



États financiers semestriels
30 juin 2019

Table des matières

Responsabilité de la direction à l'égard de l'information financière	1
États financiers	
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	2
Fonds d'obligations à court terme Genus	6
Fonds d'actions à dividendes Genus.....	10
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	14
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus.....	18
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus.....	22
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus	26
Notes des états financiers	30

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

Les états financiers semestriels ci-joints ont été préparés par Genus Capital Management Inc. (« Genus »), le gestionnaire des Fonds, et approuvés par son conseil d'administration. La direction de Genus est responsable de l'information et des déclarations figurant dans les présents états financiers et dans les autres sections des états financiers.

Genus a recours à des procédés appropriés pour s'assurer de présenter des informations financières fiables et pertinentes. Les états financiers ont été dressés conformément aux Normes internationales d'information financière et comprennent certains montants fondés sur des estimations et des jugements. Les principales méthodes comptables jugées comme étant appropriées pour les Fonds par la direction sont énoncées à la note 2 des états financiers. L'information financière utilisée ailleurs dans le présent rapport annuel est cohérente avec les états financiers consolidés.

Les états financiers semestriels ci-joints n'ont pas fait l'objet d'un examen par l'auditeur externe des Fonds. L'auditeur externe effectuera l'audit des états financiers annuels des Fonds conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada.



Wayne W. Wachell
Chef de la direction
Genus Capital Management Inc.



Leslie G. Cliff
Présidente du conseil d'administration
Genus Capital Management Inc.

Fonds d'obligations gouvernementales Genus

États de la situation financière

	30 juin 2019	31 décembre 2018
Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité)		
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	466,152 \$	728,716 \$
Placements à court terme	8,080,481	-
Placements	133,068,282	58,841,263
Intérêts courus	454,813	218,628
Total de l'actif	142,069,728	59,788,607
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	21,131	30,842
Distributions payable to unitholders	3,548	-
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	24,679	30,842
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	142,045,049 \$	59,757,765 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	1,202,840	524,793
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	118.09 \$	113.87 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)		
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	1,418,105 \$	569,664 \$
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(32)	26
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	729,331	(200,475)
Perte nette réalisée sur les contrats de change à terme	-	(946)
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements et les contrats de change à terme	3,259,060	(46,731)
Total du revenu	5,406,464	321,538
Charges		
Honoraires des fiduciaires	3,350	2,999
Frais juridiques	-	853
Honoraires d'audit	1,176	-
Frais du comité d'examen indépendant	2,105	1,429
Droits de garde	2,067	2,118
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	25,790	21,543
Autres frais administratifs	28,760	30,128
Charges d'intérêts	-	37
Total des charges d'exploitation	63,248	59,107
Résultat d'exploitation	5,343,216	262,431
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	5,343,216 \$	262,431 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	992,015	389,321
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par part (série O)	5.39 \$	0.67 \$

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

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	59,757,765 \$	49,111,903 \$
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	5,343,216	262,431
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(1,297,844)	(514,485)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1,297,844)	(514,485)
Transactions sur parts rachetables		
Emission de parts rachetables	83,264,951	6,701,719
Réinvestissement des parts rachetables	787,931	362,057
Rachat de parts rachetables	(5,810,970)	(7,741,432)
Augmentation (diminution) nette découlant des transactions sur parts rachetables	78,241,912	(677,656)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	82,287,284	(929,710)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	142,045,049 \$	48,182,193 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations gouvernementales Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	67,544,321 \$	64,339,002 \$
Produit à la vente/à l'échéance des billets à court terme	6,316,629	-
Achat de placements	(137,782,948)	(63,221,081)
Achat de billets à court terme	(14,384,311)	-
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme et de l'amortissement des obligations	1,169,120	571,153
Intérêts versés	-	(37)
Charges d'exploitation payées	(72,959)	(57,999)
Paievements nets reçus des règlements de dérivés	-	(946)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(77,210,148)	1,630,092
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(506,365)	(152,428)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	83,264,951	6,701,719
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(5,810,970)	(7,767,784)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	76,947,616	(1,218,493)
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(32)	26
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(262,564)	411,625
Trésorerie au début de la période	728,716 \$	179,017 \$
Trésorerie à la fin de la période	466,152 \$	590,642 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations gouvernementales Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Titres à revenu fixe canadiens						
Obligations fédérales						
4,195,000	Fiducie du Canada pour l'habitation No 1	1.200 %	06-15-2020	4,171,226	4,174,120	3.0
9,400,000	Fiducie du Canada pour l'habitation No 1	1.450 %	06-15-2020	9,370,296	9,375,032	6.6
3,805,000	Fiducie du Canada pour l'habitation No 1	2.350 %	09-15-2023	3,883,764	3,909,998	2.8
200,000	Exportation et développement Canada	1.800 %	09-01-2022	199,724	201,109	0.1
25,240,000	Gouvernement du Canada	1.250 %	02-01-2020	25,136,570	25,171,967	17.8
5,730,000	Gouvernement du Canada	1.750 %	05-01-2020	5,715,388	5,732,106	4.1
830,000	Gouvernement du Canada	2.750 %	12-01-2048	1,016,778	1,034,661	0.7
				49,493,746	49,598,993	35.1
Obligations provinciales						
2,690,000	Province d'Alberta	2.900 %	12-01-2028	2,703,826	2,854,265	2.0
995,000	Province d'Alberta	3.900 %	12-01-2033	1,082,769	1,175,291	0.8
1,730,000	Province d'Alberta	3.100 %	06-01-2050	1,729,327	1,943,576	1.4
1,100,000	Province de Colombie-Britannique	5.700 %	06-18-2029	1,391,976	1,450,783	1.0
1,475,000	Province de Colombie-Britannique	6.350 %	06-18-2031	2,022,435	2,120,111	1.5
1,050,000	Province du Manitoba	3.250 %	09-05-2029	1,092,371	1,143,026	0.8
865,000	Province du Manitoba	3.200 %	03-05-2050	858,645	975,759	0.7
10,650,000	Province d'Ontario	4.200 %	06-02-2020	10,961,365	10,885,529	7.6
6,045,000	Province d'Ontario	3.150 %	06-02-2022	6,269,786	6,293,291	4.5
335,000	Province d'Ontario	1.950 %	01-27-2023	333,898	337,482	0.2
3,605,000	Province d'Ontario	2.850 %	06-02-2023	3,695,961	3,752,994	2.7
4,470,000	Province d'Ontario	3.500 %	06-02-2024	4,750,825	4,818,630	3.4
1,305,000	Province d'Ontario	2.650 %	02-05-2025	1,311,335	1,358,505	1.0
3,920,000	Province d'Ontario	2.600 %	06-02-2025	3,987,316	4,069,016	2.9
165,000	Province d'Ontario	2.750 %	09-01-2025	167,483	173,010	0.1
6,640,000	Province d'Ontario	2.600 %	06-02-2027	6,574,846	6,896,518	4.9
1,400,000	Province d'Ontario	2.900 %	06-02-2028	1,416,872	1,488,002	1.1
2,350,000	Province d'Ontario	2.700 %	06-02-2029	2,390,456	2,464,507	1.7
1,130,000	Province d'Ontario	5.850 %	03-08-2033	1,511,854	1,593,179	1.1
380,000	Province d'Ontario	4.650 %	06-02-2041	473,270	517,818	0.4
2,150,000	Province d'Ontario	2.900 %	06-02-2049	2,105,200	2,338,567	1.7
1,495,000	Province d'Ontario	2.650 %	12-02-2050	1,501,077	1,551,804	1.1
305,000	Province de Québec	2.450 %	03-01-2023	304,558	312,858	0.2
780,000	Province de Québec	2.250 %	02-22-2024	779,891	796,161	0.6
285,000	Province de Québec	2.600 %	07-06-2025	284,384	296,783	0.2
1,900,000	Province de Québec	2.300 %	09-01-2029	1,895,611	1,931,731	1.4
2,715,000	Province de Québec	6.250 %	06-01-2032	3,735,319	3,917,932	2.8
735,000	Province de Québec	5.750 %	12-01-2036	981,576	1,084,127	0.8
1,080,000	Province de Québec	5.000 %	12-01-2041	1,397,775	1,550,276	1.1
140,000	Province de Québec	3.500 %	12-01-2045	157,860	167,906	0.1
1,170,000	Province de Québec	3.500 %	12-01-2048	1,262,766	1,424,594	1.0
750,000	Province de Québec	3.100 %	12-01-2051	760,580	860,673	0.6
845,000	Province de Saskatchewan	3.050 %	12-02-2028	861,651	907,439	0.6
495,000	Province de Saskatchewan	3.300 %	06-02-2048	503,436	572,083	0.4
575,000	Province de Saskatchewan	3.100 %	06-02-2050	613,054	646,207	0.5
535,000	South Coast British Columbia Transportation Authority	3.250 %	11-23-2028	534,230	577,161	0.4
				72,405,584	75,247,594	53.3
Obligations municipales						
500,000	Ville de Montréal	3.500 %	09-01-2024	513,121	536,001	0.4
650,000	Ville de Montréal	3.000 %	09-01-2025	654,069	682,710	0.5
335,000	Ville de Toronto	2.400 %	06-24-2026	334,705	339,793	0.2
245,000	Ville de Toronto	3.200 %	08-01-2048	244,390	266,621	0.2
590,000	Municipal Finance Authority of British Columbia	3.050 %	10-23-2028	588,260	630,892	0.4
				2,334,545	2,456,017	1.7

Fonds d'obligations gouvernementales Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Obligations de sociétés						
235,000	Hydro-Québec	5.000 %	02-15-2050	315,647	362,291	0.3
455,000	OPB Finance Trust	1.880 %	02-24-2022	448,953	455,677	0.3
265,000	OPB Finance Trust	3.890 %	07-04-2042	257,102	316,975	0.2
				1,021,702	1,134,943	0.8
Titres adossés à des créances hypothécaires						
2,105,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.386 %	09-01-2020	1,376,342	1,385,606	1.0
1,980,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.400 %	05-01-2021	1,399,095	1,387,776	1.0
450,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.450 %	12-01-2021	344,910	345,852	0.2
300,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.840 %	10-01-2022	269,891	272,767	0.2
260,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.840 %	12-01-2022	232,507	234,440	0.2
1,010,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	2.050 %	01-01-2024	995,872	1,004,294	0.7
				4,618,617	4,630,735	3.3
Total des titres à revenu fixe canadiens				129,874,194	133,068,282	94.2
Total des titres à revenu fixe				129,874,194	133,068,282	94.2
Titres à court terme – Canada						
Bons du Trésor						
500,000	Province d'Alberta	1.758 %	08-06-2019	497,985	497,985	0.4
1,000,000	Province d'Alberta	1.750 %	09-17-2019	995,750	995,750	0.7
500,000	Province de Terre-Neuve et Labrador	1.772 %	07-25-2019	497,825	497,825	0.4
260,000	Province d'Ontario	1.761 %	07-24-2019	258,976	258,976	0.2
1,330,000	Province d'Ontario	1.755 %	08-07-2019	1,324,284	1,324,284	0.9
1,450,000	Province d'Ontario	1.752 %	08-28-2019	1,443,872	1,443,872	1.0
450,000	Province d'Ontario	1.742 %	09-11-2019	448,182	448,182	0.3
2,625,000	Province d'Ontario	1.748 %	09-25-2019	2,613,607	2,613,607	1.9
				8,080,481	8,080,481	5.8
Total des placements				137,954,675	141,148,763	100.0

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations à court terme Genus

États de la situation financière

Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité)	30 juin 2019	31 décembre 2018
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	624,966 \$	116,456 \$
Placements à court terme	119,519	249,046
Placements	29,517,734	53,202,858
Intérêts courus	179,384	304,743
Montants à recevoir des courtiers	184,505	1,155,000
Total de l'actif	30,626,108	55,028,103
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	23,728	28,035
Montants à payer aux courtiers	180,000	-
Distributions à payer aux porteurs de parts	8	-
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	203,736	28,035
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	30,422,372 \$	55,000,068 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	369,921	680,223
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	82.24 \$	80.86 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	518,266 \$	657,131 \$
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(32)	32
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	158,576	(301,855)
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements	593,729	(118,635)
Total du revenu	1,270,539	236,673
Charges		
Honoraires des fiduciaires	2,999	2,980
Frais juridiques	-	848
Honoraires d'audit	1,475	-
Frais du comité d'examen indépendant	1,939	1,413
Droits de garde	2,077	2,118
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	13,553	13,866
Autres frais administratifs	19,520	26,188
Charges d'intérêts	382	-
Total des charges d'exploitation	41,945	47,413
Résultat d'exploitation	1,228,594	189,260
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	1,228,594 \$	189,260 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	438,765	549,919
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par part (série O)	2.80 \$	0.34 \$

