

HELIUM FUND

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)
Investment Company with Variable Capital (SICAV)

**Rapport semestriel, incluant les états financiers non audités
au 30/06/24**
***Semi-annual report, including Unaudited Financial Statements
as at 30/06/24***

R.C.S. Luxembourg B 176 451

HELIUM FUND

Table des Matières/*Table of contents*

| | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| Organisation et administration | 3 |
| <i>Organisation and administration</i> | 3 |
| Informations générales | 4 |
| <i>General information</i> | 4 |
| Etat combiné des actifs nets au 30/06/24 | 7 |
| <i>Combined statement of net assets as at 30/06/24</i> | 7 |
| Etat combiné des opérations et des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30/06/24 | 8 |
| <i>Combined statement of operations and changes in net assets for the period ended 30/06/24</i> | 8 |
| Compartiments : | 9 |
| <i>Sub-funds:</i> | 9 |
| HELIUM FUND - Helium Fund | 9 |
| HELIUM FUND - Helium Performance | 19 |
| HELIUM FUND - Helium Selection | 29 |
| HELIUM FUND - Helium Invest | 39 |
| Notes aux états financiers | 47 |
| <i>Notes to the financial statements</i> | 47 |

Aucune souscription ne peut être enregistrée sur le seul fondement des états financiers. Pour être recevable, une souscription doit être effectuée sur base du prospectus en vigueur accompagné du dernier rapport annuel, incluant les états financiers audités et du dernier rapport semi-annuel, si celui-ci est plus récent que le rapport annuel, incluant les états financiers audités et du document d'information clé pour l'investisseur. Les performances historiques des compartiments sont annexées aux documents d'information clé (« DIC »)./No subscription can be accepted on the basis of financial reports. Subscriptions are only valid if made on the basis of the current prospectus accompanied by the latest annual report, including audited financial statements as well as by the latest semi-annual report, if published after the latest annual report, including audited financial statements and the key investor information document. Past performances of the Sub-Funds are appended to the key information document (« KID »).

HELIUM FUND

Organisation et administration/*Organisation and administration*

| | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Siège social Registered office | 5, Allée Scheffer L-2520 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg |
| Conseil d'Administration du Fonds Board of Directors of the Fund | |
| <i>Administrateurs</i> <i>Directors</i> | Alain Reinhold Senior Advisor Reinhold & Partners Olivier Leymarie C.E.O. Syquant Capital SAS Henri Jeantet Président/Chairman Syquant Capital SAS Bertrand Patillet C.E.O. Alvicel Conseil |
| Société de Gestion Management Company | Syquant Capital SAS 25, Avenue Kléber F-75116 Paris, France |
| Dirigeants de la Société de Gestion Management of the Management Company | Olivier Leymarie C.E.O. Syquant Capital SAS Henri Jeantet Président/Chairman Syquant Capital SAS |
| Banque dépositaire et agent payeur Depositary bank and paying agent | CACEIS Bank, Luxembourg Branch 5, Allée Scheffer L-2520 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg |
| Agent administratif, Teneur de registre et agent de transfert et agent domiciliataire Administrative agent, registrar and transfer agent and domiciliary agent | CACEIS Bank, Luxembourg Branch 5, Allée Scheffer L-2520 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg |
| Cabinet de révision agréé | Deloitte Audit Société à responsabilité limitée 20, Boulevard de Kockelscheuer L-1821 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg |

HELIUM FUND

Informations générales/*General information*

Informations destinées aux investisseurs en Suisse

Représentant en Suisse/*Swiss Representative*

Le représentant en Suisse est CACEIS (Switzerland) S.A. (le «Représentant Suisse»), 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Suisse.

The representative of the Fund in Switzerland is CACEIS (Switzerland) S.A. (the "Swiss Representative"), 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Switzerland.

Service de paiement en Suisse/*Paying agent*

Le service de paiement en Suisse est CACEIS Bank, Paris, succursale de Nyon / Suisse, avec son siège social situé 35 Route de Signy, CH-1260 Nyon, Suisse (l'« Agent Payeur Suisse »).

The paying agent of the Fund in Switzerland is CACEIS Bank, Paris, succursale de Nyon / Suisse, Route de Signy 35, CH-1260 Nyon, Switzerland (the "Swiss Paying Agent").

Publication des prix/*Publications*

Les publications relatives à la Société sont effectuées en Suisse sur le site de Swiss Fund Data AG.

Les prix d'émission et de rachat ou la valeur liquidative de toutes les actions seront également publiés sur le site Internet de Swiss Fund Data AG après chaque émission unique d'actions et d'une note qui indique «hors commissions». Les prix sont publiés chaque jour sur «www.swissfunddata.ch».

The publications regarding the Fund shall be done in Switzerland on the Swiss Fund Data AG website.

The issue and redemption prices or the Net Asset Value of all the shares shall also be published on Swiss Fund Data AG website after every single issuance of shares and with a note which indicate "excluding commissions". The prices shall be published daily on " www.swissfunddata.ch".

Lieu où les documents peuvent être obtenus/*Place where the relevant documents may be obtained*

Le prospectus, les DICs, les statuts, le rapport concernant les changements intervenus dans la composition des portefeuille-titres au cours de la période terminée au 30 juin 2024 ainsi que les rapports annuels, incluant les états financiers audités et les rapports semi-annuels du Fonds peuvent être obtenus gratuitement et sur simple demande auprès du Représentant Suisse.

The Prospectus, the KID, the report on the changes in the securities during the period ended 30 June 2024 and the Articles of incorporation as well as the annual reports, including audited financial statements and semi-annual reports of the Fund may be obtained free of charge upon request from the Swiss Representative.

Lieu d'exécution et for/*Place of performance and jurisdiction*

Pour les parts distribuées en Suisse ou à partir de la Suisse, le lieu d'exécution et le for ont été fixés au siège social du Représentant Suisse.

In respect of the Fund's shares distributed in and from Switzerland, the place of performance and jurisdiction is at the registered office of the Swiss Representative.

