cette date, après déduction de l'ensemble des commissions et frais. Aucune autre commission de performance n'est versée tant que la valeur liquidative, ajustée pour tenir compte des distributions effectuées depuis la dernière fixation du « High Water Mark », ne dépasse pas la valeur de ce dernier. Ce « High Water Mark » est perpétuel et ne peut être réinitialisé. Les écarts par rapport au « High Water Mark » s'accumulent chaque jour où le Fonds ne dépasse pas ce seuil, et aucune commission de performance n'est comptabilisée tant que la série de parts du Fonds n'a pas dépassé le « High Water Mark ».

La commission de performance est calculée et comptabilisée (et devient exigible) quotidiennement, et cette commission comptabilisée est versée par le Fonds trimestriellement de manière à ce que, dans la mesure du possible, le prix unitaire quotidien reflète toute commission de performance payable à la fin de ce jour. Le Gestionnaire se réserve le droit de modifier la période pour laquelle une commission de performance peut être versée par le Fonds au Gestionnaire. Les commissions de performance sont soumises aux taxes applicables, y compris la TPS/TVH.

La commission de performance totale pour la période close le 30 juin 2026 s'élevait à 117 \$; un montant de 2 738 \$ (83 327 \$ au 31 décembre 2025) restait à payer au 30 juin 2026.

Participations en parts détenues par des parties liées

Au 30 juin 2026, les administrateurs et les principaux dirigeants du Gestionnaire détenaient 2 691 parts (contre 1 424 au 31 décembre 2025) du Fonds.

8. ÉVALUATION DE LA JUSTE VALEUR

La juste valeur d'un instrument financier correspond au montant auquel cet instrument pourrait être échangé dans le cadre d'une transaction courante entre des parties consentantes, à l'exclusion d'une vente forcée ou d'une vente de liquidation. Les instruments financiers du Fonds sont comptabilisés à leur juste valeur ou à des montants qui s'en rapprochent dans les états financiers. Le Fonds classe les évaluations à la juste valeur selon une hiérarchie qui accorde la priorité la plus élevée aux cours cotés non ajustés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques (niveau 1) et la priorité la plus faible aux données non observables (niveau 3). Les trois niveaux de la hiérarchie des justes valeurs sont les suivants :

les données de niveau 1 qui reflètent les cours cotés non ajustés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques auxquels l'entité a accès à la date d'évaluation ;

les données de niveau 2, autres que les cours cotés publiquement, qui sont directement ou indirectement observables pour l'actif ou le passif ; et

Niveau 3 : données non observables pour les actifs ou les passifs. L'activité de marché est faible, voire inexistante. La détermination de la juste valeur nécessite un jugement ou une estimation importante de la part de la direction.

Le tableau suivant illustre la classification des instruments financiers du Fonds au sein de la hiérarchie des justes valeurs :

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)
Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

30 juin 2026				
	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
<i>Actifs financiers :</i>	\$	\$	\$	\$
Obligations	124 362 751	-	-	124 362 751
Swaps sur actions	-	68 673 141	-	68 673 141
Contrats de change à terme	-	215	-	215
	124 362 751	68 673 356	-	193 036 107
<i>Passifs financiers :</i>				
Swaps sur actions	-	(62 097 240)	-	(62 097 240)
Contrats de change à terme	-	(85 682)	-	(85 682)
	-	(62 182 922)	-	(62 182 922)
Total	124 362 751	6 490 434	-	130 853 185

31 décembre 2025				
	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
<i>Actifs financiers :</i>	\$	\$	\$	\$
Obligations	120 578 182	-	-	120 578 182
Swaps sur actions	-	26 322 854	-	26 322 854
Contrats de change à terme	-	1 065	-	1 065
	120 578 182	26 323 919	-	146 902 101
<i>Passifs financiers :</i>				
Swaps sur actions	-	(20 395 366)	-	(20 395 366)
Contrats de change à terme	-	(535 819)	-	(535 819)
	-	(20 931 185)	-	(20 931 185)
Total	120 578 182	5 392 734	-	125 970 916

Toutes les évaluations de la juste valeur ci-dessus sont récurrentes. Les valeurs comptables de la trésorerie et des équivalents de trésorerie, des créances sur les courtiers, des dividendes à recevoir, des dettes envers les courtiers, des intérêts à payer, des dividendes à payer, des honoraires de gestion à payer, des frais administratifs à payer, des honoraires professionnels à payer, des commissions de performance à payer, des charges à payer et des autres passifs se rapprochent de leur juste valeur en raison de leur nature à court terme.

Les justes valeurs sont classées au niveau 1 lorsque le titre fait l'objet d'un marché actif et qu'un cours est disponible. Si un instrument classé au niveau 1 cesse par la suite de faire l'objet d'un marché actif, il est retiré du niveau 1. Dans ce cas, les instruments sont reclassés au niveau 2, à moins que l'évaluation de leur juste valeur ne nécessite l'utilisation d'entrées non observables significatives, auquel cas ils sont classés au niveau 3.