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

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	55,000,068 \$	45,059,009 \$
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	1,228,594	189,260
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(509,148)	(603,235)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(509,148)	(603,235)
Transactions sur parts rachetables		
Émission de parts rachetables	6,369,691	16,729,179
Réinvestissement des parts rachetables	289,617	306,134
Rachat de parts rachetables	(31,956,450)	(7,901,788)
Augmentation (diminution) nette découlant des transactions sur parts rachetables	(25,297,142)	9,133,525
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(24,577,696)	8,719,550
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	30,422,372 \$	53,778,559 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations à court terme Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	34,921,060 \$	18,047,361 \$
Produit à la vente / à l'échéance des billets à court terme	2,552,355	3,207,849
Achat de placements	(9,333,137)	(26,074,239)
Achat de billets à court terme	(2,421,290)	(4,139,300)
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	642,088	596,407
Intérêts versés	(382)	-
Charges d'exploitation payées	(45,870)	(47,118)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	26,314,824	(8,409,040)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(219,523)	(296,988)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	6,369,691	16,730,152
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(31,956,450)	(7,901,788)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(25,806,282)	8,531,376
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(32)	32
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	508,510	122,368
Trésorerie au début de la période	116,456 \$	187,577 \$
Trésorerie à la fin de la période	624,966 \$	309,945 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations à court terme Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Titres à revenu fixe canadiens						
Obligations fédérales						
650,000	Fiducie du Canada pour l'habitation No 1	2.650 %	03-15-2022	666,478	667,421	2.3
470,000	Fiducie du Canada pour l'habitation No 1	2.550 %	12-15-2023	483,990	487,604	1.6
505,000	Municipal Finance Authority of British Columbia	2.150 %	06-03-2024	504,237	511,284	1.7
				1,654,705	1,666,309	5.6
Obligations provinciales						
905,000	Province d'Ontario	4.200 %	06-02-2020	926,177	925,014	3.1
1,600,000	Province d'Ontario	4.000 %	06-02-2021	1,676,926	1,670,046	5.6
575,000	Province d'Ontario	3.150 %	06-02-2022	583,485	598,617	2.0
600,000	Province d'Ontario	2.850 %	06-02-2023	620,850	624,631	2.1
600,000	Province d'Ontario	3.500 %	06-02-2024	625,121	646,796	2.2
615,000	Province d'Ontario	2.650 %	02-05-2025	612,795	640,215	2.2
980,000	Province de Québec	3.500 %	12-01-2022	1,033,065	1,037,533	3.5
1,205,000	Province de Québec	3.000 %	09-01-2023	1,213,627	1,264,721	4.3
280,000	Province de Québec	2.250 %	02-22-2024	279,961	285,801	1.0
				7,572,007	7,693,374	26.0
Obligations de sociétés						
500,000	407 International Inc.	2.470 %	09-08-2022	494,953	505,834	1.7
100,000	Alectra Inc.	3.033 %	07-25-2022	100,195	103,110	0.3
1,500,000	Banque de Montréal	1.610 %	10-28-2021	1,458,183	1,489,069	5.0
840,000	Banque de Montréal	2.270 %	07-11-2022	824,682	846,663	2.9
160,000	Banque de Montréal	2.850 %	03-06-2024	159,963	163,503	0.6
180,000	La Banque de Nouvelle-Écosse	2.836 %	07-03-2029	180,000	179,824	0.6
345,000	Bell Canada	3.000 %	10-03-2022	349,268	353,624	1.2
335,000	Bell Canada	4.700 %	09-11-2023	357,120	364,781	1.2
335,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3.290 %	01-15-2024	334,953	348,178	1.2
265,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3.450 %	04-04-2028	264,872	272,421	0.9
245,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	2.950 %	06-19-2029	244,988	246,204	0.8
150,000	Société Canadian Tire Ltée	2.646 %	07-06-2020	150,000	150,654	0.5
500,000	Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	3.196 %	03-07-2023	492,953	511,497	1.7
210,000	CT Real Estate Investment Trust	2.852 %	06-09-2022	207,939	212,720	0.7
140,000	Dollarama Inc.	3.550 %	11-06-2023	139,352	145,604	0.5
200,000	Empire Life Insurance Co.	3.664 %	03-15-2028	200,000	206,800	0.7
325,000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec	3.056 %	09-11-2023	325,000	338,227	1.1
300,000	First Capital Realty Inc.	3.950 %	12-05-2022	307,482	312,236	1.1
95,000	Genworth MI Canada Inc.	4.242 %	04-01-2024	98,208	99,622	0.3
850,000	Hydro One Inc.	1.840 %	02-24-2021	841,237	848,313	2.9
200,000	Industrielle Alliance, Assurance et services financiers inc.	2.640 %	02-23-2027	197,494	201,330	0.7
300,000	Ivanhoe Cambridge II Inc.	2.909 %	06-27-2023	300,000	309,221	1.0
90,000	Leisureworld Senior Care LP	3.474 %	02-03-2021	90,000	91,600	0.3
275,000	Loblaw Cos., Ltd.	3.918 %	06-10-2024	275,000	293,128	1.0
400,000	Lower Mattagami Energy LP	4.331 %	05-18-2021	440,312	417,697	1.4
600,000	Fiducie de capital Financière Manuvie II	7.405 %	12-31-2108	728,196	614,507	2.1
300,000	Société Financière Manuvie	3.317 %	05-09-2028	299,934	308,888	1.0
395,000	Metro Inc.	3.200 %	12-01-2021	406,916	404,064	1.4
255,000	Banque Nationale du Canada	3.183 %	02-01-2028	253,508	258,321	0.9
220,000	Reliance LP	3.813 %	09-15-2020	218,649	223,580	0.8
250,000	Rogers Communications Inc.	5.340 %	03-22-2021	263,928	263,608	0.9
860,000	Banque Royale du Canada	2.360 %	12-05-2022	848,437	869,856	2.9
585,000	Banque Royale du Canada	3.296 %	09-26-2023	584,795	608,660	2.1
150,000	Banque Royale du Canada	3.310 %	01-20-2026	149,939	152,586	0.5
520,000	Saputo Inc.	2.196 %	06-23-2021	514,817	519,137	1.8
290,000	Shaw Communications Inc.	3.800 %	11-02-2023	290,000	304,781	1.0
40,000	Fiducie de placement immobilier SmartCentres	2.757 %	06-23-2021	40,000	40,361	0.1
200,000	Fiducie de capital Sun Life II	5.863 %	12-31-2108	224,854	203,426	0.7
115,000	Financière Sun Life inc.	2.750 %	11-23-2027	113,847	116,739	0.4
250,000	Financière Sun Life inc.	3.050 %	09-19-2028	250,768	256,752	0.9
725,000	TELUS Corp.	2.350 %	03-28-2022	711,779	728,635	2.5

Fonds d'obligations à court terme Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
950,000	La Banque Toronto-Dominion	2.045 %	03-08-2021	947,604	951,863	3.2
975,000	La Banque Toronto-Dominion	1.994 %	03-23-2022	945,097	976,002	3.3
5,000	La Banque Toronto-Dominion	2.850 %	03-08-2024	5,000	5,117	-
230,000	La Banque Toronto-Dominion	2.496 %	12-02-2024	230,000	231,574	0.8
575,000	La Banque Toronto-Dominion	3.589 %	09-14-2028	572,900	597,721	2.0
240,292	West Edmonton Mall Property Inc.	4.056 %	02-13-2024	250,993	249,912	0.8
405,000	WTH Car Rental ULC	1.912 %	07-20-2020	403,275	403,858	1.4
300,000	WTH Car Rental ULC	2.781 %	07-20-2024	300,000	303,629	1.0
				18,389,390	18,605,437	62.8
Titres adossés à des créances hypothécaires						
1,220,000	Mandats axés sur les créances hypothécaires canadiennes	1.840 %	12-01-2022	1,090,997	1,100,067	3.7
370,000	Fiducie de liquidité sur actifs immobiliers	2.870 %	11-12-2052	322,419	325,323	1.1
				1,413,416	1,425,390	4.8
Total des titres à revenu fixe canadiens				29,029,518	29,390,510	99.2
Titres à revenu fixe étrangers						
120,000	AT&T Inc.	4.000 %	11-25-2025	119,683	127,224	0.4
				119,683	127,224	0.4
Titres à court terme – Canada						
Bons du Trésor						
120,000	Province d'Alberta	1.749 %	09-17-2019	119,519	119,519	0.4
				119,519	119,519	0.4
Total des placements				29,268,720	29,637,253	100.0

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes Genus

États de la situation financière

Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité)	30 juin 2019	31 décembre 2018
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	11,159,967 \$	20,384,002 \$
Placements à court terme	-	1,398,712
Placements	274,578,404	238,064,051
Intérêts courus	-	813
Dividendes à recevoir	1,037,560	883,765
Montants à recevoir des courtiers	278,473	-
Marges déposées sur les contrats à terme standardisés	2,510,172	2,085,757
Profit latent sur les contrats à terme standardisés	74,743	134,057
Souscriptions à recevoir des porteurs de parts	384	-
Total de l'actif	289,639,703	262,951,157
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	55,883	70,954
Distributions à payer aux porteurs de parts	6,954	670
Montants à payer aux courtiers	4,167,742	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés	239,318	173,841
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	4,469,897	245,465
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	285,169,806 \$	262,705,692 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	2,026,394	1,974,850
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	140.73 \$	133.03 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	480,030 \$	62,101 \$
Revenu de dividendes	5,985,145	5,187,835
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(815,543)	615,766
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net réalisé à la vente de placements	5,137,413	9,075,476
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur les contrats à terme standardisés	433,462	252,897
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements et les contrats à terme standardisés	10,466,348	(4,447,621)
Total du revenu	21,686,855	10,746,454
Charges		
Honoraires des fiduciaires	5,144	5,073
Frais juridiques	-	3,311
Honoraires d'audit	5,486	-
Frais du comité d'examen indépendant	9,029	5,944
Droits de garde	13,864	13,873
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	20,726	20,624
Autres frais administratifs	49,338	55,880
Charges d'intérêts	2,727	81
Coûts de transaction	320,948	390,420
Total des charges d'exploitation	427,262	495,206
Résultat d'exploitation	21,259,593	10,251,248
Retenues d'impôt	(535,612)	(381,695)
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	20,723,981 \$	9,869,553 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	1,994,615	1,788,646
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par part (série O)	10.39 \$	5.52 \$

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

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	262,705,692 \$	255,080,277 \$
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	20,723,981	9,869,553
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(5,467,305)	(4,401,705)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(5,467,305)	(4,401,705)
Transactions sur parts rachetables		
Émission de parts rachetables	21,979,912	16,547,533
Réinvestissement des parts rachetables	2,908,790	2,209,579
Rachat de parts rachetables	(17,681,264)	(10,818,158)
Augmentation nette découlant des transactions sur parts rachetables	7,207,438	7,938,954
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	22,464,114	13,406,802
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	285,169,806 \$	268,487,079 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	115,634,312 \$	155,359,210 \$
Produit à la vente/à l'échéance des billets à court terme	30,326,000	85,021,340
Achat de placements	(132,851,792)	(161,227,174)
Achat de billets à court terme	(28,915,830)	(86,295,321)
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôt	5,295,738	4,875,522
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	469,385	36,666
Intérêts versés	(2,727)	(81)
Charges d'exploitation payées	(118,658)	(112,747)
Produit net tiré (paiements versés au titre) des règlements de dérivés	9,047	(224,609)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(10,154,525)	(2,567,194)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2,552,231)	(2,191,674)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	21,979,528	16,547,533
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(17,681,264)	(10,818,158)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	1,746,033	3,537,701
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(815,543)	615,766
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9,224,035)	1,586,273
Trésorerie au début de la période	20,384,002 \$	8,799,494 \$
Trésorerie à la fin de la période	11,159,967 \$	10,385,767 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Actions						
Énergie						
16,600	Chevron Corp.			2,525,186	2,699,349	1.0
119,100	ENI SpA			2,806,724	2,588,691	0.9
90,300	Equinor ASA			2,678,078	2,331,318	0.8
79,400	Parkland Fuel Corp.			2,764,897	3,299,070	1.2
118,100	Repsol SA			2,771,318	2,422,668	0.9
118,100	Repsol SA, droits, échéant le 4 juillet 2019			-	85,729	-
408,700	Snam SpA			2,838,202	2,658,414	1.0
121,100	TC Energy Corp.			6,701,082	7,861,812	2.9
57,300	Total SA			3,952,292	4,201,636	1.5
24,800	Valero Energy Corp.			2,956,832	2,774,388	1.0
				29,994,611	30,923,075	11.2
Matières premières						
178,300	BHP Group PLC			5,044,128	5,975,062	2.2
81,600	Rio Tinto PLC			6,136,724	6,623,240	2.4
				11,180,852	12,598,302	4.6
Industries						
51,900	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA			2,798,889	2,711,661	1.0
51,900	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA, droits, échéant le 8 juillet 2019			-	106,582	-
118,500	Mitsubishi Corp.			4,427,137	4,081,791	1.5
123,600	Mitsui & Co., Ltd.			2,841,674	2,629,433	1.0
				10,067,700	9,529,467	3.5
Biens de consommation discrétionnaire						
37,200	Darden Restaurants Inc.			5,390,904	5,917,408	2.2
10,600	Home Depot Inc.			2,878,067	2,880,697	1.0
224,100	Nikon Corp.			4,194,911	4,142,293	1.5
15,700	Whirlpool Corp.			2,933,496	2,920,644	1.1
				15,397,378	15,861,042	5.8
Biens de consommation de base						
50,200	Coca-Cola Co.			3,378,805	3,340,282	1.2
95,300	General Mills Inc.			5,504,655	6,540,464	2.4
15,800	Kimberly-Clark Corp.			2,780,124	2,751,776	1.0
81,300	Koninklijke Ahold Delhaize NV			2,825,738	2,392,820	0.9
24,500	Procter & Gamble Co.			2,977,266	3,510,474	1.3
29,100	Tyson Foods Inc.			2,332,385	3,070,243	1.1
				19,798,973	21,606,059	7.9
Soins de santé						
45,900	Bristol-Myers Squibb Co.			2,819,278	2,720,076	1.0
55,400	Cardinal Health Inc.			4,162,059	3,409,743	1.2
30,000	CVS Health Corp.			3,040,874	2,136,137	0.8
35,900	Merck & Co., Inc.			2,957,496	3,933,585	1.4
56,900	Pfizer Inc.			2,493,999	3,221,007	1.2
15,200	Roche Holding AG			5,063,538	5,595,111	2.0
				20,537,244	21,015,659	7.6
Services financiers						
19,200	Allianz SE			5,346,549	6,057,233	2.2
52,200	Banque de Montréal			5,454,239	5,163,624	1.9
44,500	Banque Canadienne Impériale de Commerce			5,327,579	4,582,610	1.7
44,900	Macquarie Group Ltd.			5,245,130	5,162,779	1.9
118,600	Société Financière Manuvie			2,815,528	2,822,680	1.0
112,700	MetLife Inc.			6,835,740	7,314,911	2.7
126,800	Banque Nationale du Canada			7,267,311	7,888,228	2.9
201,700	Power Corporation du Canada			6,304,194	5,689,957	2.1
95,100	Banque Royale du Canada			7,711,910	9,897,056	3.6
115,800	La Banque Toronto-Dominion			7,472,379	8,861,016	3.2
				59,780,559	63,440,094	23.2