HELIUM FUND

Informations générales/General information

TOTAL EXPENSE RATIO (TER)/TOTAL EXPENSE RATIO (TER)

Total Expense Ratio (TER) pour la période allant du 1 juillet 2023 au 30 juin 2024:
Total Expense Ratio (TER) for the period from 1 July 2023 to 30 June 2024:

| Compartiments/Sub-funds | Classes/Class | TER | Quote-part de la Commission de performance (en %)/Performance fees quote (in %) |
|----------------------------------|--------------------------------|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| HELIUM FUND - Helium Fund | Classe/Class A EUR | 1,74% | 0,12% |
| | Classe/Class B EUR | 2,01% | 0,08% |
| | Classe/Class C EUR | 0,17% | - |
| | Classe/Class F EUR | 0,91% | 0,13% |
| | Classe/Class I EUR | 1,49% | 0,11% |
| | Classe/Class I CHF | 1,49% | 0,11% |
| | Classe/Class I USD | 1,47% | 0,04% |
| | Classe/Class Bcl EUR | 1,58% | 0,16% |
| HELIUM FUND - Helium Performance | Classe/Class A EUR | 1,74% | 0,37% |
| | Classe/Class B EUR | 2,23% | 0,32% |
| | Classe/Class C EUR | 0,16% | - |
| | Classe/Class D EUR | 1,72% | - |
| | Classe/Class E EUR | 1,65% | 0,28% |
| | Classe/Class S EUR | 1,46% | 0,31% |
| | Classe/Class Bcl EUR | 1,74% | 0,33% |
| | Classe/Class E JPY* | - | 0,26% |
| | Classe/Class E GBP | 1,57% | 0,20% |
| | Classe/Class A USD | 1,73% | 0,36% |
| | Classe/Class B USD | 2,22% | 0,31% |
| | Classe/Class E USD | 1,60% | 0,23% |
| | HELIUM FUND - Helium Selection | Classe/Class A CHF | 1,64% |
| Classe/Class A EUR | | 1,70% | 0,32% |
| Classe/Class B EUR | | 2,19% | 0,28% |
| Classe/Class C EUR | | 0,16% | - |
| Classe/Class S EUR | | 1,40% | 0,28% |
| Classe/Class Bcl EUR | | 1,79% | 0,38% |
| Classe/Class A USD | | 1,62% | 0,26% |
| Classe/Class A JPY | | 1,41% | 0,04% |
| HELIUM FUND - Helium Invest | Classe/Class A EUR | 0,74% | - |
| | Classe/Class B EUR | 1,41% | - |
| | Classe/Class C EUR | 0,17% | - |
| | Classe/Class S EUR | 0,77% | - |
| | Classe/Class Bcl EUR | 0,91% | - |
| | Classe/Class D EUR | 1,27% | - |
| | Classe/Class A USD | 0,83% | - |

Le TER est calculé en respect de la Directive sur le calcul et la publication du TER, émise le 16 mai 2008 (état au 20 avril 2015) par l'Association Suisse des Fonds de Placement ("Swiss Funds & Asset Management Association" (SFAMA)).

The Total Expense Ratio (TER) is calculated in compliance with the guidelines on the calculation and disclosure of the TER, issued on 16 May 2008 (Version of 20 April 2015) by the Swiss Association of Investment Trust (SFAMA).

*La Valeur Net d'Inventaire est inférieure à 1.000,00 euros, le Total expense ratio n'est pas donc représentatif.
**The Net Asset Value is inferior than 1.000,00 euros, The Total Expense Ratio is not representative.*

HELIUM FUND

Etats financiers combinés

Combined financial statements

HELIUM FUND

Etat combiné des actifs nets au 30/06/24/Combined statement of net assets as at 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Actifs/Assets | 3.250.501.884,14 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/Securities portfolio at market value | 2.952.450.844,20 |
| <i>Prix de revient/Cost price</i> | 3.032.920.412,55 |
| Options (positions longues) à la valeur d'évaluation/Options (long positions) at market value | 799.054,86 |
| <i>Options achetées au prix de revient/Options purchased at cost</i> | 831.025,84 |
| Avoirs en banque et liquidités/Cash at banks and liquidities | 212.101.755,94 |
| A recevoir sur investissements vendus/Receivable for investments sold | 2.306.981,19 |
| A recevoir sur souscriptions/Receivable on subscriptions | 1.652.507,53 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/Net unrealised appreciation on forward foreign exchange contracts | 111.130,00 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/Net unrealised appreciation on financial futures | 8.075.769,85 |
| Plus-value nette non réalisée sur swaps/Net unrealised appreciation on swaps | 33.767.803,43 |
| Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/Dividends receivable on securities portfolio | 9.310.627,24 |
| Dividendes à recevoir sur swaps/Dividends receivable on swaps | 1.719.733,54 |
| Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/Interests receivable on securities portfolio | 7.829.073,65 |
| Intérêts à recevoir sur swaps/Interests receivable on swaps | 751.515,39 |
| Autres intérêts à recevoir/Other interests receivable | 235.504,37 |
| A recevoir sur change/Receivable on foreign exchange | 16.567.616,20 |
| Autres actifs/Other assets | 2.821.966,75 |
| Passifs/Liabilities | 82.670.268,72 |
| Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/Options (short positions) at market value | 1.636.317,05 |
| <i>Options vendues au prix de revient/Options sold at cost</i> | 2.380.141,82 |
| Découvert bancaire/Bank overdrafts | 28.671.565,91 |
| A payer sur investissements achetés/Payable on investments purchased | 8.142.101,58 |
| A payer sur rachats/Payable on redemptions | 10.397.358,66 |
| Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/Net unrealised depreciation on forward foreign exchange contracts | 3.843.735,47 |
| Commissions de gestion à payer/Management fees payable | 2.710.713,22 |
| Commissions de performance à payer/Performance fees payable | 169.665,75 |
| Dividendes à payer sur swaps/Dividends payable on swaps | 9.433.242,15 |
| Intérêts à payer sur swaps/Interests payable on swaps | 736.443,46 |
| Autres intérêts à payer/Other interests payable | 8.027,40 |
| A payer sur change/Payable on foreign exchange | 16.547.574,48 |
| Autres passifs/Other liabilities | 373.523,59 |
| Valeur nette d'inventaire/Net asset value | 3.167.831.615,42 |

HELIUM FUND

Etat combiné des opérations et des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30/06/24/Combined statement of operations and changes in net assets for the period ended 30/06/24

| | <i>Exprimé en</i> <i>Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|
| Revenus/Income | 79.344.930,28 |
| Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net | 21.489.230,70 |
| Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps | 7.823.638,61 |
| Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net | 16.856.735,59 |
| Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps | 23.189.984,12 |
| Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts | 9.059.106,09 |
| Autres revenus/Other income | 926.235,17 |
| Dépenses/Expenses | 76.175.751,42 |
| Commissions de gestion/Management fees | 17.494.088,42 |
| Commissions de performance/Performance fees | 169.665,75 |
| Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depository and sub-depository fees | 439.442,33 |
| Commissions d'administration/Administration fees | 693.835,34 |
| Frais de domiciliation/Domiciliary fees | 6.526,42 |
| Amortissement des frais d'établissement/Amortisation of formation expenses | 6.805,63 |
| Frais d'audit/Audit fees | 121.125,51 |
| Frais légaux/Legal fees | 106.553,11 |
| Frais de transaction/Transaction fees | 1.062.629,14 |
| Rémunération administrateurs/Directors fees | 29.242,11 |
| Taxe d'abonnement/Subscription tax | 405.768,21 |
| Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft | 5.198.794,59 |
| Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps | 22.440.315,47 |
| Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps | 27.607.090,13 |
| Frais bancaires/Banking fees | 7.993,48 |
| Autres dépenses/Other expenses | 385.875,78 |
| Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments | 3.169.178,86 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on: | |
| - ventes d'investissements/- sales of investment securities | 23.977.995,23 |
| - options | 3.326.951,25 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | -10.173.810,29 |
| - contrats futures/- financial futures | 21.992.828,07 |
| - swaps | -5.878.967,07 |
| - change/- foreign exchange | 89.323.454,20 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss) | 125.737.630,25 |
| Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on: | |
| - ventes d'investissements/- investments | -107.662.226,19 |
| - options | 3.141.669,79 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | 5.485.006,94 |
| - contrats futures/- financial futures | -10.258.878,25 |
| - swaps | 20.148.949,36 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations | 36.592.151,90 |
| Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares | 601.275.538,21 |
| Rachats d'actions/Redemptions of shares | -690.999.923,69 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets | -53.132.233,58 |
| Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period | 3.220.963.849,00 |
| Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period | 3.167.831.615,42 |