Aucun transfert n'a été effectué au sein des différents niveaux de la hiérarchie des justes valeurs au cours de la période close le 30 juin 2026 et de la période allant du 11 août 2025 (début des activités) au 31 décembre 2025.

9. GESTION DES RISQUES FINANCIERS

La valeur des placements du portefeuille du Fonds peut fluctuer quotidiennement en raison des variations des taux d'intérêt, de la conjoncture économique et des conditions de marché, ainsi que des actualités relatives aux sociétés dont le Fonds détient des titres spécifiques. Le Gestionnaire est chargé de la sélection des titres dans le respect des lignes directrices de la politique d'investissement. Le Gestionnaire cherche à optimiser les rendements en procédant de manière opportuniste à la sélection de titres individuels, à une rotation sectorielle stratégique et à des opérations tactiques ou motivées par des opportunités. Le Gestionnaire sélectionne des titres individuels qui, selon lui, offrent une opportunité de rendements absolus positifs et réguliers, sur la base de leurs perspectives de croissance et de leur valorisation actuelle sur le marché.

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Le Gestionnaire cherche à minimiser les effets négatifs potentiels de ces risques sur la performance du Fonds en faisant appel à des conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés et en surveillant quotidiennement les positions du Fonds ainsi que les événements de marché ; il peut également recourir à des instruments dérivés pour couvrir certaines expositions au risque. Afin de faciliter la gestion des risques, le Gestionnaire met en œuvre une structure de gouvernance qui supervise les activités d'investissement du Fonds et veille au respect des stratégies d'investissement déclarées du Fonds, des directives internes et de la réglementation sur les valeurs mobilières.

Les activités d'investissement du Fonds l'exposent à divers risques financiers : le risque de marché (y compris le risque de variation de cours, le risque de taux d'intérêt et le risque de change), le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque lié à l'effet de levier. Ces risques et les pratiques de gestion des risques associées mises en œuvre par le Fonds sont présentés ci-dessous :

(i) Autres risques de prix

Le risque lié aux autres fluctuations de prix correspond au risque que la valeur de marché ou les flux de trésorerie futurs des instruments financiers fluctuent en raison de variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change).

Les placements du Fonds sont soumis aux fluctuations normales du marché et aux risques inhérents à l'investissement sur les marchés financiers. Le Gestionnaire vise à atténuer ce risque par une sélection rigoureuse et une diversification des titres et autres instruments financiers, conformément à l'objectif et à la stratégie d'investissement du Fonds. À l'exception des titres vendus à découvert, le risque maximal résultant des instruments financiers est déterminé par la juste valeur de ces derniers. Les pertes éventuelles liées aux titres vendus à découvert peuvent être illimitées. Les positions globales du Fonds sur le marché sont surveillées régulièrement par le Gestionnaire. Les instruments financiers détenus par le Fonds sont exposés à d'autres risques de cours découlant des incertitudes quant à leur évolution future. Le Fonds investit une certaine partie de ses actifs dans des positions courtes, conformément à sa stratégie d'investissement.

Le Fonds est exposé à d'autres risques de cours liés à ses investissements en titres de participation et en instruments dérivés associés. Au 30 juin 2026, si les cours de ces placements sur les places boursières respectives avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables restant constantes, l'actif net du Fonds aurait augmenté ou diminué de 657 590 \$ (contre 592 749 \$ au 31 décembre 2025).

(ii) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt découle de la possibilité que des variations des taux d'intérêt affectent les flux de trésorerie futurs ou les justes valeurs des instruments financiers. Le risque de taux d'intérêt survient lorsque le Fonds investit dans des instruments financiers portant intérêt. Le Fonds peut être exposé à un certain risque de taux d'intérêt par le biais de ses positions en bons du Trésor américain (« T-bills »). Bien que les T-bills aient des échéances courtes, leur juste valeur diminue lorsque les taux d'intérêt du marché augmentent, en particulier pour les positions vendues avant l'échéance. Le Gestionnaire surveille la durée moyenne pondérée jusqu'à l'échéance et la durée effective des positions en T-bills du Fonds et peut ajuster le profil d'échéance du portefeuille en fonction de l'évolution des perspectives de taux d'intérêt. La liquidité du marché des T-bills permet également au Fonds de rééquilibrer rapidement ses expositions si nécessaire.

(iii) Risque de change

Le risque de change est le risque que la valeur d'un instrument financier fluctue en raison des variations des taux de change. L'annexe relative aux placements recense tous les placements libellés en devises étrangères. Les actions et les instruments dérivés sur les marchés étrangers sont exposés

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

au risque de change, car les prix libellés en devises étrangères sont convertis dans la monnaie fonctionnelle du Fonds lors de la détermination de leur juste valeur.