Fonds d'actions à dividendes Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Immobilier						
78,300	Fonds de placement immobilier Allied Properties			3,111,715	3,709,071	1.4
135,700	FPI d'immeubles résidentiels canadiens			4,222,343	6,562,452	2.4
206,100	Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix			2,864,693	2,819,448	1.0
115,600	Fiducie de placement immobilier Granite			6,098,187	6,969,524	2.5
218,800	Fiducie de placement immobilier SmartCentres			6,769,511	7,266,348	2.6
				23,066,449	27,326,843	9.9
Technologies de l'information						
41,300	International Business Machines Corp.			7,785,790	7,442,268	2.7
				7,785,790	7,442,268	2.7
Services de communications						
133,100	AT&T Inc.			5,709,853	5,828,321	2.1
106,000	BCE Inc.			6,210,335	6,315,480	2.3
183,900	Proximus SADP			7,089,218	7,093,391	2.6
55,800	Rogers Communications Inc.			3,907,380	3,911,580	1.4
113,000	TELUS Corp.			5,208,589	5,470,330	2.0
61,500	Verizon Communications Inc.			3,878,188	4,591,244	1.7
				32,003,563	33,210,346	12.1
Services publics						
358,800	Algonquin Power & Utilities Corp.			5,609,096	5,694,156	2.1
148,800	CenterPoint Energy Inc.			5,428,855	5,566,924	2.0
35,000	Entergy Corp.			3,587,920	4,707,616	1.7
97,600	Exelon Corp.			5,093,650	6,114,189	2.2
37,100	FirstEnergy Corp.			1,585,851	2,075,440	0.8
144,400	Fortis Inc.			6,682,555	7,466,924	2.7
				27,987,927	31,625,249	11.5
Total des actions				257,601,046	274,578,404	100.0
Coûts de transaction				(297,570)		
Total des placements				257,303,476	274,578,404	100.0
Contrats à terme standardisés						
Nombre de contrats					Profit (perte) latent(e) (\$)	
(7)	Contrats à terme CME en dollars australiens, septembre 2019				(9,605)	
6	Contrats à terme CME en couronnes suédoises, septembre 2019				34,813	
(35)	Contrats à terme IMM en livres sterling, septembre 2019				(3,144)	
(7)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019				(12,623)	
(65)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019				(116,365)	
(44)	Contrats à terme IMM en Euro, septembre 2019				(61,449)	
52	Contrats à terme IMM en yen japonais, septembre 2019				36,100	
2	Contrats à terme en dollars néo-zélandais, septembre 2019				3,830	
(7)	Contrats à terme en couronnes norvégiennes, septembre 2019				(36,132)	
					(164,575)	

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus

États de la situation financière

	30 juin 2019	31 décembre 2018
Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité)		
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	166,663 \$	55,688 \$
Placements	51,353,007	43,443,699
Intérêts courus	343,350	350,195
Montants à recevoir des courtiers	474,788	-
Total de l'actif	52,337,808	43,849,582
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	15,480	22,106
Rachats à payer aux porteurs de parts	5,000	-
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	20,480	22,106
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	52,317,328 \$	43,827,476 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	491,587	434,153
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	106.43 \$	100.95 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc.

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)		
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	811,428 \$	812,031 \$
Profit de change sur la trésorerie	10	22
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	37,468	(290,391)
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements	2,429,126	(263,347)
Total du revenu	3,278,032	258,315
Charges		
Honoraires des fiduciaires	2,963	3,027
Frais juridiques	-	928
Honoraires d'audit	866	-
Frais du comité d'examen indépendant	1,541	1,429
Droits de garde	2,079	2,123
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	11,341	14,149
Autres frais administratifs	21,897	39,293
Charges d'intérêts	-	1
Total des charges d'exploitation	40,687	60,950
Résultat d'exploitation	3,237,345	197,365
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	3,237,345 \$	197,365 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	465,777	471,051
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par parts (série O)	6.95 \$	0.42 \$

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

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	43,827,476 \$	48,873,634 \$
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	3,237,345	197,365
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(770,989)	(756,309)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(770,989)	(756,309)
Transactions sur parts rachetables		
Émission de parts rachetables	10,908,835	2,259,673
Réinvestissement des parts rachetables	664,325	606,974
Rachat de parts rachetables	(5,549,664)	(3,108,695)
Augmentation (diminution) nette découlant des transactions sur parts rachetables	6,023,496	(242,048)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8,489,852	(800,992)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	52,317,328 \$	48,072,642 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	10,465,277 \$	15,260,098 \$
Produit à la vente / à l'échéance des billets à court terme	1,420,539	1,815,116
Achat de placements	(16,382,778)	(14,632,819)
Achat de billets à court terme	(1,418,888)	(2,098,368)
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	816,621	822,822
Intérêts versés	-	(1)
Charges d'exploitation payées	(47,313)	(58,485)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(5,146,542)	1,108,363
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(106,664)	(149,335)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	10,908,835	2,109,673
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(5,544,664)	(3,108,695)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	5,257,507	(1,148,357)
Profit de change sur la trésorerie	10	22
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	110,975	(39,972)
Trésorerie au début de la période	55,688 \$	219,301 \$
Trésorerie à la fin de la période	166,663 \$	179,329 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Titres à revenu fixe canadiens						
Obligations de sociétés						
160,000	407 International Inc.	3.350 %	05-16-2024	168,863	168,990	0.3
250,000	407 International Inc.	2.430 %	05-04-2027	246,285	253,209	0.5
620,000	407 International Inc.	3.140 %	03-06-2030	619,659	652,970	1.3
350,000	407 International Inc.	3.430 %	06-01-2033	357,365	375,386	0.7
250,000	AIMCo Realty Investors LP	2.712 %	06-01-2029	250,000	252,443	0.5
400,000	Alectra Inc.	3.239 %	11-21-2024	400,000	421,658	0.8
810,000	Alectra Inc.	2.488 %	05-17-2027	806,119	818,114	1.6
1,000,000	Banque de Montréal	2.700 %	09-11-2024	999,870	1,030,936	2.1
710,000	Banque de Montréal	2.700 %	12-09-2026	702,543	733,166	1.4
730,000	bcIMC Realty Corp.	2.840 %	06-03-2025	731,149	752,405	1.5
250,000	bcIMC Realty Corp.	3.000 %	03-31-2027	250,000	260,669	0.5
90,000	Bell Canada	2.750 %	01-29-2025	89,816	91,134	0.2
350,000	Bell Canada	3.350 %	03-12-2025	355,614	365,058	0.7
455,000	Bell Canada	2.900 %	08-12-2026	450,804	460,056	0.9
485,000	Bell Canada	7.000 %	09-24-2027	614,110	615,110	1.2
450,000	Bell Canada	3.600 %	09-29-2027	448,691	474,171	0.9
1,125,000	Bell Canada	3.800 %	08-21-2028	1,123,706	1,202,755	2.3
450,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3.290 %	01-15-2024	449,937	467,702	0.9
725,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3.300 %	05-26-2025	746,530	771,419	1.5
625,000	Banque Canadienne Impériale de Commerce	2.950 %	06-19-2029	624,969	628,073	1.2
765,000	CCL Industries Inc.	3.864 %	04-13-2028	766,188	813,083	1.6
1,720,000	Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	4.055 %	11-24-2025	1,780,123	1,831,354	3.7
165,000	Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix	3.532 %	06-11-2029	165,000	167,828	0.3
340,000	Coast Capital Savings Credit Union	5.000 %	05-03-2028	340,000	356,129	0.7
160,000	Coast Capital Savings Credit Union	5.250 %	10-29-2030	160,000	170,978	0.3
1,075,000	CT Real Estate Investment Trust	3.289 %	06-01-2026	1,072,305	1,097,044	2.1
300,000	EPCOR Utilities Inc.	6.800 %	06-28-2029	400,620	408,190	0.8
500,000	Fair Hydro Trust	3.357 %	05-15-2033	500,015	543,850	1.1
45,000	Fair Hydro Trust	3.520 %	05-15-2038	45,001	50,219	0.1
320,000	First Capital Realty Inc.	4.790 %	08-30-2024	335,635	347,479	0.7
700,000	First Capital Realty Inc.	3.604 %	05-06-2026	681,093	714,042	1.4
219,115	Grand Renewable Solar LP	3.926 %	01-31-2035	219,115	228,005	0.4
660,000	Granite REIT Holdings LP	3.873 %	11-30-2023	662,960	687,792	1.3
400,000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	2.730 %	04-03-2029	399,896	413,023	0.8
321,925	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	6.450 %	07-30-2029	392,855	390,430	0.8
350,000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	6.980 %	10-15-2032	506,590	517,373	1.0
120,000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto	3.260 %	06-01-2037	119,918	128,103	0.2
400,000	Hydro One Inc.	2.970 %	06-26-2025	400,728	416,591	0.8
150,000	Hydro One Inc.	7.350 %	06-03-2030	212,925	214,652	0.4
535,000	Hydro One Inc.	4.890 %	03-13-2037	631,023	664,843	1.3
405,022	Kingston Solar LP	3.571 %	07-31-2035	406,763	413,916	0.8
150,000	Les Compagnies Loblaw Ltée	3.918 %	06-10-2024	150,000	159,888	0.3
1,140,000	Les Compagnies Loblaw Ltée	4.488 %	12-11-2028	1,216,661	1,274,606	2.5
560,000	Les Compagnies Loblaw Ltée	6.500 %	01-22-2029	699,669	707,992	1.4
650,000	Lower Mattagami Energy LP	3.416 %	06-20-2024	661,288	689,802	1.3
850,000	Lower Mattagami Energy LP	2.307 %	10-21-2026	812,653	852,055	1.7
265,000	Société Financière Manuvie	3.317 %	05-09-2028	265,000	272,851	0.5
1,020,000	Société Financière Manuvie	3.049 %	08-20-2029	1,017,458	1,043,852	2.0
1,445,000	Metro Inc.	3.390 %	12-06-2027	1,436,626	1,499,199	3.0
300,000	Banque Nationale du Canada	3.183 %	02-01-2028	300,000	303,907	0.6
460,000	OMERS Realty Corp.	3.328 %	11-12-2024	471,262	485,923	0.9
400,000	OMERS Realty Corp.	3.244 %	10-04-2027	400,000	423,721	0.8
1,240,000	Reliance LP	3.836 %	03-15-2025	1,250,100	1,290,264	2.5
1,150,000	Rogers Communications Inc.	4.000 %	03-13-2024	1,200,396	1,228,568	2.4
1,295,000	Banque Royale du Canada	3.296 %	09-26-2023	1,296,871	1,347,375	2.6
1,470,000	Saputo Inc.	2.827 %	11-21-2023	1,462,572	1,482,554	3.0
200,000	Saputo Inc.	3.603 %	08-14-2025	204,254	207,854	0.4
850,000	Shaw Communications Inc.	4.400 %	11-02-2028	860,630	934,858	1.8

Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
850,000	Financière Sun Life inc.	3.050 %	09-19-2028	853,686	872,958	1.7
85,000	Fiducie de capital TD IV	10.000 %	06-30-2108	95,553	103,086	0.2
1,630,000	TELUS Corp.	3.750 %	03-10-2026	1,677,818	1,733,404	3.4
395,000	TELUS Corp.	3.625 %	03-01-2028	399,982	416,445	0.8
375,000	TELUS Corp.	3.300 %	05-02-2029	371,906	384,241	0.7
350,000	La Banque de Nouvelle-Écosse	2.290 %	06-28-2024	342,209	353,510	0.7
1,885,000	La Banque de Nouvelle-Écosse	2.620 %	12-02-2026	1,886,012	1,937,128	3.8
625,000	La Banque Toronto-Dominion	2.850 %	03-08-2024	630,000	639,678	1.2
590,000	La Banque Toronto-Dominion	2.496 %	12-02-2024	590,000	594,037	1.2
900,000	La Banque Toronto-Dominion	3.224 %	07-25-2029	898,920	922,328	1.8
415,000	La Banque Toronto-Dominion	4.859 %	03-04-2031	427,430	465,429	0.9
135,000	La Banque Toronto-Dominion	3.060 %	01-26-2032	134,951	135,604	0.3
500,000	TMX Group Ltd.	3.779 %	06-05-2028	500,000	535,545	1.0
520,000	Industries Toromont Ltée	3.842 %	10-27-2027	522,965	554,791	1.1
1,750,000	Toronto Hydro Corp.	2.520 %	08-25-2026	1,704,964	1,788,238	3.6
525,429	West Edmonton Mall Property Inc.	4.056 %	02-13-2024	538,118	546,465	1.1
				45,914,737	47,558,504	92.8
Obligations fédérales						
300,000	CPPIB Capital Inc.	3.000 %	06-15-2028	300,000	321,323	0.6
				300,000	321,323	0.6
Obligations provinciales						
345,000	Province d'Ontario	3.500 %	06-02-2024	368,409	371,908	0.7
800,000	Province d'Ontario	2.700 %	06-02-2029	836,880	838,981	1.6
450,000	South Coast British Columbia Transportation Authority	3.250 %	11-23-2028	449,352	485,462	0.9
				1,654,641	1,696,351	3.2
Titres adossés à des créances hypothécaires						
650,000	Fiducie de liquidité sur actifs immobiliers	3.636 %	11-12-2052	652,919	679,822	1.3
				652,919	679,822	1.3
Total des titres à revenu fixe canadiens				48,522,297	50,256,000	97.9
Titres à revenu fixe étrangers						
225,000	AT&T Inc.	4.000 %	11-25-2025	224,406	238,545	0.5
660,000	Heathrow Funding Ltd.	3.400 %	03-08-2028	659,129	688,518	1.3
160,000	Heathrow Funding Ltd.	3.782 %	09-04-2030	160,000	169,944	0.3
				1,043,535	1,097,007	2.1
Total des placements				49,565,832	51,353,007	100.0