HELIUM FUND - Helium Fund

HELIUM FUND - Helium Fund

Etat des actifs nets au 30/06/24/Statement of net assets as at 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Actifs/Assets | 835.966.337,85 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/ <i>Securities portfolio at market value</i> | 752.117.429,01 |
| <i>Prix de revient/Cost price</i> | 773.264.846,52 |
| Options (positions longues) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (long positions) at market value</i> | 81.967,08 |
| <i>Options achetées au prix de revient/Options purchased at cost</i> | 81.774,97 |
| Avoirs en banque et liquidités/ <i>Cash at banks and liquidities</i> | 61.382.255,49 |
| A recevoir sur investissements vendus/ <i>Receivable for investments sold</i> | 124.778,26 |
| A recevoir sur souscriptions/ <i>Receivable on subscriptions</i> | 221.382,94 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/ <i>Net unrealised appreciation on financial futures</i> | 1.109.494,43 |
| Plus-value nette non réalisée sur swaps/ <i>Net unrealised appreciation on swaps</i> | 12.002.766,88 |
| Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Dividends receivable on securities portfolio</i> | 3.144.165,01 |
| Dividendes à recevoir sur swaps/ <i>Dividends receivable on swaps</i> | 110.699,82 |
| Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Interests receivable on securities portfolio</i> | 1.718.928,50 |
| Intérêts à recevoir sur swaps/ <i>Interests receivable on swaps</i> | 293.501,05 |
| Autres intérêts à recevoir/ <i>Other interests receivable</i> | 59.806,20 |
| A recevoir sur change/ <i>Receivable on foreign exchange</i> | 2.815.046,86 |
| Autres actifs/ <i>Other assets</i> | 784.116,32 |
| Passifs/Liabilities | 13.831.517,98 |
| Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (short positions) at market value</i> | 162.126,30 |
| <i>Options vendues au prix de revient/Options sold at cost</i> | 263.782,48 |
| Découvert bancaire/ <i>Bank overdrafts</i> | 2.744.158,73 |
| A payer sur investissements achetés/ <i>Payable on investments purchased</i> | 1.407.564,79 |
| A payer sur rachats/ <i>Payable on redemptions</i> | 1.525.547,10 |
| Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/ <i>Net unrealised depreciation on forward foreign exchange contracts</i> | 826.989,39 |
| Commissions de gestion à payer/ <i>Management fees payable</i> | 711.715,33 |
| Dividendes à payer sur swaps/ <i>Dividends payable on swaps</i> | 3.542.451,02 |
| Intérêts à payer sur swaps/ <i>Interests payable on swaps</i> | 66.501,85 |
| A payer sur change/ <i>Payable on foreign exchange</i> | 2.809.609,48 |
| Autres passifs/ <i>Other liabilities</i> | 34.853,99 |
| Valeur nette d'inventaire/Net asset value | 822.134.819,87 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/24 au 30/06/24/Statement of operations and changes in net assets from 01/01/24 to 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Revenus/Income | 17.295.553,78 |
| Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net | 4.540.878,56 |
| Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps | 1.717.590,30 |
| Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net | 4.190.934,86 |
| Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps | 5.073.219,66 |
| Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts | 1.737.815,64 |
| Autres revenus/Other income | 35.114,76 |
| Dépenses/Expenses | 15.847.335,77 |
| Commissions de gestion/Management fees | 4.817.779,04 |
| Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depositary and sub-depositary fees | 127.740,18 |
| Commissions d'administration/Administration fees | 172.617,28 |
| Frais de domiciliation/Domiciliary fees | 1.087,73 |
| Frais d'audit/Audit fees | 30.380,82 |
| Frais légaux/Legal fees | 28.684,28 |
| Frais de transaction/Transaction fees | 329.351,45 |
| Rémunération administrateurs/Directors fees | 9.712,64 |
| Taxe d'abonnement/Subscription tax | 80.304,90 |
| Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft | 710.114,56 |
| Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps | 4.663.820,67 |
| Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps | 4.790.520,11 |
| Frais bancaires/Banking fees | 6.325,14 |
| Autres dépenses/Other expenses | 78.896,97 |
| Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments | 1.448.218,01 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on: | |
| - ventes d'investissements/- sales of investment securities | 9.381.130,58 |
| - options | 408.442,25 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | -591.405,26 |
| - contrats futures/- financial futures | 2.727.384,49 |
| - swaps | -912.930,83 |
| - change/- foreign exchange | 27.080.027,71 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss) | 39.540.866,95 |
| Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on: | |
| - ventes d'investissements/- investments | -38.774.453,41 |
| - options | 602.759,29 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | 1.074.615,46 |
| - contrats futures/- financial futures | -935.243,24 |
| - swaps | 8.425.819,57 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations | 9.934.364,62 |
| Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares | 86.948.345,49 |
| Rachats d'actions/Redemptions of shares | -234.728.370,52 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets | -137.845.660,41 |
| Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period | 959.980.480,28 |
| Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period | 822.134.819,87 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Statistiques/*Statistics*

| | | 30/06/24 | 31/12/23 | 31/12/22 |
|------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i> | EUR | 822.134.819,87 | 959.980.480,28 | 738.810.509,03 |
| A - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 9.612,372 | 12.419,220 | 15.637,874 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.872,88 | 1.853,81 | 1.779,34 |
| B - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 122.791,647 | 130.950,724 | 88.331,235 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.197,09 | 1.186,61 | 1.141,70 |
| C - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 8.195,809 | 9.674,895 | 7.808,629 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 2.751,84 | 2.704,39 | 2.554,27 |
| I - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 279.717,701 | 328.511,519 | 282.206,965 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.233,63 | 1.219,57 | 1.168,11 |
| Bcl - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 21.889,708 | 83.045,317 | 126.983,442 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.167,25 | 1.154,02 | 1.105,67 |
| I - CHF | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 639,000 | 639,000 | 1.111,000 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | CHF | 1.111,25 | 1.112,54 | 1.087,57 |
| I - USD | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 3.657,717 | 10.097,198 | - |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | USD | 1.539,91 | 1.511,17 | - |
| F - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 223.164,958 | 214.451,039 | 109.419,798 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.155,98 | 1.139,42 | 1.086,82 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/24 au 30/06/24/*Changes in number of shares outstanding from 01/01/24 to 30/06/24*