Le risque de change découle des instruments financiers libellés dans une devise autre que le dollar canadien, qui constitue la devise fonctionnelle du Fonds. Le Fonds peut conclure des contrats de change à terme à des fins de couverture afin de réduire son exposition aux devises étrangères ou de s'exposer à celles-ci.

Le risque de change lié au Fonds au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025 est présenté ci-dessous :

Créances	Exposition au risque de change			En % de l'actif net attribuable aux détenteurs de rachetables unités	Impact sur actifs nets attribuable aux détenteurs de rachetables unités	Impact en % du net actifs attribuable aux détenteurs de rachetables unités
	Trésorerie et trésorerie équivalents	Placements à la juste valeur par le compte de résultat	Actions Swaps			
	\$	\$	\$	%	\$	%
Dollar australien	813 510	-	(229 933)	0,2	29 179	-
Couronne danoise	17 487	-	97 283	-	5 739	-
Euro européen	115 511	-	1 550 906	0,5	83 321	-
Dollar de Hong Kong	45 976	-	53 135	-	4 956	-
Yen japonais	3 138 009	-	749 716	1,2	194 386	0,1
Couronne norvégienne	(3 332)	-	(278 186)	(0,1)	(14 076)	-
Dollar de Singapour	77 038	-	147 223	0,1	11 213	-
Couronne suédoise	510 626	-	(176 033)	0,1	16 730	-
Franc suisse	872'080	-	(500 278)	0,1	18'590	-
Livre sterling	(80 868)	-	772 525	0,2	34 583	-
Dollar américain	189 558 327	124 362 751	4 511 415	97,7	15 921 625	4,9
Lari géorgien	(1 306)	-	-	-	(65)	-
Total	195 063 058	124 362 751	6 697 773	100,0	16 306 181	5,0

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

Créances	Exposition au risque de change			En % du	Impact sur	Impact en
	Trésorerie et	Placements à la juste valeur par le compte de résultat	Actions Swaps	actifs	actifs nets	% du montant
	trésorerie			attribuable	attribuable	net
	équivalents			aux	aux	actifs
	et autres			détenteurs de	détenteurs de	détenteurs de
	créances			rachetables	rachetables	rachetables
				unités	unités	unités
	\$	\$	\$	%	\$	%
Dollar australien	52 504	-	552 278	0,2	30 239	-
Couronne danoise	(29 048)	-	160 741	-	6 585	-
Euro européen	(384 776)	-	650 852	0,1	13 304	-
Dollar de Hong Kong	172 318	-	25 376	0,1	9 885	-
Yen japonais	2 052 747	-	268 804	0,8	116 078	0,1
Couronne norvégienne	319 509	-	55 008	0,1	18 726	-
Dollar singapourien	71 818	-	24 554	-	4 819	-
Couronne suédoise	10 415	-	199 871	0,1	10 514	-
Franc suisse	(16'091)	-	(27 174)	-	(2 163)	-
Livre sterling	76 651	-	279 438	0,1	17 804	-
Dollar américain	168 590 271	120 578 182	4 161 025	98,4	14 666 474	4,9
Total	170 916 318	120 578 182	6 350 773	99,9	14 892 265	5,0

(iv) Risque de crédit

Le risque de crédit correspond à la perte potentielle que le Fonds subirait si ses contreparties ne respectaient pas les termes de leurs obligations envers lui. Le Fonds conserve l'intégralité de sa trésorerie et de ses équivalents de trésorerie auprès de son dépositaire. Toutes les transactions sur titres cotés sont réglées/payées à la livraison par l'intermédiaire de courtiers agréés. Le risque de défaillance de la contrepartie est considéré comme minime, car la livraison des titres vendus n'intervient qu'une fois que le courtier a reçu le paiement. Le paiement d'un achat est effectué une fois que les titres ont été reçus par le dépositaire. La transaction échouera si l'une des parties ne respecte pas ses obligations.

Le tableau suivant présente un récapitulatif des titres de créance du Fonds par notation de crédit, hors trésorerie et équivalents de trésorerie, aux 30 juin 2026 et 31 décembre 2025.

Notation de crédit	% du total des titres de créance	% de la valeur liquidative
AA+	100,00 %	38,14 %
Total	100,00 %	38,14 %

Notation de crédit	% du total des titres de créance	% de la valeur liquidative
AA+	100,00 %	40,44 %
Total	100,00 %	40,44 %

FONDS D'ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

(v) Risque de liquidité

L'exposition du Fonds au risque de liquidité se concentre sur les rachats périodiques en espèces de parts rachetables. Le Fonds investit principalement dans des titres négociés sur des marchés actifs et pouvant être cédés facilement. Le risque de liquidité est géré en investissant la majorité des actifs du Fonds dans des placements négociés sur un marché actif. En outre, le Fonds vise à conserver des positions suffisantes en trésorerie et équivalents de trésorerie afin de maintenir sa liquidité.