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

États de la situation financière

Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité)	30 juin 2019	31 décembre 2018
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	4,437,140 \$	4,831,814 \$
Placements	67,940,685	54,887,092
Dividendes à recevoir	341,065	255,945
Marges déposées sur les contrats à terme standardisés	683,224	709,245
Profit latent sur les contrats à terme standardisés	12,642	55,716
Total de l'actif	73,414,756	60,739,812
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	19,087	28,302
Montants à payer aux courtiers	879,319	-
Distributions à payer aux porteurs de parts	525	188
Perte latente sur les contrats à terme standardisés	50,196	57,199
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	949,127	85,689
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	72,465,629 \$	60,654,123 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	742,324	638,413
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	97.62 \$	95.01 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	148,330 \$	35,034 \$
Revenu de dividendes	1,403,824	1,454,450
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(160,241)	203,887
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net réalisé à la vente de placements	234,647	1,891,442
Perte nette réalisée sur les contrats à terme standardisés	(23,889)	(52,509)
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements et les contrats à terme standardisés	1,420,255	(1,445,157)
Total du revenu	3,022,926	2,087,147
Charges		
Honoraires des fiduciaires	3,098	3,186
Droits de garde	3,963	4,010
Honoraires d'audit	729	-
Frais du comité d'examen indépendant	2,073	2,013
Frais juridiques	-	1,265
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	15,310	15,758
Autres frais administratifs	46,050	59,563
Coûts de transaction	91,317	91,194
Charges d'intérêts	317	338
Total des charges d'exploitation	162,857	183,327
Résultat d'exploitation	2,860,069	1,903,820
Retenues d'impôt	(152,936)	(131,528)
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	2,707,133 \$	1,772,292 \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	694,083	611,279
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par part (série O)	3.90 \$	2.90 \$

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

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	60,654,123 \$	66,431,297 \$
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	2,707,133	1,772,292
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(1,189,374)	(1,122,139)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1,189,374)	(1,122,139)
Transactions sur parts rachetables		
Émission de parts rachetables	14,255,768	7,033,188
Réinvestissement des parts rachetables	908,427	800,631
Rachat de parts rachetables	(4,870,448)	(7,584,933)
Augmentation nette découlant des transactions sur parts rachetables	10,293,747	248,886
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	11,811,506	899,039
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	72,465,629 \$	67,330,336 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité)	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	35,899,518 \$	40,407,514 \$
Produit à la vente / à l'échéance des billets à court terme	10,129,830	11,909,865
Achat de placements	(46,474,136)	(43,347,861)
Achat de billets à court terme	(10,125,719)	(11,905,607)
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôt	1,165,768	1,267,312
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	144,219	30,776
Intérêts versés	(317)	(338)
Charges d'exploitation payées	(80,438)	(84,719)
Produit net tiré (paiements versés au titre) des règlements de dérivés	2,132	(202,242)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(9,339,143)	(1,925,300)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(280,610)	(321,450)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	14,255,768	7,033,188
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(4,870,448)	(7,584,933)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	9,104,710	(873,195)
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(160,241)	203,887
Diminution nette de la trésorerie	(394,674)	(2,594,608)
Trésorerie au début de la période	4,831,814 \$	4,923,508 \$
Trésorerie à la fin de la période	4,437,140 \$	2,328,900 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Actions						
Industries						
23,800	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA			1,250,014	1,243,498	1.8
23,800	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA, droits, échéant le 8 juillet 2019			-	48,876	0.1
45,100	Dai Nippon Printing Co., Ltd.			1,392,883	1,255,921	1.8
18,600	Eaton Corp. PLC			2,034,357	2,024,159	3.0
				4,677,254	4,572,454	6.7
Biens de consommation discrétionnaire						
27,400	Bridgestone Corp.			1,449,097	1,409,728	2.1
6,600	Genuine Parts Co.			882,627	893,328	1.3
5,800	Leggett & Platt Inc.			346,559	290,811	0.4
7,400	The Home Depot Inc.			1,918,961	2,011,052	3.0
				4,597,244	4,604,919	6.8
Biens de consommation de base						
14,100	Kimberly-Clark Corp.			2,178,651	2,455,699	3.7
81,600	Koninklijke Ahold Delhaize NV			2,585,676	2,401,650	3.5
				4,764,327	4,857,349	7.2
Services de communications						
23,900	BCE Inc.			1,367,112	1,423,962	2.1
34,400	NTT DOCOMO Inc.			1,137,346	1,048,283	1.5
61,400	Proximus SADP			2,376,084	2,368,321	3.5
52,100	TELUS Corp.			2,402,904	2,522,161	3.7
				7,283,446	7,362,727	10.8
Soins de santé						
5,900	Abbvie Inc.			691,737	560,657	0.8
41,000	Bristol-Myers Squibb Co.			2,482,019	2,429,697	3.6
30,700	Cardinal Health Inc.			2,183,519	1,889,515	2.8
8,400	CVS Health Corp.			842,461	598,118	0.9
8,700	Gilead Sciences Inc.			791,438	768,068	1.1
22,400	Merck & Co., Inc.			2,337,525	2,454,381	3.6
20,400	Novo Nordisk A/S			1,424,090	1,360,540	2.0
				10,752,789	10,060,976	14.8
Services financiers						
27,800	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.			728,737	719,155	1.1
18,500	Banque de Montréal			1,924,606	1,830,020	2.7
12,600	Banque Canadienne Impériale de Commerce			1,521,735	1,297,548	1.9
28,800	DBS Group Holdings Ltd.			714,694	722,114	1.1
47,900	Great-West Lifeco Inc.			1,439,793	1,444,185	2.1
91,300	Manulife Financial Corp.			2,164,852	2,172,940	3.2
28,300	MetLife Inc.			1,710,025	1,836,841	2.7
31,600	Banque Nationale du Canada			1,864,382	1,965,836	2.9
27,600	ORIX Corp.			534,767	538,281	0.8
54,500	Power Corporation du Canada			1,703,414	1,537,445	2.3
22,800	Banque Royale du Canada			2,054,294	2,372,796	3.5
29,600	Starwood Property Trust Inc.			892,893	878,802	1.3
32,900	La Banque Toronto-Dominion			2,238,294	2,517,507	3.8
2,400	Zurich Insurance Group AG			976,888	1,093,322	1.6
				20,469,374	20,926,792	31.0
Immobilier						
25,500	FPI d'immeubles résidentiels canadiens			922,893	1,233,180	1.8
91,000	Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix			1,242,696	1,244,880	1.8
17,200	Fiducie de placement immobilier Granite			890,290	1,036,988	1.5
89,900	Fiducie de placement immobilier H&R			1,929,656	2,053,316	3.0
59,100	Fiducie de placement immobilier SmartCentres			1,849,378	1,962,711	2.9
				6,834,913	7,531,075	11.0

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Taux d'intérêt nominal	Date d'échéance	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Services publics						
121,900	United Utilities Group PLC			1,716,159	1,586,977	2.3
				1,716,159	1,586,977	2.3
Technologies de l'information						
53,900	Canon Inc.			2,125,539	2,056,655	3.0
7,100	Cisco Systems Inc.			400,671	507,779	0.7
10,500	International Business Machines Corp.			1,974,562	1,892,102	2.8
				4,500,772	4,456,536	6.5
Matières premières						
23,200	Sonoco Products Co.			1,558,526	1,980,880	2.9
				1,558,526	1,980,880	2.9
Total des actions				67,154,804	67,940,685	100.0
Coûts de transaction				(69,750)		
Total des placements				67,085,054	67,940,685	100.0
Contrats à terme standardisés						
Nombre de contrats					Profit (perte) latent(e) (\$)	
4	Contrats à terme IMM en dollars australiens, septembre 2019				5,488	
11	Contrats à terme IMM en livres sterling, septembre 2019				1,123	
2	Contrats à terme IMM en livres sterling, septembre 2019				229	
(6)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019				(10,741)	
(10)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019				(18,032)	
(5)	Contrats à terme IMM en Euros, septembre 2019				(6,983)	
(12)	Contrats à terme IMM en yen japonais, septembre 2019				(8,429)	
1	Contrats à terme IMM en couronnes suédoises, septembre 2019				5,802	
(2)	Contrats à terme IMM en francs suisses, septembre 2019				(6,011)	
					(37,554)	

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus

États de la situation financière

	30 juin 2019	31 décembre 2018
Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité) [en dollars américains]		
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	1,900,495 \$	1,701,182 \$
Placements	48,337,130	40,024,127
Dividendes à recevoir	96,826	108,147
Montants à recevoir des courtiers	143,930	-
Marges déposées sur les contrats à terme standardisés	109,914	202,275
Profit latent sur les contrats à terme standardisés	28,234	18,310
Souscriptions à recevoir des porteurs de parts	11,535	29,322
Total de l'actif	50,628,064	42,083,363
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	27,380	29,115
Montants à payer aux courtiers	497,665	-
Distributions à payer aux porteurs de parts	211	959
Rachats à payer aux porteurs de parts	40,103	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés	24,428	28,213
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	589,787	58,287
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	50,038,277 \$	42,025,076 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	636,350	614,566
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	78.63 \$	68.38 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]		
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	34,721 \$	23,027 \$
Revenu de dividendes	658,562	828,513
Profit (perte) de change sur la trésorerie	31,699	(20,117)
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net réalisé à la vente de placements	521,079	1,492,243
Perte nette réalisée sur les contrats à terme standardisés	(100,836)	(50,065)
Variation nette du profit (de la perte) latent(e) sur les placements et les contrats à terme standardisés	5,325,035	(2,460,762)
Total du revenu (perte)	6,470,260	(187,161)
Charges		
Honoraires des fiduciaires	2,292	2,519
Droits de garde	2,894	3,544
Honoraires d'audit	1,045	-
Frais du comité d'examen indépendant	1,428	1,647
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	10,652	13,827
Frais juridiques	-	1,123
Autres frais administratifs	32,748	48,471
Coûts de transaction	56,559	67,545
Charges d'intérêts	17	45
Total des charges d'exploitation	107,635	138,721
Résultat d'exploitation	6,362,625	(325,882)
Retenues d'impôt	(49,819)	(81,438)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	6,312,806 \$	(407,320) \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	629,137	706,079
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par parts (série O)	10.03 \$	(0.58) \$

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

	2019	2018
Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	42,025,076 \$	56,948,441 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	6,312,806	(407,320)
Transactions sur parts rachetables		
Émission de parts rachetables	7,173,295	6,914,946
Réinvestissement des parts rachetables	-	5,216
Rachat de parts rachetables	(5,472,900)	(8,910,440)
Augmentation (diminution) nette découlant des transactions sur parts rachetables	1,700,395	(1,990,278)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8,013,201	(2,397,598)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	50,038,277 \$	54,550,843 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	32,102,116 \$	34,147,673 \$
Produit à la vente / à l'échéance des billets à court terme	-	233,681
Achat de placements	(34,285,538)	(32,658,223)
Achat de billets à court terme	-	(235,124)
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôt	620,064	725,768
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	34,721	24,470
Intérêts versés	(17)	(45)
Charges d'exploitation payées	(52,794)	(70,647)
Produit net tiré (paiements versés au titre) des règlements de dérivés	(8,475)	3,096
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(1,589,923)	2,170,649
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(748)	5,018
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	7,191,082	6,857,912
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(5,432,797)	(8,779,082)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	1,757,537	(1,916,152)
Profit (perte) de change sur la trésorerie	31,699	(20,117)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	199,313	234,380
Trésorerie au début de la période	1,701,182 \$	511,356 \$
Trésorerie à la fin de la période	1,900,495 \$	745,736 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

[en dollars américains]