| | Nombre d'actions au 01/01/24 <i>Shares outstanding as at 01/01/24</i> | Nombre d'actions émises <i>Shares issued</i> | Nombre d'actions rachetées <i>Shares redeemed</i> | Nombre d'actions au 30/06/24 <i>Shares outstanding as at 30/06/24</i> |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| A - EUR | 12.419,220 | 328,695 | 3.135,543 | 9.612,372 |
| B - EUR | 130.950,724 | 12.811,438 | 20.970,515 | 122.791,647 |
| C - EUR | 9.674,895 | 425,867 | 1.904,953 | 8.195,809 |
| I - EUR | 328.511,519 | 29.284,120 | 78.077,938 | 279.717,701 |
| Bcl - EUR | 83.045,317 | 533,701 | 61.689,310 | 21.889,708 |
| I - CHF | 639,000 | 0,000 | 0,000 | 639,000 |
| I - USD | 10.097,198 | 0,000 | 6.439,481 | 3.657,717 |
| F - EUR | 214.451,039 | 29.382,042 | 20.668,123 | 223.164,958 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé/Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market | | | 710.953.030,12 | 86,48 |
| Actions/Shares | | | 332.595.502,07 | 40,46 |
| Allemagne/Germany | | | 111.684.505,89 | 13,58 |
| AAREAL BANK --- REGISTERED SHS | EUR | 26.395 | 955.499,00 | 0,12 |
| ADIDAS AG - REG SHS | EUR | 20.396 | 4.548.308,00 | 0,55 |
| ADTRAN NETWORKS SE | EUR | 124.535 | 2.463.302,30 | 0,30 |
| ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE | EUR | 8.927 | 2.316.556,50 | 0,28 |
| BAYER AG REG SHS | EUR | 190.433 | 5.023.622,54 | 0,61 |
| COMMERZBK | EUR | 155.126 | 2.200.462,31 | 0,27 |
| COVESTRO AG | EUR | 44.190 | 2.421.612,00 | 0,29 |
| E.ON SE | EUR | 777.526 | 9.528.581,13 | 1,16 |
| MERCK KGAA - BEARER SHS | EUR | 6.665 | 1.031.408,75 | 0,13 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS | EUR | 4.953 | 2.313.051,00 | 0,28 |
| OHB AG | EUR | 25.101 | 1.091.893,50 | 0,13 |
| OHB SE | EUR | 135.939 | 5.926.940,40 | 0,72 |
| PFEIFF VACUUM TECHNOLOGY | EUR | 17.753 | 2.797.872,80 | 0,34 |
| RWE AG | EUR | 160.366 | 5.123.693,70 | 0,62 |
| SAP AG | EUR | 44.360 | 8.407.107,20 | 1,02 |
| SCHALTBAU HLDG --- REGISTERED SHS | EUR | 50.689 | 2.914.617,50 | 0,35 |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS | EUR | 1.031.876 | 25.084.905,56 | 3,05 |
| SILICON SENSOR INTL AG | EUR | 133.203 | 8.045.461,20 | 0,98 |
| SOFTWARE | EUR | 116.100 | 4.179.600,00 | 0,51 |
| SYNLAB AG | EUR | 101.173 | 1.133.137,60 | 0,14 |
| VANTAGE TOWERS AG | EUR | 125.477 | 4.780.673,70 | 0,58 |
| VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT | EUR | 89.148 | 9.396.199,20 | 1,14 |
| Australie/Australia | | | 370.737,79 | 0,05 |
| CSR LTD | AUD | 67.000 | 370.737,79 | 0,05 |
| Belgique/Belgium | | | 34.223.553,00 | 4,16 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | EUR | 623.885 | 33.764.656,20 | 4,11 |
| FINANCIERE DE TUBIZE | EUR | 4.404 | 458.896,80 | 0,06 |
| Bermudes/Bermuda | | | 3.230.977,82 | 0,39 |
| CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | HKD | 3.293.000 | 3.230.977,82 | 0,39 |
| Espagne/Spain | | | 1.499.896,52 | 0,18 |
| ARIMA --- BEARER SHS | EUR | 179.257 | 1.498.588,52 | 0,18 |
| PARQUETOS REUNIDOS | EUR | 100 | 1.308,00 | 0,00 |
| États-Unis/United States of America | | | 4.086.321,99 | 0,50 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | USD | 95.579 | 3.488.733,83 | 0,42 |
| HIBBETT SPORTS | USD | 6.627 | 539.249,52 | 0,07 |
| PERFICIENT INC | USD | 836 | 58.338,64 | 0,01 |
| Finlande/Finland | | | 4.591.740,87 | 0,56 |
| CAVERION OYJ | EUR | 512.718 | 4.591.740,87 | 0,56 |
| France | | | 51.556.238,42 | 6,27 |
| AXA SA | EUR | 322.016 | 9.844.029,12 | 1,20 |
| BNP PARIBAS SA | EUR | 225.000 | 13.394.250,00 | 1,63 |
| CHRISTIAN DIOR | EUR | 14.583 | 9.792.484,50 | 1,19 |
| ENGIE SA | EUR | 800.000 | 10.668.000,00 | 1,30 |
| LAGARDERE SA | EUR | 50.000 | 1.035.000,00 | 0,13 |
| VISIATIV SA | EUR | 25.084 | 920.582,80 | 0,11 |
| VIVENDI SA | EUR | 567.000 | 5.531.652,00 | 0,67 |
| VOYAGEURS DU MONDE SA | EUR | 2.600 | 370.240,00 | 0,05 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description Denomination | Devise Currency | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR) | % actifs nets % of net assets |
|---------------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | | |
| HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES | USD | 63.158 | 1.275.240,61 | 0,16 |
| Italie/Italy | | | | |
| SARAS RAFFINERIE SARDE SPA | EUR | 231.995 | 375.599,91 | 0,05 |
| Japon/Japan | | | | |
| BENEFIT ONE INC | JPY | 2.099 | 26.456,39 | 0,00 |
| BENESSE HOLDINGS INC | JPY | 33.856 | 510.584,29 | 0,06 |
| TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | JPY | 103.614 | 5.180.648,91 | 0,63 |
| T K TOKA CO | JPY | 270.444 | 2.211.846,17 | 0,27 |
| Malte/Malta | | | | |
| KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC | SEK | 115.000 | 1.276.651,98 | 0,16 |
| Norvège/Norway | | | | |
| GRAM CAR --- REGISTERED SHS | NOK | 50.968 | 1.159.023,44 | 0,14 |
| PGS ASA | NOK | 2.119.892 | 1.660.766,29 | 0,20 |
| TGS ASA | NOK | 44.400 | 498.802,09 | 0,06 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | | |
| ADYEN | EUR | 4.313 | 4.801.231,60 | 0,58 |
| ASML HOLDING NV - BEARER/REG SHS | EUR | 5.380 | 5.187.396,00 | 0,63 |
| DSM KONINKLIJKE | EUR | 371.273 | 37.206.247,08 | 4,53 |
| ING GROUP NV | EUR | 324.249 | 5.175.662,54 | 0,63 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | | |
| ALPHA FINANCIAL SHARES | GBP | 5.186 | 30.277,41 | 0,00 |
| IMPELLAM GROUP PLC | GBP | 128.256 | 446.940,65 | 0,05 |
| LOK 'N' STORE GP REGISTERED SHS | GBP | 31.125 | 403.815,53 | 0,05 |
| MATTIOLI WOODS PLC | GBP | 629.122 | 5.847.120,79 | 0,71 |
| TRIDENT ROYALTIES PLC | GBP | 2.871.255 | 1.615.366,68 | 0,20 |
| Suède/Sweden | | | | |
| INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE | SEK | 23.946 | 760.786,57 | 0,09 |
| KINNEVIK AB-RDS | SEK | 1.995.427 | 4.043.596,56 | 0,49 |
| KINNEVIK AB- RDS | SEK | 20.557.055 | 41.657.468,28 | 5,07 |
| Obligations/Bonds | | | | |
| Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles | | | | |
| SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A | EUR | 3.200.000 | 3.327.952,00 | 0,40 |
| États-Unis/United States of America | | | | |
| AVERY DENNISON CORP 1.25 17-25 03/03A | EUR | 2.000.000 | 1.966.370,00 | 0,24 |
| France | | | | |
| BNP PARIBAS 3.3750 18-25 09/01S | USD | 8.000.000 | 7.370.039,66 | 0,90 |
| BUREAU VERITAS 1.8750 18-25 06/01A | EUR | 1.700.000 | 1.684.258,00 | 0,20 |
| CARMILA 2.375 16-24 16/09S | EUR | 3.500.000 | 3.486.735,00 | 0,42 |
| SEB SA 1.3750 20-25 16/06A | EUR | 5.900.000 | 5.767.191,00 | 0,70 |
| Luxembourg | | | | |
| LOGICOR FINANCING 0.6250 22-25 17/11A | EUR | 3.446.000 | 3.274.888,87 | 0,40 |
| TRATON FINANCE LUXEM 0.125 21-24 10/11A | EUR | 2.700.000 | 2.663.793,00 | 0,32 |
| TRATON FINANCE LUXEM 4.1250 23-25 18/01A | EUR | 1.200.000 | 1.200.762,00 | 0,15 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | | |
| BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A | EUR | 6.700.000 | 6.606.267,00 | 0,80 |
| EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S | EUR | 9.300.000 | 9.015.141,00 | 1,10 |
| INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A | EUR | 1.000.000 | 979.840,00 | 0,12 |
| Obligations à taux variables/Floating rate notes | | | | |
| | | | 99.371.503,44 | 12,09 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description Denomination | Devise Currency | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR) | % actifs nets % of net assets |