Tous les passifs financiers sont exigibles dans un délai de douze mois. Les parts rachetables sont rachetables à vue quotidiennement, au choix du détenteur. Les placements du Fonds sont considérés comme facilement réalisables et liquides ; par conséquent, le risque de liquidité du Fonds est jugé minime. Le Fonds peut recourir à des instruments dérivés pour atténuer certaines expositions au risque. Il n'existe aucune garantie qu'un marché existera pour certains instruments dérivés et il est possible que les bourses imposent des limites à la négociation de ces instruments.

(vi) Risque lié à l'effet de levier

Lorsque le Fonds effectue des placements dans des instruments dérivés, emprunte des liquidités à des fins d'investissement ou recourt à des ventes à découvert physiques sur des actifs de son portefeuille, un effet de levier peut être introduit au sein du Fonds. Il y a effet de levier lorsque l'exposition brute totale du Fonds aux actifs sous-jacents est supérieure au montant investi. L'effet de levier peut accroître la volatilité, nuire à la liquidité du Fonds et contraindre ce dernier à liquider des positions à des moments défavorables.

Conformément à la norme NI 81-102, l'exposition brute totale du Fonds, calculée comme la somme des éléments suivants, ne doit pas dépasser trois fois la valeur liquidative du Fonds : (i) le montant des liquidités empruntées à des fins d'investissement ; (ii) la valeur de marché totale des ventes à découvert physiques sur des actions, des titres à revenu fixe ou d'autres actifs du portefeuille ; et (iii) la valeur notionnelle totale des positions sur dérivés spécifiés du Fonds, à l'exclusion de tout instrument dérivé spécifié utilisé à des fins de couverture.

Le Fonds a obtenu une dérogation lui permettant d'utiliser une valeur à risque (VaR) ne dépassant pas deux fois la VaR de l'indice de référence du Fonds, plutôt que de se conformer aux exigences de la norme NI 81-102 en matière d'exposition brute totale. L'indice de référence du Fonds est l'indice MSCI World Net Total Return Hedged en USD.

Au 30 juin 2026 et au 31 décembre 2025, la VaR quotidienne du Fonds n'a jamais dépassé la limite correspondant à deux fois la VaR de l'indice de référence du Fonds.

FONDS D' ACTIONS LONG-SHORT OAK HILL AQR DELPHI

Notes annexes aux états financiers (suite)

Pour le semestre clos le 30 juin 2026 (non audité)

10. AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX DÉTENTEURS DE PARTS RACHETABLES PAR SÉRIE, PAR PART

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux détenteurs de parts rachetables par série et par part pour la période close le 30 juin 2026 est calculée comme suit :

Série	Augmentation (diminution) par série	Moyenne pondérée parts en circulation	Augmentation (diminution) par part
	\$		\$
Parts de série A (couvertes)	(181 365)	593 560	(0,31)
Parts de série A (en dollars américains)	(2 401)	18 383	(0,13)
Parts de série F (couvertes)	(1 891 669)	7 144 700	(0,26)
Parts de série F (en dollars américains)	809 762	945 650	0,86
Parts de la série I (institutionnelles)	(246 344)	1 397 066	(0,18)
Parts de série I (institutionnelles en dollars américains)	568 465	2 198 426	0,26
Parts de la série X (Fondateurs)	(4 464 429)	16 865 889	(0,26)
Parts de série X (Fondateurs en dollars américains)	248 181	1 222 605	0,20

11. IMPÔTS SUR LE REVENU

Le Fonds est admissible à titre de fiducie de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada) et, par conséquent, est assujéti à l'impôt sur son revenu, y compris les plus-values nettes réalisées au cours de l'année d'imposition, qui n'est ni versé ni payable à ses porteurs de parts à la fin de l'année d'imposition. Le Fonds a pour intention de distribuer la totalité de son revenu net et une partie suffisante de ses plus-values nettes réalisées afin de ne pas être assujéti à l'impôt sur le revenu, à l'exception des retenues à la source étrangères, le cas échéant.

Les pertes du Fonds ne peuvent être imputées aux porteurs de parts et sont conservées dans le Fonds pour les années à venir. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées sur un maximum de vingt ans afin de réduire le revenu imposable et les plus-values réalisées au cours des années suivantes. Les pertes en capital peuvent être reportées indéfiniment afin de réduire les plus-values réalisées futures.

Au 30 juin 2026, le Fonds disposait de zéro dollar (31 décembre 2025 : zéro dollar) de pertes en capital non utilisées et de 2 137 546 dollars (31 décembre 2025 : 2 137 546 dollars) de pertes autres qu'en capital non utilisées.