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Actions				
Matières premières				
108,200	Fortescue Metals Group Ltd.	627,855	684,882	1.4
29,400	Kirkland Lake Gold Ltd.	486,154	1,269,369	2.6
4,000	Koninklijke DSM NV	419,964	495,149	1.0
183,000	OceanaGold Corp.	603,513	501,351	1.0
7,700	Reliance Steel & Aluminum Co.	694,666	728,574	1.5
1,100	Sherwin-Williams Co.	522,763	504,119	1.0
		3,354,915	4,183,444	8.5
Industries				
23,600	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	1,038,978	943,602	2.0
23,600	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA, droits, échéant le 8 juillet 2019	-	37,088	0.1
22,000	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	507,978	468,832	1.0
12,200	Eaton Corp. PLC	1,060,840	1,016,016	2.1
5,700	Emerson Electric Co.	397,906	380,304	0.8
30,100	Experian PLC	716,722	913,270	1.9
1,900	Lennox International Inc.	514,839	522,500	1.1
13,000	Thomson Reuters Corp.	768,489	840,436	1.7
		5,005,752	5,122,048	10.7
Biens de consommation discrétionnaire				
6,700	Best Buy Co., Inc.	502,320	467,191	1.0
21,300	Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	700,711	826,083	1.7
1,000	Kering SA	478,922	592,288	1.2
17,200	Magna International Inc.	833,897	857,664	1.8
9,500	Sony Corp.	498,127	498,014	1.0
5,100	The Home Depot Inc.	996,914	1,060,647	2.2
9,400	TJX Cos Inc.	498,553	497,072	1.0
		4,509,444	4,798,959	9.9
Biens de consommation de base				
3,600	Kimberly-Clark Corp.	492,724	479,808	1.0
42,600	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1,029,778	959,485	2.0
13,100	Metro Inc.	496,093	492,622	1.0
		2,018,595	1,931,915	4.0
Soins de santé				
33,700	Astellas Pharma Inc.	489,944	480,133	1.0
13,500	Bristol-Myers Squibb Co.	620,307	612,225	1.3
4,100	Edwards Lifesciences Corp.	756,344	757,434	1.6
35,100	Exelixis Inc.	729,975	750,087	1.6
9,900	Merck & Co., Inc.	829,472	830,115	1.7
10,000	Novo Nordisk A/S	522,537	510,376	1.1
		3,948,579	3,940,370	8.3
Services financiers				
7,500	American Express Co.	803,029	925,800	1.9
7,000	Banque de Montréal	557,106	529,895	1.1
7,100	Banque Canadienne Impériale de Commerce	646,976	559,524	1.2
7,900	Lincoln National Corp.	495,888	509,155	1.1
76,300	Société Financière Manuvie	1,379,292	1,389,661	2.8
20,500	MetLife Inc.	902,023	1,018,235	2.1
15,700	Banque Nationale du Canada	731,975	747,425	1.5
10,600	Progressive Corp.	749,715	847,258	1.8
26,800	Banque Royale du Canada	1,771,520	2,134,361	4.3
15,400	Synchrony Financial	492,055	533,918	1.1
38,700	La Banque Toronto-Dominion	1,957,971	2,266,175	4.7
		10,487,550	11,461,407	23.6

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

[en dollars américains]

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Immobilier				
21,700	Fonds de placement immobilier Allied Properties	715,214	786,630	1.6
2,600	AvalonBay Communities Inc.	487,563	528,268	1.1
26,800	FPI d'immeubles résidentiels canadiens	699,320	991,810	2.1
28,600	Fiducie de placement immobilier H&R	503,026	499,884	1.0
4,700	Prologis Inc.	295,927	376,470	0.8
		2,701,050	3,183,062	6.6
Technologies de l'information				
28,600	Advanced Micro Devices Inc.	643,682	868,582	1.8
2,300	Arista Networks Inc.	565,381	597,126	1.2
7,200	Cadence Design Systems Inc.	487,621	509,832	1.1
16,200	CGI Inc.	1,013,880	1,248,147	2.6
700	Constellation Software Inc.	433,187	661,163	1.4
2,900	Intuit Inc.	574,018	757,857	1.6
12,800	Microsoft Corp.	1,370,375	1,714,688	3.4
1,200	Shopify Inc.	369,051	361,428	0.7
6,100	VMware Inc.	792,321	1,019,981	2.1
		6,249,516	7,738,804	15.9
Services de communications				
21,400	Comcast Corp.	859,477	904,792	1.9
3,300	IAC	724,405	717,849	1.5
12,100	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	499,861	563,446	1.2
42,500	Quebecor Inc.	837,871	1,014,407	2.1
7,300	Rogers Communications Inc.	378,856	391,605	0.8
10,100	TELUS Corp.	359,134	374,166	0.8
29,000	Twitter Inc.	1,006,978	1,012,100	2.1
3,500	Walt Disney Co.	484,053	488,740	1.0
83,200	Zynga Inc.	515,590	510,016	1.1
		5,666,225	5,977,121	12.5
Total des actions		43,941,626	48,337,130	100.0
Coûts de transaction		(37,949)		
Total des placements		43,903,677	48,337,130	100.0
Contrats à terme standardisés				
Nombre de contrats		Profit (perte) latent(e) (\$)		
4	Contrats à terme CME en dollars australiens, septembre 2019	4,240		
(2)	Contrats à terme CME en Euros, septembre 2019	(2,138)		
(1)	Contrats à terme CME en couronnes suédoises, septembre 2019	(4,460)		
7	Contrats à terme CME en francs suisses, septembre 2019	16,012		
1	Contrats à terme CME en francs suisses, septembre 2019	2,263		
12	Contrats à terme IMM en livres sterling, septembre 2019	938		
(11)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019	(15,070)		
(2)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019	(2,760)		
9	Contrats à terme IMM en yen japonais, septembre 2019	4,781		
		3,806		

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus

États de la situation financière

Au 30 juin 2019 (non audité) et au 31 décembre 2018 (audité) [en dollars américains]	30 juin 2019	31 décembre 2018
Actif		
Actifs courants		
Trésorerie	1,076,057 \$	730,294 \$
Placements	24,086,741	20,923,621
Dividendes à recevoir	49,226	20,736
Montants à recevoir des courtiers	2,721,237	-
Marges déposées sur les contrats à terme standardisés	353,096	403,665
Profit latent sur les contrats à terme standardisés	22,769	12,677
Souscriptions à recevoir des porteurs de parts	7,225	19,061
Total de l'actif	28,316,351	22,110,054
Passif		
Passifs courants		
Dettes fournisseurs et charges à payer	19,821	19,832
Montants à payer aux courtiers	3,288,050	-
Distributions à payer aux porteurs de parts	-	285
Rachats à payer aux porteurs de parts	3,817	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés	19,938	36,545
Total du passif (compte non tenu de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables)	3,331,626	56,662
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (série O)	24,984,725 \$	22,053,392 \$
Parts rachetables en circulation (note 5)	246,816	248,771
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (série O)	101.23 \$	88.65 \$

Au nom du conseil d'administration de Genus Capital Management Inc. :

Leslie G. Cliff
Administratrice

Wayne W. Wachell
Administrateur

États du résultat global

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]	2019	2018
Revenu		
Revenu d'intérêts aux fins de distribution	4,680 \$	7,135 \$
Revenu de dividendes	248,077	385,875
Profit (perte) de change sur la trésorerie	6,201	(3,745)
Autres variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Profit net réalisé à la vente de placements	913,390	247,574
Perte nette réalisée sur les contrats à terme standardisés	(49,601)	(68,930)
Variation nette du profit (perte) latent sur les placements et les dérivés	2,073,830	(803,409)
Total du revenu (perte)	3,196,577	(235,500)
Charges		
Honoraires des fiduciaires	2,046	2,213
Frais juridiques	-	505
Honoraires d'audit	335	-
Frais du comité d'examen indépendant	540	735
Droits de garde	1,996	2,688
Coûts liés à l'information aux porteurs de parts	8,983	9,891
Autres frais administratifs	40,031	53,311
Coûts de transaction	22,428	37,738
Charges d'intérêts	78	28
Total des charges d'exploitation	76,437	107,109
Résultat d'exploitation	3,120,140	(342,609)
Retenues d'impôt	(7,239)	(38,288)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation (série O)	3,112,901 \$	(380,897) \$
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période	244,299	237,888
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation, par parts (série O)	12.74 \$	(1.60) \$

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

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]	2019	2018
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période (série O)	22,053,392 \$	25,436,897 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	3,112,901	(380,897)
Transactions sur parts rachetables		
Emission de parts rachetables	2,582,347	3,250,532
Rachat de parts rachetables	(2,763,915)	(1,869,161)
Augmentation (diminution) nette découlant des transactions sur parts rachetables	(181,568)	1,381,371
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2,931,333	1,000,474
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période (série O)	24,984,725 \$	26,437,371 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus

Tableaux des flux de trésorerie

Pour les périodes closes les 30 juin (non audité) [en dollars américains]	2019	2018
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Produit de la vente de placements	5,743,218 \$	11,778,225 \$
Achat de placements	(5,401,432)	(13,922,916)
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôt	212,348	304,918
Intérêt reçu, compte non tenu du profit sur les billets à court terme	4,680	7,135
Intérêts versés	(78)	(28)
Charges d'exploitation payées	(53,942)	(66,833)
Produit net tiré (paiements versés au titre) des règlements de dérivés	968	(148,538)
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	505,762	(2,048,037)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(285)	(94)
Trésorerie reçue des parts rachetables émises	2,594,183	3,212,509
Montants versés pour les parts rachetables rachetées	(2,760,098)	(1,869,161)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	(166,200)	1,343,254
Profit (perte) de change sur la trésorerie	6,201	(3,745)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	345,763	(708,528)
Trésorerie au début de la période	730,294 \$	779,046 \$
Trésorerie à la fin de la période	1,076,057 \$	70,518 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

[en dollars américains]

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Actions				
Matières premières				
14,900	Johnson Matthey PLC	720,440	631,287	2.6
3,000	Koninklijke DSM NV	368,521	371,362	1.5
2,200	The Sherwin-Williams Co.	873,950	1,008,238	4.2
		1,962,911	2,010,887	8.3
Industries				
7,300	Acuity Brands Inc.	1,053,887	1,006,743	4.2
19,400	Alstom SA	895,324	901,380	3.7
16,600	Kingspan Group PLC	798,691	905,681	3.8
8,100	KION Group AG	677,874	511,393	2.1
12,449	Vestas Wind Systems A/S	818,298	1,076,990	4.5
3,300	Xylem Inc.	266,015	276,012	1.1
		4,510,089	4,678,199	19.4
Services de communications				
37,500	Pearson PLC	445,486	391,069	1.6
		445,486	391,069	1.6
Biens de consommation discrétionnaire				
21,300	Benesse Holdings Inc.	496,826	495,827	2.1
15,900	Berkeley Group Holdings PLC	792,729	755,004	3.1
		1,289,555	1,250,831	5.2
Biens de consommation de base				
7,700	Kimberly-Clark Corp.	927,535	1,026,256	4.3
26,400	Unicharm Corp.	799,744	794,891	3.3
		1,727,279	1,821,147	7.6
Soins de santé				
55,800	Astellas Pharma Inc.	834,946	794,997	3.3
13,100	Bristol-Myers Squibb Co.	597,984	594,085	2.5
5,300	Eli Lilly & Co.	451,359	587,187	2.4
6,800	Gilead Sciences Inc.	529,061	459,408	1.9
6,500	Jazz Pharmaceuticals PLC	1,023,363	926,640	3.8
4,300	Merck & Co., Inc.	361,323	360,555	1.5
4,800	Vertex Pharmaceuticals Inc.	801,903	880,224	3.7
		4,599,939	4,603,096	19.1
Immobilier				
3,700	Alexandria Real Estate Equities Inc.	466,261	522,033	2.2
597,300	CapitaLand Commercial Trust	853,119	958,011	4.0
38,800	First Capital Realty Inc.	560,026	649,067	2.7
186,700	Swire Properties Ltd.	609,799	753,969	3.1
		2,489,205	2,883,080	12.0
Services publics				
75,800	United Utilities Group PLC	751,394	755,173	3.1
		751,394	755,173	3.1
Technologies de l'information				
6,600	Cisco Systems Inc.	368,830	361,218	1.5
9,150	Citrix Systems Inc.	740,087	897,981	3.7
6,500	Dassault Systemes	743,883	1,038,525	4.3
17,100	Hewlett Packard Enterprise Co.	277,138	255,645	1.1
4,400	International Business Machines Corp.	607,216	606,760	2.5
7,500	Microsoft Corp.	952,687	1,004,700	4.2
2,800	Salesforce.com Inc.	445,171	424,844	1.8
6,600	VMware Inc.	697,410	1,103,586	4.6
		4,832,422	5,693,259	23.7
Total des actions		22,608,280	24,086,741	100.0
Coûts de transaction		(48,619)		
Total des placements		22,559,661	24,086,741	100.0

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus

Inventaire du portefeuille

[en dollars américains]

Au 30 juin 2019 (non audité)

Actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% du portefeuille total
Contrats à terme standardisés				
Nombre de contrats			Profit (perte) latent(e) (\$)	
6	Contrats à terme CME en dollars australiens, septembre 2019		6,360	
(5)	Contrats à terme CME en Euros, septembre 2019		(5,344)	
1	Contrats à terme CME en couronnes suédoises, septembre 2019		4,440	
5	Contrats à terme CME en francs suisses, mars 2019		11,438	
(13)	Contrats à terme IMM en livres sterling, septembre 2019		(894)	
(10)	Contrats à terme IMM en dollars canadiens, septembre 2019		(13,700)	
1	Contrats à terme IMM en yen japonais, septembre 2019		531	
			2,831	

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

1. ACTIVITÉS D'EXPLOITATION

Les Fonds du Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management (« Genus ») sont des fonds communs de placement à capital variable constitués en vertu de conventions de fiducie conclues avec Fiducie RBC Services aux Investisseurs, le fiduciaire des Fonds. L'adresse des Fonds figurant dans les registres est la suivante : 860 - 980 Howe Street, Vancouver (Colombie-Britannique), Canada, V6Z 0C8. Le revenu des Fonds est attribué au prorata aux porteurs de parts.