|---------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Allemagne/Germany | | | | |
| DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A | EUR | 9.500.000 | 9.225.165,00 | 1,12 |
| Canada | | | | |
| CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q | EUR | 2.300.000 | 2.315.122,50 | 0,28 |
| Espagne/Spain | | | | |
| BANCA MARCH SA FL.R 21-25 17/11A | EUR | 3.900.000 | 3.878.608,50 | 0,47 |
| BANCO SANTANDER FL.R 23-25 16/01Q | EUR | 1.500.000 | 1.503.885,00 | 0,18 |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 22-26 27/09A | EUR | 5.000.000 | 4.993.600,00 | 0,61 |
| États-Unis/United States of America | | | | |
| CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A | EUR | 6.300.000 | 6.151.729,50 | 0,75 |
| JP MORGAN CHASE FL.R 14-24 31/07Q | EUR | 7.500.000 | 7.478.943,75 | 0,91 |
| METROPOLITAN LIFE GL FL.R 22-24 20/12Q | EUR | 19.600.000 | 19.628.714,00 | 2,39 |
| WELLS FARGO FL.R 12-24 05/12Q | USD | 7.600.000 | 7.024.903,19 | 0,85 |
| France | | | | |
| BNP PARIBAS SA FL.R 19-25 15/07A | EUR | 4.000.000 | 3.995.200,00 | 0,49 |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 22-26 12/10A | EUR | 1.100.000 | 1.102.150,50 | 0,13 |
| SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q | EUR | 6.000.000 | 6.016.650,00 | 0,73 |
| VINCI SA FL.R 24-26 13/05Q | EUR | 1.000.000 | 1.000.055,00 | 0,12 |
| Irlande/Ireland | | | | |
| CA AUTO BANK SPA IR FL.R 23-25 13/01Q | EUR | 3.000.000 | 3.010.935,00 | 0,37 |
| Japon/Japan | | | | |
| MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A | EUR | 6.400.000 | 6.390.048,00 | 0,78 |
| Luxembourg | | | | |
| OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S | EUR | 2.420.000 | 2.429.680,00 | 0,30 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | | |
| ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A | EUR | 6.000.000 | 5.960.700,00 | 0,73 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | | |
| LLOYDS BANKING GROUP FL.R 20-26 01/04A | EUR | 2.000.000 | 1.995.120,00 | 0,24 |
| Suisse/Switzerland | | | | |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A | EUR | 5.300.000 | 5.270.293,50 | 0,64 |
| Obligations convertibles/Convertible bonds | | | | |
| Allemagne/Germany | | | | |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A | EUR | 12.900.000 | 12.411.541,50 | 1,51 |
| RAG-STIFTUNG CV 0 20-26 17/06U17/06U | EUR | 2.000.000 | 1.943.120,00 | 0,24 |
| TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625 20-26 27/08S | EUR | 6.900.000 | 6.329.370,00 | 0,77 |
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A | EUR | 4.400.000 | 4.207.412,00 | 0,51 |
| Autriche/Austria | | | | |
| AMS AGA 0.00 18-25 05/03U | EUR | 4.400.000 | 4.169.550,00 | 0,51 |
| Belgique/Belgium | | | | |
| MITHRA PHARMA CV 4.25 20-25 17/12S | EUR | 2.900.000 | 281.097,00 | 0,03 |
| SAGERPAR SA CV 0 21-26 01/04U1-26 01/04U | EUR | 1.900.000 | 1.769.650,50 | 0,22 |
| UMICORE SA CV 0.00 20-25 23/06U | EUR | 9.000.000 | 8.583.390,00 | 1,04 |
| Bermudes/Bermuda | | | | |
| BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A | USD | 4.000.000 | 3.674.065,78 | 0,45 |
| Espagne/Spain | | | | |
| AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S | EUR | 1.200.000 | 1.139.820,00 | 0,14 |
| CRITERIA CAIXA SAU CV 0 21-25 22/06U | EUR | 9.700.000 | 9.321.797,00 | 1,13 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description Denomination | Devise Currency | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR) | % actifs nets % of net assets |
|----------------------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| France | | | 106.288.841,80 | 12,93 |
| ATOS SE CV 0 19-24 06/11U11U | EUR | 16.900.000 | 4.394.000,00 | 0,53 |
| BIGBEN INTERACTIVE CV 1.125 21-26 19/02S | EUR | 2.000.000 | 1.002.340,00 | 0,12 |
| CLARIANE 0.875 20-27 06/03A | EUR | 64.589 | 3.187.237,59 | 0,39 |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U | EUR | 271.000 | 16.427.613,50 | 2,00 |
| GENFIT CV DY CV 3.50 17-25 16/10S | EUR | 91.000 | 2.467.946,29 | 0,30 |
| KORIAN SA CV FL.R 21-99 31/12S | EUR | 41.500 | 1.448.024,92 | 0,18 |
| NEOEN SPA 2.00 20-25 02/06S | EUR | 82.100 | 3.890.062,20 | 0,47 |
| NEOEN SPA CV 2.875 22-27 14/09S | EUR | 2.400.000 | 2.417.760,00 | 0,29 |
| NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S | EUR | 30.000 | 1.913.957,25 | 0,23 |
| SELENA SARL CV 0.00 20-25 25/06U | EUR | 250 | 23.935.125,00 | 2,91 |
| UBISOFT ENTERTA CV 0.0 19-24 24/09U | EUR | 46.017 | 5.213.334,96 | 0,63 |
| VOLTALIA SA CV 21-25 13/01A | EUR | 139.531 | 4.257.270,26 | 0,52 |
| WENDEL CV 2.625 23-26 27/03A | EUR | 14.500.000 | 14.362.250,00 | 1,75 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 19-26 30/07U | EUR | 132.700 | 12.291.536,55 | 1,50 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 20-25 30/07 | EUR | 80.577 | 9.080.383,28 | 1,10 |
| Italie/Italy | | | 5.707.712,00 | 0,69 |
| NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S | EUR | 4.600.000 | 4.256.242,00 | 0,52 |
| PIRELLI AND C SPA CV 0.00 20-25 22/12U | EUR | 1.000.000 | 1.057.080,00 | 0,13 |
| SELINI CV 4.0 24-28 30/05Q | EUR | 400.000 | 394.390,00 | 0,05 |
| Jersey | | | 16.956.611,97 | 2,06 |
| DERWENT LONDON CV 1.50 19-25 12/06S | GBP | 10.700.000 | 12.185.266,26 | 1,48 |
| PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S | GBP | 2.600.000 | 2.994.576,87 | 0,36 |
| SIRIUS MINERALS FINA CV 5 19-27 23/05Q | USD | 1.400.000 | 1.776.768,84 | 0,22 |
| Mexique/Mexico | | | 694.032,50 | 0,08 |
| FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A | EUR | 700.000 | 694.032,50 | 0,08 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 33.911.687,21 | 4,12 |
| MONDELEZ INTL HDLG NL CV 0 21-24 20/09UU | EUR | 23.400.000 | 23.191.272,00 | 2,82 |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U | USD | 6.600.000 | 5.691.641,71 | 0,69 |
| SIEMENS ENERGY FINAN CV 22-25 14/09S | EUR | 3.100.000 | 5.028.773,50 | 0,61 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 4.678.359,43 | 0,57 |
| BARCLAYS BANK PLC CV 0.00 22-25 24/01A | EUR | 2.000.000 | 2.028.820,00 | 0,25 |
| CAPITAL AND COUNTIES CV 2.0 20-26 30/03S | GBP | 2.400.000 | 2.649.539,43 | 0,32 |
| Suisse/Switzerland | | | 9.557.305,96 | 1,16 |
| SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A | CHF | 9.300.000 | 9.557.305,96 | 1,16 |
| Warrants | | | 17.422,43 | 0,00 |
| France | | | 10.477,95 | 0,00 |
| ARVERNE GROUP 16.06.26 WAR | EUR | 69.853 | 10.477,95 | 0,00 |
| Luxembourg | | | 360,73 | 0,00 |
| BENEVOLENTAI S.A. (BENEVOL) 30.06.26 WAR | EUR | 29.376 | 293,76 | 0,00 |
| LEARND SE 15.10.26 WAR | EUR | 11.165 | 11,17 | 0,00 |
| MARLEY SPOON GROUP SE 20.01.27 WAR | EUR | 20.800 | 20,80 | 0,00 |
| SMG EUROPEAN RECOVERY 27.05.27 WAR | EUR | 35.000 | 35,00 | 0,00 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 6.583,75 | 0,00 |
| PEGASUS ENTREPRENEUR 14.12.24 WAR | EUR | 1 | 0,25 | 0,00 |
| QEV TECH WT B.V. 11.11.26 WAR | EUR | 29.925 | 6.583,50 | 0,00 |
| Autres valeurs mobilières/Other transferable securities | | | 41.164.398,89 | 5,01 |
| Actions/Shares | | | 2.972.346,84 | 0,36 |
| Canada | | | 145.487,22 | 0,02 |
| FUSION PHARMACEUTICALS INC | USD | 226.442 | 116.205,37 | 0,01 |
| NEIGHBOURLY PHARMACY INC | CAD | 429.433 | 29.281,85 | 0,00 |