Genus Capital Management Inc. est le gestionnaire (« gestionnaire »). La publication des états financiers a été approuvée par le gestionnaire le 28^e août 2019.

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Les présents états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »), y compris la norme comptable internationale (« IAS ») 34 : *Information financière intermédiaire*, telles que publiées par l'International Accounting Standards Board (« IASB ») et selon les exigences du Conseil des normes comptables du Canada.

Transition à IFRS 9

Le 1^{er} janvier 2018, le Fonds a adopté l'IFRS 9, *Instruments financiers*. La norme a été appliquée de façon rétrospective. Selon cette nouvelle norme, les actifs doivent être comptabilisés au coût amorti, à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »), ou à la juste valeur par le biais des autres éléments du résultat global (« JVAERG »), en fonction du modèle économique de l'entité pour la gestion des actifs financiers et des caractéristiques des flux de trésorerie contractuels des actifs financiers.

L'évaluation et la décision à l'égard du modèle économique utilisé représentent un jugement comptable.

Le classement et l'évaluation des passifs demeurent sensiblement les mêmes, à l'exception des passifs comptabilisés par le biais du résultat net. Pour ces passifs, les variations de la juste valeur attribuables aux variations du risque de crédit propre à l'entité doivent être présentées dans les autres éléments du résultat global à moins qu'elles n'aient une incidence sur les montants comptabilisés dans le résultat.

Au moment de la transition à l'IFRS 9, l'incidence de cette norme sur les actifs et passifs financiers du Fonds auparavant classés comme étant détenus à des fins de transaction en vertu de l'IAS 39 a fait l'objet d'une évaluation détaillée. L'évaluation a permis de conclure que l'adoption de la nouvelle norme n'avait aucune incidence importante sur les actifs et passifs financiers comptabilisés à la juste valeur par le biais du résultat net en vertu de l'IFRS 9. La transition à l'IFRS 9 n'a eu aucune incidence importante sur les critères d'évaluation des actifs et passifs financiers.

a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent les actifs et les passifs financiers, comme les titres de créances et les titres de capitaux propres, les fonds de placement à capital variable et les dérivés, la trésorerie, les créances clients et autres débiteurs, et les dettes fournisseurs et autres créditeurs. Les Fonds comptabilisent les instruments financiers à la juste valeur au moment de la comptabilisation initiale, plus les coûts de transaction dans le cas des instruments financiers évalués au coût amorti. Les achats normalisés ou ventes normalisées d'actifs financiers sont comptabilisés à la date de transaction. Les placements et les dérivés des Fonds sont évalués à la JVRN. L'obligation des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables est présentée au montant du rachat. Tous les autres actifs et passifs financiers sont évalués au coût amorti. Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer. Les méthodes comptables utilisées par les Fonds pour l'évaluation de la juste valeur des placements et des dérivés sont conformes à celles utilisées pour évaluer la valeur liquidative aux fins des opérations avec les porteurs de parts.

Les actifs financiers et les passifs financiers sont compensés et le solde net est présenté dans l'état de la situation financière lorsqu'il existe un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et que l'intention est exprimée, soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément.

b) Évaluation des placements

La juste valeur s'entend du prix qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre intervenants du marché à la date d'évaluation. Les obligations, débentures et autres titres de créance (autres que les placements à court terme) sont évalués à la moyenne du cours acheteur-vendeur fourni par des courtiers en placement reconnus à la date d'évaluation au moment jugé approprié, au gré du fiduciaire. Les placements à court terme sont évalués au coût amorti qui se rapproche de leur juste valeur en raison de leur échéance à court terme. La valeur des titres, des contrats à terme sur indice boursier et des options sur indice boursier qui sont inscrits à la cote d'une Bourse reconnue est établie au dernier cours négocié à la date d'évaluation, tel qu'il est publié dans un rapport d'usage courant ou autorisé comme étant officiel par une Bourse de valeurs reconnue, lorsque le dernier cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Si une telle Bourse de valeurs n'est pas ouverte ce jour-là, la valeur repose sur les cours qui ont été établis le dernier jour où une telle Bourse a été ouverte. Tout titre ou actif pour lequel aucun cours n'est facilement disponible est évalué à sa juste valeur de marché déterminée par le fiduciaire. Lorsque le dernier cours négocié ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des faits et circonstances en cause.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

La politique des Fonds consiste à comptabiliser les transferts d'un niveau à l'autre de la hiérarchie des justes valeurs à la fin de chaque période de présentation de l'information financière pour les transferts entre les niveaux 1 et 2 et à la date du transfert pour les transferts dans le niveau 3 ou hors de celui-ci.

c) Opérations sur titres et revenu

Les opérations sur titres sont comptabilisées à la date de transaction. Les profits et pertes réalisés sur les opérations de placement sont calculés selon le coût moyen. Le revenu de dividendes est comptabilisé à la date ex-dividende et le revenu d'intérêts aux fins de distribution est comptabilisé selon la méthode de la comptabilité d'engagement au taux d'intérêt nominal des obligations.

d) Autres actifs et passifs

Tous les montants à recevoir et à payer sont comptabilisés au coût ou au coût amorti. Le coût ou le coût amorti se rapproche de la juste valeur de ces actifs et passifs en raison de leur échéance à court terme.

e) Conversion des devises

Sauf en ce qui trait aux Fonds présentés ci-dessous, les souscriptions et les rachats des Fonds sont libellés en dollars canadiens, monnaie qui est également leur monnaie fonctionnelle et de présentation.

	<u>Monnaie fonctionnelle</u>	<u>Monnaie de présentation</u>
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus	\$ US	\$ US
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus	\$ US	\$ US

La juste valeur des placements et des autres actifs et passifs libellés en monnaies étrangères est convertie dans la monnaie de présentation des Fonds au taux de change de clôture, chaque date d'évaluation. Les achats et les ventes de placements, de même que les revenus et les charges, sont convertis au taux de change en vigueur à la date des opérations respective. Les profits et pertes réalisés et les variations des profits et pertes latents à la conversion des devises sont compris dans les états du résultat global.

f) Coûts de transaction

Les coûts de transaction, comme les commissions de courtage, engagés dans l'achat et la vente de titres sont comptabilisés à titre de charge aux états du résultat global.

g) Profit latent ou perte latente sur les placements

Le montant de la variation, au cours de la période, de la juste valeur des placements détenus à la date d'évaluation est présenté dans les états financiers à titre de variation du profit latent ou de la perte latente sur les placements.

h) Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque série pour la période par le nombre moyen pondéré de parts en circulation de cette série au cours de la période.

3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

Lorsqu'elle prépare les états financiers, la direction doit faire appel à son jugement pour appliquer les méthodes comptables et établir des estimations et des hypothèses quant à l'avenir. Les paragraphes suivants présentent une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation des états financiers.

a) Évaluation de la juste valeur des dérivés et des titres non cotés sur un marché actif

La juste valeur des instruments non cotés sur un marché actif est déterminée au moyen de techniques d'évaluation et peut être établie en ayant recours à des sources réputées en matière d'évaluation des prix (par exemple, des services d'établissement des prix) ou des indications de prix fournies par les teneurs de marché. Les cours des courtiers obtenus par l'intermédiaire de ces sources peuvent constituer des indications et ne pas être contraignants et exécutoires. En l'absence de données de marché, les Fonds peuvent évaluer leurs positions au moyen de modèles qui reposent généralement sur des méthodes et techniques d'évaluation généralement reconnues comme la norme dans le secteur d'activité. Les modèles utilisés pour déterminer la juste valeur sont validés et sont examinés périodiquement par du personnel expérimenté du gestionnaire, indépendant de la partie qui les a créés. Les modèles utilisés pour les actions d'entités non cotées reposent principalement sur des multiples du bénéfice ajustés pour tenir compte de l'absence de liquidité, s'il y a lieu.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Dans la mesure du possible, les modèles font appel à des données observables. Néanmoins, le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre que le risque de crédit lié à la contrepartie), les volatilités et les corrélations. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers. Les Fonds considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question. Se reporter à la note 4 pour de plus amples renseignements sur l'évaluation de la juste valeur des instruments financiers des Fonds.

b) IFRS 10 – Statut d'entité d'investissement

Les Fonds n'ont pas consolidé leurs résultats financiers avec ceux des sociétés sous-jacentes détenues comme placements étant donné que les Fonds sont considérés comme des entités d'investissement. Les exigences des alinéas (a) à (c) du paragraphe 27 de l'IFRS 10 à l'égard des entités d'investissement sont respectées, car des fonds sont obtenus de nombreux investisseurs; les objectifs d'affaires des Fonds sont de réaliser des rendements sous forme de plus-value des placements sous-jacents; et les rendements des placements sont évalués sur la base de la juste valeur.

c) IFRS 12 – Intérêts détenus dans d'autres entités

Les Fonds peuvent investir dans d'autres fonds dans le cadre de leur stratégie de placement globale. Les paragraphes 19A à 19G de l'IFRS 12 exigent que des renseignements additionnels soient fournis pour les entités d'investissement qui ont des intérêts dans des filiales non consolidées. Une filiale est une entité qui est contrôlée par une autre entité. Les Fonds n'ont pas de contrôle sur les fonds sous-jacents étant donné qu'aucun accord contractuel n'a été conclu entre eux et que, par conséquent, ils ne détiennent aucun pouvoir sur l'entité émettrice. De plus, les Fonds n'ont pas la capacité d'exercer leur pouvoir sur les fonds sous-jacents de manière à influencer sur le montant des rendements qu'ils obtiennent. Ainsi, la définition du contrôle, tel qu'il est défini au paragraphe 7 de l'IFRS 10, n'est pas respectée, si bien que les Fonds ne sont pas tenus de fournir de l'information additionnelle. Une entité structurée est une entité conçue de telle manière que les droits de vote ou droits similaires ne constituent pas le facteur déterminant pour établir qui contrôle l'entité; c'est notamment le cas lorsque les droits de vote concernent uniquement des tâches administratives et que les activités pertinentes sont dirigées au moyen d'accords contractuels. Les informations concernant les intérêts du Fonds dans des entités structurées non consolidées sont présentées à la note 10.

4. PRÉSENTATION DE LA JUSTE VALEUR

La hiérarchie des justes valeurs accorde la priorité la plus élevée aux prix non ajustés cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques (évaluation de niveau 1) et la priorité la plus faible aux données non observables (évaluation de niveau 3). Les trois niveaux de la hiérarchie des justes valeurs sont les suivants :

Niveau 1 – Données d'entrée qui reflètent les cours non ajustés dans un marché actif pour des actifs et passifs identiques auxquels le gestionnaire a accès à la date d'évaluation.

Niveau 2 – Données d'entrée autres que les cours de marché qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement, y compris les données d'entrée sur les marchés qui ne sont pas jugés actifs.

Niveau 3 – Données d'entrée qui ne sont pas observables. Il y a peu d'activité sur les marchés, sinon aucune. Les données d'entrée utilisées dans la détermination de la juste valeur exigent des estimations ou des jugements importants de la part de la direction.

Les évaluations de la juste valeur sont toutes récurrentes. La juste valeur est classée au niveau 1 lorsque le titre ou le dérivé connexe est négocié activement et que le cours est disponible. Un instrument classé au niveau 1 qui cesse ultérieurement d'être négocié activement est sorti du niveau 1. Dans ces cas, les instruments sont reclassés au niveau 2, sauf si l'évaluation de la juste valeur fait intervenir des données d'entrée non observables importantes, auquel cas, ils sont classés au niveau 3.

a) Actions

Les positions en actions des Fonds sont classées au niveau 1 lorsque le titre est négocié activement et qu'un prix fiable est observable. Certaines actions du Fonds ne sont pas négociées fréquemment, si bien qu'aucun prix observable n'est disponible. Dans ces cas, la juste valeur est établie au moyen de données de marché observables (p. ex., des opérations sur des titres similaires du même émetteur) et la juste valeur est classée au niveau 2, à moins que l'évaluation de la juste valeur ne nécessite l'utilisation de données non observables importantes, auquel cas, elle est classée au niveau 3.

b) Obligations, débiteures convertibles et placements à court terme

Les billets à court terme et les bons du Trésor sont présentés au coût amorti, qui se rapproche de la juste valeur. Les obligations et les débiteures convertibles sont évaluées à la moyenne du cours acheteur-vendeur fourni par des courtiers en valeurs reconnus. Par conséquent, les données d'entrée sont généralement observables et leur juste valeur est classée au niveau 2, à moins que la détermination de la juste valeur fasse intervenir des données non observables importantes, auquel cas la juste valeur est classée au niveau 3.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

c) Fonds de placement

Les placements dans d'autres fonds de placement sont évalués à la valeur liquidative publiée de ces fonds. La juste valeur est classée au niveau 1 lorsque la valeur liquidative quotidienne est connue sur le marché. Sinon, la juste valeur est classée au niveau 2, à moins que la détermination de la valeur liquidative ne nécessite l'utilisation de données non observables importantes, auquel cas elle est classée au niveau 3.

d) Titres adossés à des créances hypothécaires

Les titres adossés à des créances hypothécaires sont évalués à la moyenne du cours acheteur-vendeur fourni par des courtiers en valeurs reconnus, et la juste valeur est classée au niveau 2. Lorsque la détermination de la juste valeur de titres adossés à des créances hypothécaires nécessite l'utilisation de données non observables importantes, elle est classée au niveau 3.

e) Contrats à terme standardisés

Les contrats à terme standardisés sont évalués au moyen des données d'entrée provenant de marchés qui ne sont pas jugés actifs. Ils sont donc classés au niveau 2 et sont réévalués à la valeur de marché, chaque date d'évaluation, selon le profit ou la perte qui aurait été réalisé(e) si les contrats avaient été liquidés.

f) Contrats de change à terme

Les contrats de change à terme sont évalués compte tenu principalement du montant notionnel du contrat et de la différence entre le taux du contrat et le taux du marché à terme pour la même devise, et sont classés au niveau 2.

g) Bons de souscription et droits

Les bons de souscription et les droits sont classés au niveau 1 lorsque les titres sont négociés activement et qu'un prix fiable est observable. Ils sont classés au niveau 2 lorsqu'ils ne sont pas négociés en Bourse ou qu'aucune valeur de marché n'est facilement disponible, mais que des données d'entrée suffisantes et fiables sont observables sur le marché et qu'une technique d'évaluation est utilisée.

Les tableaux suivants présentent, selon la hiérarchie des justes valeurs, les actifs des Fonds évalués à la juste valeur de manière récurrente aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Au 30 juin 2019

	Actifs financiers à la juste valeur au 30 juin 2019			Total
	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	
	\$	\$	\$	\$
Fonds d'obligations gouvernementales Genus				
Obligations	-	128 437 547	-	128 437 547
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	4 630 735	-	4 630 735
Billets à court terme	-	8 080 481	-	8 080 481
	-	141 148 763	-	141 148 763
Fonds d'obligations à court terme Genus				
Obligations	-	28 092 344	-	28 092 344
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	1 425 390	-	1 425 390
Billets à court terme	-	119 519	-	119 519
	-	29 637 253	-	29 637 253
Fonds d'actions à dividendes Genus				
Actions	274 386 093	-	-	274 386 093
Droits	192 311	-	-	192 311
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	74 743	-	-	74 743
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(239 318)	-	-	(239 318)
	274 413 829	-	-	274 413 829
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus				
Obligations	-	50 673 185	-	50 673 185
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	679 822	-	679 822
	-	51 353 007	-	51 353 007
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus				
Actions	67 891 809	-	-	67 891 809
Droits	48 876	-	-	48 876
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	12 642	-	-	12 642
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(50 196)	-	-	(50 196)
	67 903 131	-	-	67 903 131
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)				
Actions	48 300 042	-	-	48 300 042
Droits	37 088	-	-	37 088
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	28 234	-	-	28 234
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(24 428)	-	-	(24 428)
	48 340 936	-	-	48 340 936
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)				
Actions	23 240 889	845 853	-	24 086 742
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	22 769	-	-	22 769
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(19 938)	-	-	(19 938)
	23 243 720	845 853	-	24 089 573

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Au 31 décembre 2018

	Actifs financiers à la juste valeur au 31 décembre 2018			
	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	\$	\$	\$	\$
Fonds d'obligations gouvernementales Genus				
Obligations	-	55 056 809	-	55 056 809
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	3 784 454	-	3 784 454
	-	58 841 263	-	58 841 263
Fonds d'obligations à court terme Genus				
Obligations	-	50 459 803	-	50 459 803
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	2 743 055	-	2 743 055
Billets à court terme	-	249 046	-	249 046
	-	53 451 904	-	53 451 904
Fonds d'actions à dividendes Genus				
Actions	237 990 294	-	-	237 990 294
Droits	73 757	-	-	73 757
Billets à court terme	-	1 398 712	-	1 398 712
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	134 057	-	-	134 057
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(173 841)	-	-	(173 841)
	238 024 267	1 398 712	-	239 422 979
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus				
Obligations	-	42 793 125	-	42 793 125
Titres adossés à des créances hypothécaires	-	650 574	-	650 574
	-	43 443 699	-	43 443 699
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus				
Actions	54 887 092	-	-	54 887 092
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	55 716	-	-	55 716
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(57 199)	-	-	(57 199)
	54 885 609	-	-	54 885 609
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)				
Actions	40 024 127	-	-	40 024 127
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	18 310	-	-	18 310
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(28 213)	-	-	(28 213)
	40 014 224	-	-	40 014 224
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)				
Actions	20 923 621	-	-	20 923 621
Actifs dérivés - contrats à terme standardisés	12 677	-	-	12 677
Passifs dérivés - contrats à terme standardisés	(36 545)	-	-	(36 545)
	20 899 753	-	-	20 899 753

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Le tableau qui suit présente un rapprochement des évaluations à la juste valeur classées au niveau 3.

Fonds d'obligations gouvernementales Genus	Période close le 30 juin 2019 (\$)	Période close le 31 décembre 2018 (\$)
Juste valeur au début de la période	-	257 548
Achat de placements	-	-
Vente de placements	-	(1 258)
Profit net réalisé	-	11
Variation nette du profit latent (de la perte latente)	-	(3 203)
Transferts dans le niveau 3	-	-
Transferts hors du niveau 3 vers le niveau 2	-	(253 098)
Juste valeur à la fin de la période	-	-

Un titre adossé à des créances hypothécaires a été classé initialement au niveau 3 au 31 décembre 2017. Par la suite, la direction a déterminé que pour ce titre adossé à des créances hypothécaires, il existait des données observables autres que les cours de marché, et qu'il devrait être transféré du niveau 3 au niveau 2 au 31 décembre 2018.

Fonds d'obligations à court terme Genus	Période close le 30 juin 2019 (\$)	Période close le 31 décembre 2018 (\$)
Juste valeur au début de la période	-	2 585 388
Achat de placements	-	-
Vente de placements	-	(12 633)
Profit net réalisé	-	113
Variation nette du profit latent (de la perte latente)	-	(32 155)
Transferts dans le niveau 3	-	-
Transferts hors du niveau 3 au niveau 2	-	(2 540 713)
Juste valeur à la fin de la période	-	-

Un titre adossé à des créances hypothécaires a été classé initialement au niveau 3 au 31 décembre 2017. Par la suite, la direction a déterminé que pour ce titre adossé à des créances hypothécaires, il y avait des données observables autres que les cours de marché, et qu'il devrait être transféré du niveau 3 au niveau 2 au 31 décembre 2018.

5. PARTS RACHETABLES EN CIRCULATION

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts rachetables qui sont de rang égal à tous égards et représentent une participation proportionnelle dans l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables.

Les parts rachetables des Fonds sont classées à titre de passifs financiers dans l'état de la situation financière étant donné que les Fonds ont l'obligation de distribuer leur revenu afin de réduire les impôts au minimum, si bien qu'ils ne peuvent éviter les distributions en trésorerie et que les parts ont une option de rachat en cours, le tout ne respectant pas les critères de l'alinéa d) du paragraphe 16A de l'IAS 32, permettant de les classer à titre de capitaux propres.

Les parts de série O sont offertes par voie de placement privé. Les parts de série F sont offertes aux investisseurs qui ont un compte à honoraires forfaitaires auprès de leur courtier. Au 30 juin 2019, aucune part de série F n'était émise ou en circulation.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Les variations des parts de série O rachetables en circulation des Fonds pour les périodes closes les 30 juin 2019 et 31 décembre 2018 se présentent comme suit :

	Fonds d'obligations gouvernementales Genus (parts)	Fonds d'obligations à court terme Genus (parts)	Fonds d'actions à dividendes Genus (parts)	Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus (parts)
<i>Période close le 30 juin 2019</i>				
Parts en circulation, début de la période	524 793	680 223	1 974 850	434 153
Émission de parts	721 389	77 743	157 928	104 712
Rachat de parts	(50 046)	(391 577)	(126 981)	(53 571)
Parts réinvesties	6 704	3 532	20 597	6 293
Parts en circulation, fin de la période	1 202 840	369 221	2 026 394	491 587
<i>Exercice clos le 31 décembre 2018</i>				
Parts en circulation, début de l'exercice	429 094	552 252	1 756 020	474 857
Émission de parts	243 324	523 266	278 486	39 902
Rachat de parts	(154 382)	(404 416)	(139 524)	(92 273)
Parts réinvesties	6 757	9 121	79 868	11 667
Parts en circulation, fin de l'exercice	524 793	680 223	1 974 850	434 153

	Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus (parts)	Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (parts)	Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (parts)
<i>Période close le 30 juin 2019</i>			
Parts en circulation, début de la période	638 413	614 566	248 771
Émission de parts	143 650	94 137	26 312
Rachat de parts	(48 980)	(72 353)	(28 267)
Parts réinvesties	9 241	-	-
Parts en circulation, fin de la période	742 324	636 350	246 816
<i>Exercice clos le 31 décembre 2018</i>			
Parts en circulation, début de l'exercice	622 412	676 235	229 449
Émission de parts	112 742	106 668	41 451
Rachat de parts	(129 435)	(216 006)	(45 102)
Parts réinvesties	32 694	47 669	22 973
Parts en circulation, fin de l'exercice	638 413	614 566	248 771

6. MODIFICATIONS APPORTÉES AUX FONDS

Le 23 octobre 2017, les Fonds sont devenus des émetteurs assujettis.

7. IMPÔTS SUR LE REVENU

Aux 31 décembre 2018 et 2017, les Fonds étaient admissibles à titre de fiducies de fonds communs de placement ou de fiducies d'investissement à participation unitaire au sens de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada). Les Fonds qui sont admissibles à titre de fiducies de fonds communs de placement distribuent à leurs porteurs de parts la totalité de leur revenu annuel imposable, y compris la part imposable du montant net de leurs gains en capital réalisés, ce qui leur permet de ne pas avoir à verser d'impôt. Les Fonds qui ne sont pas admissibles à titre de fiducies de fonds communs de placement distribuent à leurs porteurs de parts la totalité de leur revenu annuel imposable, y compris le montant net imposable de leurs gains en capital réalisés, ce qui permet à ces Fonds de ne pas avoir à verser d'impôt. Ces revenus sont imposables entre les mains des porteurs de parts et non dans les Fonds. Aucune provision pour impôt canadien sur le revenu n'a donc été établie dans les présents états financiers. Les pertes en capital peuvent être reportées en avant indéfiniment et déduites des gains en capital réalisés dans l'avenir.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Les Fonds peuvent être amenés à payer des impôts sur le revenu ou sur les gains réalisés sur des investissements aux États-Unis et dans d'autres pays. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôt s'y rattachant sont présentées distinctement dans les états du résultat global.

Aux 31 décembre, les types de fiducies et les pertes en capital des Fonds pouvant être reportées en avant se présentaient comme suit :

	Type de fiducies	Pertes en capital reportées en avant	
		2018	2017
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	Fonds commun de placement	445 529 \$	148 435 \$
Fonds d'obligations à court terme Genus	Fonds commun de placement	6 524 223 \$	5 049 277 \$
Fonds d'actions à dividendes Genus	Fonds commun de placement	-	-
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	Fonds commun de placement	446 627 \$	-
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	Fonds commun de placement	-	-
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus	Fonds commun de placement	- \$ US	- \$ US
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus	Fonds commun de placement	- \$ US	- \$ US

8. CHARGES

Chaque Fonds engage des frais qui peuvent précisément lui être attribués. Les charges communes des Fonds sont réparties proportionnellement entre les Fonds. Le gestionnaire offre des services de placement et des services-conseils ou prend des dispositions pour la prestation de ces services.

Relativement aux parts de série F, les Fonds suivants versent les pourcentages de frais de gestion annuels avant la TPS/TVH applicable comme suit :

	Frais de gestion
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	0,49 %
Fonds d'obligations à court terme Genus	0,49 %
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	0,49 %
Fonds d'actions à dividendes Genus	0,65 %
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	0,65 %
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus	0,65 %
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus	0,65 %

Au cours des périodes closes les 30 juin 2019 et 2018, aucuns frais de gestion n'ont été versés au gestionnaire relativement aux parts de série F, car aucune part de série F n'avait été distribuée.

Aucuns frais de gestion ne sont versés par le Fonds en lien avec les parts de série O. Le porteur de parts de série O verse au gestionnaire des frais de gestion négociés hors du Fonds.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

a) Coûts de transaction

Le tableau suivant présente un sommaire des coûts de transaction du Fonds, y compris les commissions de courtage, compte tenu des transactions effectuées dans le portefeuille pour la période close et l'exercice clos les :

Fonds d'actions à dividendes Genus

	30 juin 2019		31 décembre 2018	
	\$	%	\$	%
Total des coûts de transaction	320 948	100	681 169	100
Accords relatifs aux courtages†	148 258	46	384 475	56

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

	30 juin 2019		31 décembre 2018	
	\$	%	\$	%
Total des coûts de transaction	91 317	100	186 852	100
Accords relatifs aux courtages†	40 477	44	110 755	59

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)

	30 juin 2019		31 décembre 2018	
	\$	%	\$	%
Total des coûts de transaction	56 559	100	130 743	100
Accords relatifs aux courtages†	36 944	65	77 330	59

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)

	30 juin 2019		31 décembre 2018	
	\$	%	\$	%
Total des coûts de transaction	22 428	100	55 114	100
Accords relatifs aux courtages†	8 021	36	25 313	46

† Les accords relatifs aux courtages font partie de la commission versée aux courtiers.

Le Fonds a recours à des accords relatifs aux courtages (auparavant connus sous le nom de « rabais de courtage ») pour les biens et services relatifs à la recherche ou les biens et services relatifs à l'exécution d'ordres reçus.

9. GESTION DES RISQUES FINANCIERS

En raison de leurs activités de placement, les Fonds sont exposés à divers risques financiers. Les risques importants qui concernent les Fonds sont décrits ci-dessous.

a) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt découle des instruments financiers portant intérêt, comme les titres de créance de gouvernements et les titres de créance de sociétés. Les Fonds détenant ces titres de créance sont exposés au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt varie par suite de la fluctuation des taux d'intérêt du marché pour ces titres.