HELIUM FUND - Helium Fund

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|----------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| États-Unis/United States of America | | | 2.826.859,54 | 0,34 |
| ALTABA INC | USD | 946.025 | 2.228.796,95 | 0,27 |
| CHINOOK THERAPEUTICS | USD | 154.100 | 100.648,47 | 0,01 |
| DECIBEL THERAPEUTICS INC | USD | 60.763 | 56.695,12 | 0,01 |
| ICOSAVAX INC | USD | 215.000 | 180.545,84 | 0,02 |
| INHIBRX INC | USD | 129.568 | 224.862,59 | 0,03 |
| MIRATI THERAPEUTICS INC | USD | 54.063 | 35.310,57 | 0,00 |
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | 0,08 | 0,00 |
| HEATHER VENT --- REGISTERED SHS | GBP | 262.812 | 0,04 | 0,00 |
| TAPIR --- REGISTERED SHS | GBP | 262.812 | 0,04 | 0,00 |
| Suède/Sweden | | | - | 0,00 |
| VICTORIAHEM FASTIGHETER AB | SEK | 33.000 | - | 0,00 |
| Warrants | | | 0,04 | 0,00 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 0,04 | 0,00 |
| NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR | GBP | 30.188 | 0,04 | 0,00 |
| Droits/Rights | | | 38.192.052,01 | 4,65 |
| Autriche/Austria | | | 2.840.502,00 | 0,35 |
| BUWOG | EUR | 946.834 | 2.840.502,00 | 0,35 |
| États-Unis/United States of America | | | 4.082,11 | 0,00 |
| SUPERNUS PHARMACEUTICALS 31.12.24 RIGHT | USD | 25.000 | 4.082,11 | 0,00 |
| SUPERNUS PHARMACEUTICALS 31.12.25 RIGHT | USD | 25.000 | - | 0,00 |
| Finlande/Finland | | | 35.347.467,90 | 4,30 |
| AHLSTROM-MUNKSJO OYJ | EUR | 1.575.000 | 30.642.333,70 | 3,73 |
| UPONOR OYJ 27.05.26 RIGHT | EUR | 161.111 | 4.705.134,20 | 0,57 |
| Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio | | | 752.117.429,01 | 91,48 |

HELIUM FUND - Helium Performance

HELIUM FUND - Helium Performance

Etat des actifs nets au 30/06/24/Statement of net assets as at 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Actifs/Assets | 987.283.050,97 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/ <i>Securities portfolio at market value</i> | 924.080.732,88 |
| <i>Prix de revient/Cost price</i> | 965.366.589,79 |
| Options (positions longues) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (long positions) at market value</i> | 250.817,67 |
| <i>Options achetées au prix de revient/Options purchased at cost</i> | 262.777,07 |
| Avoirs en banque et liquidités/ <i>Cash at banks and liquidities</i> | 42.712.184,04 |
| A recevoir sur investissements vendus/ <i>Receivable for investments sold</i> | 304.332,80 |
| A recevoir sur souscriptions/ <i>Receivable on subscriptions</i> | 204.643,93 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/ <i>Net unrealised appreciation on financial futures</i> | 2.915.541,72 |
| Plus-value nette non réalisée sur swaps/ <i>Net unrealised appreciation on swaps</i> | 6.830.591,78 |
| Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Dividends receivable on securities portfolio</i> | 3.589.429,00 |
| Dividendes à recevoir sur swaps/ <i>Dividends receivable on swaps</i> | 698.640,44 |
| Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Interests receivable on securities portfolio</i> | 2.417.221,97 |
| Intérêts à recevoir sur swaps/ <i>Interests receivable on swaps</i> | 265.562,60 |
| Autres intérêts à recevoir/ <i>Other interests receivable</i> | 73.535,92 |
| A recevoir sur change/ <i>Receivable on foreign exchange</i> | 1.356.828,19 |
| Autres actifs/ <i>Other assets</i> | 1.582.988,03 |
| Passifs/Liabilities | 20.092.412,64 |
| Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (short positions) at market value</i> | 463.329,35 |
| <i>Options vendues au prix de revient/Options sold at cost</i> | 735.415,39 |
| Découvert bancaire/ <i>Bank overdrafts</i> | 7.011.497,29 |
| A payer sur investissements achetés/ <i>Payable on investments purchased</i> | 2.331.238,54 |
| A payer sur rachats/ <i>Payable on redemptions</i> | 3.422.988,06 |
| Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/ <i>Net unrealised depreciation on forward foreign exchange contracts</i> | 892.743,51 |
| Commissions de gestion à payer/ <i>Management fees payable</i> | 905.929,71 |
| Dividendes à payer sur swaps/ <i>Dividends payable on swaps</i> | 3.424.658,07 |
| Intérêts à payer sur swaps/ <i>Interests payable on swaps</i> | 108.638,33 |
| Autres intérêts à payer/ <i>Other interests payable</i> | 2.801,20 |
| A payer sur change/ <i>Payable on foreign exchange</i> | 1.358.408,02 |
| Autres passifs/ <i>Other liabilities</i> | 170.180,56 |
| Valeur nette d'inventaire/Net asset value | 967.190.638,33 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/24 au 30/06/24/Statement of operations and changes in net assets from 01/01/24 to 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Revenus/Income | 28.549.796,74 |
| Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net | 8.047.225,02 |
| Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps | 3.264.590,28 |
| Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net | 5.375.774,68 |
| Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps | 7.160.350,57 |
| Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts | 4.667.086,30 |
| Autres revenus/Other income | 34.769,89 |
| Dépenses/Expenses | 26.764.298,30 |
| Commissions de gestion/Management fees | 6.015.707,06 |
| Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depositary and sub-depositary fees | 135.845,02 |
| Commissions d'administration/Administration fees | 207.790,64 |
| Frais de domiciliation/Domiciliary fees | 1.087,73 |
| Frais d'audit/Audit fees | 50.009,86 |
| Frais légaux/Legal fees | 32.300,24 |
| Frais de transaction/Transaction fees | 315.766,36 |
| Rémunération administrateurs/Directors fees | 8.659,16 |
| Taxe d'abonnement/Subscription tax | 187.673,33 |
| Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft | 3.407.825,64 |
| Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps | 9.213.912,46 |
| Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps | 7.061.880,28 |
| Frais bancaires/Banking fees | 13,55 |
| Autres dépenses/Other expenses | 125.826,97 |
| Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments | 1.785.498,44 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on: | |
| - ventes d'investissements/- sales of investment securities | 20.517.064,58 |
| - options | 970.140,57 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | -1.244.292,97 |
| - contrats futures/- financial futures | 7.690.185,08 |
| - swaps | -3.189.532,21 |
| - change/- foreign exchange | 24.507.755,40 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss) | 51.036.818,89 |
| Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on: | |
| - ventes d'investissements/- investments | -42.425.784,15 |
| - options | 398.730,64 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | 4.558.840,13 |
| - contrats futures/- financial futures | -4.113.388,87 |
| - swaps | 5.452.327,92 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations | 14.907.544,56 |
| Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares | 81.866.161,50 |
| Rachats d'actions/Redemptions of shares | -215.329.650,51 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets | -118.555.944,45 |
| Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period | 1.085.746.582,78 |
| Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period | 967.190.638,33 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Statistiques/Statistics

| | | 30/06/24 | 31/12/23 | 31/12/22 |
|----------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| Total des actifs nets/Total Net Assets | EUR | 967.190.638,33 | 1.085.746.582,78 | 1.248.602.431,66 |
| A - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 47.667,282 | 55.112,926 | 72.294,193 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.454,67 | 1.433,96 | 1.359,71 |
| A - USD | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 8.316,766 | 8.636,484 | 9.665,777 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | USD | 1.507,19 | 1.474,91 | 1.372,86 |
| B - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 113.387,138 | 134.624,804 | 167.509,164 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.373,32 | 1.357,37 | 1.292,63 |
| B - USD | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 2.115,725 | 2.256,450 | 2.873,406 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | USD | 1.444,21 | 1.416,43 | 1.323,40 |
| S - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 327.717,637 | 381.135,539 | 411.793,947 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.529,75 | 1.506,42 | 1.423,98 |
| C - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 9.685,603 | 9.259,716 | 8.797,882 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.824,37 | 1.787,79 | 1.666,05 |
| D - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 67.893,719 | 68.521,719 | 39.206,719 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.235,41 | 1.219,99 | 1.154,79 |
| E - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 59.201,656 | 75.577,887 | 74.720,840 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.234,44 | 1.216,91 | 1.152,38 |
| E - USD | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 16.203,859 | 7.504,361 | 6.840,360 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | USD | 1.408,23 | 1.378,09 | 1.280,23 |
| Bcl - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 25.320,650 | 28.782,257 | 122.522,234 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | EUR | 1.193,30 | 1.176,54 | 1.115,91 |
| E - JPY | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 1,000 | 1,000 | 49.557,012 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | JPY | 116.398,73 | 117.089,83 | 114.835,72 |
| E - GBP | | | | |
| Nombre d'actions/Number of shares | | 88,000 | 44,000 | 8,000 |
| Valeur nette d'inventaire par action/Net asset value per share | GBP | 1.195,48 | 1.171,33 | 1.094,64 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/24 au 30/06/24/Changes in number of shares outstanding from 01/01/24 to 30/06/24