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Le tableau qui suit présente les risques de taux d'intérêt selon la durée restante jusqu'à l'échéance pour les Fonds qui détiennent des placements sensibles aux taux d'intérêt :

Au 30 juin 2019	Moins de	De 1 an à	De 3 ans à	Plus de	Total
	1 an	3 ans	5 ans	5 ans	
	\$	\$	\$	\$	\$
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	63 419 234	9 868 202	15 640 732	52 220 595	141 148 763
Fonds d'obligations à court terme Genus	1 044 533	10 657 243	12 691 993	5 243 484	29 637 253
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	-	-	8 144 231	43 208 776	51 353 007

Au 31 décembre 2018	Moins de	De 1 an à	De 3 ans à	Plus de	Total
	1 an	3 ans	5 ans	5 ans	
	\$	\$	\$	\$	\$
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	1 540 553	20 961 090	9 309 063	27 030 557	58 841 263
Fonds d'obligations à court terme Genus	249 046	20 997 933	22 155 335	10 049 590	53 451 904
Fonds d'actions à dividendes Genus	1 398 712	-	-	-	1 398 712
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	377 217	-	3 952 645	39 113 837	43 443 699

Aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018, si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe de rendement, toute autre variable demeurant constante, la valeur liquidative des Fonds exposés au risque de taux d'intérêt aurait diminué ou augmenté approximativement des valeurs présentées dans le tableau qui suit. La sensibilité des Fonds aux variations des taux d'intérêt a été estimée au moyen de la durée moyenne pondérée du portefeuille. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer et l'écart peut être important.

30 juin 2019

Hausse (-) ou baisse (+) des taux d'intérêt

	\$	% de la valeur liquidative
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	+ ou - 7 164 744	+ ou - 5,1 %
Fonds d'obligations à court terme Genus	+ ou - 872 404	+ ou - 2,9 %
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	+ ou - 3 244 738	+ ou - 6,2 %

31 décembre 2018

Hausse (-) ou baisse (+) des taux d'intérêt

	\$	% de la valeur liquidative
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	+ ou - 3 588 231	+ ou - 6,1 %
Fonds d'obligations à court terme Genus	+ ou - 1 611 505	+ ou - 2,9 %
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	+ ou - 2 707 695	+ ou - 6,2 %

b) Risque de change

Le risque de change est le risque que la valeur des instruments financiers détenus par le Fonds qui sont libellés dans des monnaies autres que la monnaie de présentation du Fonds varie en raison des fluctuations des taux de change. Le tableau ci-dessous présente le risque de change auquel les Fonds qui détiennent des actifs libellés en monnaies autres que la monnaie de présentation étaient exposés aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018.

30 juin 2019	Dollar	Dollar	Livre	Euro	Dollar	Yen	Autres	Total
	américain	canadien	sterling		australien	japonais		
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	701	-	-	-	-	-	-	701
Fonds d'obligations à court terme Genus	709	-	-	-	-	-	-	709
Fonds d'actions à dividendes Genus	108 641 756	-	12 598 870	30 549 962	5 313 351	6 685 913	7 998 800	171 788 652
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	562	-	-	-	-	-	-	562
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	26 834 488	-	1 631 147	6 081 468	744 216	5 459 907	3 212 965	43 964 191
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	-	19 885 572	913 319	3 050 942	693 067	1 524 865	523 837	26 591 602
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	-	1 720 023	2 371 099	3 178 403	135	1 527 844	2 789 681	11 587 185

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

31 décembre 2018	Dollar américain	Dollar canadien	Livre sterling	Euro	Dollar australien	Yen japonais	Autres	Total
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	635	-	-	-	-	-	-	635
Fonds d'obligations à court terme Genus	741	-	-	-	-	-	-	741
Fonds d'actions à dividendes Genus	111 399 202	-	5 433 694	19 144 079	4 704 928	15 649 061	20 308 412	176 639 376
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	588	-	-	-	-	-	-	588
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	23 300 840	-	640 093	6 149 563	974 449	4 562 831	3 874 989	39 502 765
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	-	15 276 093	2 061 904	3 229 408	302	2 286 230	581 531	23 435 468
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	-	1 458 446	2 178 466	2 773 120	135	2 467 472	2 361 948	11 239 587

Aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018, si la monnaie de présentation s'était raffermie ou affaiblie de 5 % par rapport à toutes les monnaies étrangères, tous les autres facteurs demeurant constants, la valeur liquidative aurait augmenté ou diminué approximativement des valeurs présentées dans le tableau qui suit. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité, et l'écart peut être important.

	30 juin 2019 Appréciation (-) ou dépréciation (+) de 5 %	31 décembre 2018 Appréciation (-) ou dépréciation (+) de 5 %
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	+ ou - 35	+ ou - 32
Fonds d'obligations à court terme Genus	+ ou - 35	+ ou - 37
Fonds d'actions à dividendes Genus	+ ou - 8 589 433	+ ou - 8 831 969
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	+ ou - 28	+ ou - 29
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	+ ou - 2 198 210	+ ou - 1 975 138
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	+ ou - 1 329 580	+ ou - 1 171 773
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	+ ou - 579 359	+ ou - 561 979

c) Autre risque de prix

L'autre risque de prix s'entend du risque que la valeur des instruments financiers fluctue par suite de variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou de change), que ces variations soient causées par des facteurs propres à un placement particulier, à son émetteur, ou à tous les autres facteurs influant sur tous les instruments négociés dans un secteur ou un sous-secteur. Tous les titres présentent un risque de perte en capital.

Le tableau ci-dessous présente l'exposition à l'autre risque de prix des Fonds qui détiennent des instruments de placement en raison des fluctuations des titres sur le marché général aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018. Le tableau présente aussi l'incidence sur la valeur liquidative des Fonds d'une augmentation ou d'une diminution de 5 % sur le marché boursier.

30 juin 2019	Exposition à l'autre risque de prix	% de la valeur liquidative	Incidence d'une hausse (+) ou d'une baisse (-) de 5 %
	\$		\$
Fonds d'actions à dividendes Genus	274 578 404	96,3	+ ou - 13 728 920
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	67 940 685	93,8	+ ou - 3 397 034
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	48 337 130	96,6	+ ou - 2 416 857
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	24 086 741	96,4	+ ou - 1 204 337

31 décembre 2018	Exposition à l'autre risque de prix	% de la valeur liquidative	Incidence d'une hausse (+) ou d'une baisse (-) de 5 %
	\$		\$
Fonds d'actions à dividendes Genus	238 064 051	90,6	+ ou - 11 903 203
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	54 887 092	90,5	+ ou - 2 744 355
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	40 024 127	95,2	+ ou - 2 001 206
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	20 923 621	94,9	+ ou - 1 046 181

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

d) Risque de crédit

Le risque de crédit s'entend du risque qu'une partie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement qu'elle a conclu avec un fonds. Le risque de crédit se concentre essentiellement dans les titres de créance. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur. La valeur comptable des placements telle qu'elle est présentée dans l'inventaire du portefeuille correspond à l'exposition maximale au risque de crédit. La valeur comptable des autres actifs des Fonds représente également le risque de crédit maximal puisqu'ils seront réglés à court terme.

Toutes les opérations visant des titres cotés sont réglées ou payées à la livraison, en faisant appel à des courtiers approuvés. Le risque de défaillance est jugé minimal, étant donné que la livraison des titres vendus n'a lieu qu'à la suite de la réception du paiement par le courtier. L'opération échoue si une des parties ne remplit pas son obligation.

Les notations sont obtenues principalement auprès de Standard & Poor's (« S&P »). Lorsque la note de S&P n'est pas disponible, la note fournie par DBRS est utilisée et convertie au format de S&P. Lorsque ni la note de S&P, ni la note de DBRS ne sont disponibles, la note fournie par Moody's est utilisée et convertie au format de S&P. Aux 30 juin 2019 et 31 décembre 2018, les Fonds investissaient dans des titres de créances affichant les notes suivantes :

	AAA	AA	A	BBB	Sans notation	Total
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
30 juin 2019						
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	60 571 454	24 119 548	56 457 761	-	-	141 148 763
Fonds d'obligations à court terme Genus	3 918 704	6 941 854	12 855 822	5 920 873	-	29 637 253
Fonds d'actions à dividendes Genus	-	2 510 178	-	-	-	2 510 178
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	1 001 145	5 519 344	23 499 088	21 333 430	-	51 353 007
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	-	109 918	-	-	-	109 918
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	-	683 258	-	-	-	683 258
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	-	353 096	-	-	-	353 096

	AAA	AA	A	BBB	Sans notation	Total
	\$	\$	\$	\$	\$	\$
31 décembre 2018						
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	18 402 237	14 433 602	22 480 966	-	3 524 458	58 841 263
Fonds d'obligations à court terme Genus	7 574 828	13 196 193	22 131 076	9 420 327	1 129 480	53 451 904
Fonds d'actions à dividendes Genus	-	3 484 459	-	-	-	3 484 459
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	1 158 031	6 069 356	17 424 655	18 791 657	-	43 443 699
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	-	202 275	-	-	-	202 275
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	-	709 244	-	-	-	709 244
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	-	403 665	-	-	-	403 665

e) Risque d'illiquidité

Le risque d'illiquidité s'entend du risque que les Fonds ne soient pas en mesure de satisfaire à leurs obligations en temps opportun ou à un prix raisonnable. Les placements des Fonds étant considérés comme facilement négociables et très liquides, le risque de liquidité des Fonds est considéré comme minime.

f) Risque de concentration

Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie, que ce soit un emplacement géographique, un type de produit, un secteur d'activité ou un type de contrepartie. Le tableau suivant présente le risque de concentration exprimé en pourcentage du total des placements :

Fonds d'obligations gouvernementales Genus

	30 juin 2019	31 décembre 2018
Secteur	(%)	(%)
Obligations canadiennes		
Obligations fédérales	35,1	26,1
Obligations provinciales	53,3	59,5
Obligations municipales	1,7	6,1
Obligations de sociétés	0,8	1,8
Titres adossés à des créances hypothécaires	3,3	6,5
Placements à court terme	5,8	-
Total	100,0	100,0

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Fonds d'obligations à court terme Genus

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Obligations canadiennes		
Obligations fédérales	5,6	9,1
Obligations provinciales	26,0	23,9
Obligations de sociétés	62,8	60,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	4,8	5,1
Obligations étrangères	0,4	0,8
Placements à court terme	0,4	0,5
Total	100,0	100,0

Fonds d'actions à dividendes Genus

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Actions		
Énergie	11,2	11,8
Matières premières	4,6	1,4
Industries	3,5	5,5
Biens de consommation discrétionnaire	5,8	2,5
Biens de consommation de base	7,9	6,8
Soins de santé	7,6	9,9
Services financiers	23,2	21,4
Immobilier	9,9	9,8
Technologies de l'information	2,7	3,8
Services de communication	12,1	13,0
Services publics	11,5	13,5
Placements à court terme	-	0,6
Total	100,0	100,0

Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Obligations canadiennes		
Obligations fédérales	0,6	1,2
Obligations provinciales	3,2	1,7
Obligations de sociétés	92,8	91,1
Titres adossés à des actifs	1,3	1,5
Obligations étrangères	2,1	4,5
Total	100,0	100,0

Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Actions		
Matières premières	2,9	2,8
Industries	6,7	4,0
Biens de consommation discrétionnaire	6,8	5,6
Biens de consommation de base	7,2	13,8
Soins de santé	14,8	10,9
Services financiers	31,0	27,8
Immobilier	11,0	11,5
Technologies de l'information	6,5	7,5
Services de communication	10,8	16,1
Services publics	2,3	-
Total	100,0	100,0

Service de portefeuille diversifié stratégique de Genus Capital Management

Notes des états financiers

30 juin 2019 (non audité)

Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Actions		
Matières premières	8,5	4,6
Industries	10,7	7,1
Biens de consommation discrétionnaire	9,9	9,2
Biens de consommation de base	4,0	6,4
Soins de santé	8,3	14,2
Services financiers	23,6	25,4
Immobilier	6,6	7,3
Technologies de l'information	15,9	12,7
Services de communication	12,5	13,1
Total	100,0	100,0

Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)

Secteur	30 juin 2019	31 décembre 2018
	(%)	(%)
Actions		
Matières premières	8,3	8,8
Industries	19,4	18,6
Services de communications	1,6	8,3
Biens de consommation discrétionnaire	5,2	4,9
Biens de consommation de base	7,6	6,2
Soins de santé	19,1	14,6
Immobilier	12,0	12,6
Technologies de l'information	23,7	23,9
Services publics	3,1	2,1
Total	100,0	100,0

10. PARTIES LIÉES

Le gestionnaire, les administrateurs et les membres de leur famille, et les employés des Fonds détiennent des placements dans les Fonds comme suit :

	30 juin 2019		31 décembre 2018	
	Parts	Valeur	Parts	Valeur
		marchande		marchande
		\$		\$
Fonds d'obligations gouvernementales Genus	15 406	1 819 266	2 013	229 265
Fonds d'obligations à court terme Genus	1 401	115 180	8 762	708 435
Fonds d'actions à dividendes Genus	42 073	5 920 795	39 804	5 294 887
Fonds d'obligations de sociétés zéro fossile Genus	717	76 261	590	59 550
Fonds d'actions à dividendes zéro fossile Genus	2 560	249 877	2 537	241 000
Fonds d'actions CanMonde zéro fossile Genus (en \$ US)	2 114	166 218	2 468	168 756
Fonds d'actions incidence élevée zéro fossile Genus (en \$ US)	2 426	245 536	2 269	201 149