| | Nombre d'actions au 01/01/24 <i>Shares outstanding as at 01/01/24</i> | Nombre d'actions émises <i>Shares issued</i> | Nombre d'actions rachetées <i>Shares redeemed</i> | Nombre d'actions au 30/06/24 <i>Shares outstanding as at 30/06/24</i> |
|------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| A - EUR | 55.112,926 | 2.750,774 | 10.196,418 | 47.667,282 |
| A - USD | 8.636,484 | 612,750 | 932,468 | 8.316,766 |
| B - EUR | 134.624,804 | 8.429,432 | 29.667,098 | 113.387,138 |
| B - USD | 2.256,450 | 82,818 | 223,543 | 2.115,725 |
| S - EUR | 381.135,539 | 19.818,400 | 73.236,302 | 327.717,637 |
| C - EUR | 9.259,716 | 952,372 | 526,485 | 9.685,603 |
| D - EUR | 68.521,719 | 207,000 | 835,000 | 67.893,719 |
| E - EUR | 75.577,887 | 4.884,998 | 21.261,229 | 59.201,656 |
| E - USD | 7.504,361 | 19.387,775 | 10.688,277 | 16.203,859 |
| Bcl - EUR | 28.782,257 | 2.261,616 | 5.723,223 | 25.320,650 |
| E - JPY | 1,000 | 0,000 | 0,000 | 1,000 |
| E - GBP | 44,000 | 44,000 | 0,000 | 88,000 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé/Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market | | | 907.148.660,67 | 93,79 |
| Actions/Shares | | | 432.515.538,61 | 44,72 |
| Allemagne/Germany | | | 135.392.331,75 | 14,00 |
| AAREAL BANK --- REGISTERED SHS | EUR | 25.932 | 938.738,40 | 0,10 |
| ADIDAS AG - REG SHS | EUR | 34.194 | 7.625.262,00 | 0,79 |
| ADTRAN NETWORKS SE | EUR | 114.874 | 2.272.207,72 | 0,23 |
| ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE | EUR | 14.965 | 3.883.417,50 | 0,40 |
| BAYER AG REG SHS | EUR | 322.907 | 8.518.286,66 | 0,88 |
| COMMERZBK | EUR | 260.064 | 3.689.007,84 | 0,38 |
| COVESTRO AG | EUR | 74.084 | 4.059.803,20 | 0,42 |
| E.ON SE | EUR | 1.311.563 | 16.073.204,57 | 1,66 |
| GERRESHEIMER AG -INHABER-AKT | EUR | 33.362 | 3.346.208,60 | 0,35 |
| LANXESS AG | EUR | 182.239 | 4.187.852,22 | 0,43 |
| MERCK KGAA - BEARER SHS | EUR | 11.174 | 1.729.176,50 | 0,18 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS | EUR | 8.303 | 3.877.501,00 | 0,40 |
| OHB AG | EUR | 14.655 | 637.492,50 | 0,07 |
| OHB SE | EUR | 96.400 | 4.203.040,00 | 0,43 |
| PFEIFF VACUUM TECHNOLOGY | EUR | 17.569 | 2.768.874,40 | 0,29 |
| PUMA AG | EUR | 52.390 | 2.245.959,30 | 0,23 |
| RWE AG | EUR | 218.745 | 6.988.902,75 | 0,72 |
| SAP AG | EUR | 80.468 | 15.250.295,36 | 1,58 |
| SCHALTBAU HLDG --- REGISTERED SHS | EUR | 45.188 | 2.598.310,00 | 0,27 |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS | EUR | 81.393 | 1.978.663,83 | 0,20 |
| SILICON SENSOR INTL AG | EUR | 208.388 | 12.586.635,20 | 1,30 |
| SOFTWARE | EUR | 115.396 | 4.154.256,00 | 0,43 |
| SYNLAB AG | EUR | 117.504 | 1.316.044,80 | 0,14 |
| VANTAGE TOWERS AG | EUR | 121.160 | 4.616.196,00 | 0,48 |
| VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT | EUR | 150.351 | 15.846.995,40 | 1,64 |
| Australie/Australia | | | 470.338,98 | 0,05 |
| CSR LTD | AUD | 85.000 | 470.338,98 | 0,05 |
| Belgique/Belgium | | | 13.215.750,64 | 1,37 |
| AGEAS NOM | EUR | 284.093 | 12.125.089,24 | 1,25 |
| FINANCIERE DE TUBIZE | EUR | 10.467 | 1.090.661,40 | 0,11 |
| Bermudes/Bermuda | | | 6.769.060,42 | 0,70 |
| CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | HKD | 6.899.000 | 6.769.060,42 | 0,70 |
| Espagne/Spain | | | 1.751.996,84 | 0,18 |
| ARIMA --- BEARER SHS | EUR | 209.569 | 1.751.996,84 | 0,18 |
| États-Unis/United States of America | | | 6.861.922,32 | 0,71 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | USD | 157.460 | 5.747.455,28 | 0,59 |
| HIBBETT SPORTS | USD | 12.546 | 1.020.887,95 | 0,11 |
| PERFICIENT INC | USD | 1.341 | 93.579,09 | 0,01 |
| Finlande/Finland | | | 3.134.489,73 | 0,32 |
| CAVERION OYJ | EUR | 350.000 | 3.134.489,73 | 0,32 |
| France | | | 32.979.967,20 | 3,41 |
| AXA SA | EUR | 69.000 | 2.109.330,00 | 0,22 |
| CHRISTIAN DIOR | EUR | 18.662 | 12.531.533,00 | 1,30 |
| LAGARDERE SA | EUR | 38.509 | 797.136,30 | 0,08 |
| MEDINCELL SA | EUR | 250.563 | 3.332.487,90 | 0,34 |
| SMCP SAS | EUR | 215.000 | 399.900,00 | 0,04 |
| VIVENDI SA | EUR | 1.325.000 | 12.926.700,00 | 1,34 |
| VOYAGEURS DU MONDE SA | EUR | 6.200 | 882.880,00 | 0,09 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|---------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | | |
| HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES | USD | 122.400 | 2.471.412,18 | 0,26 |
| Italie/Italy | | | | |
| SARAS RAFFINERIE SARDE SPA | EUR | 378.838 | 613.338,72 | 0,06 |
| UNIPOLSAI AZ. POST RAGGRUPPAMENTO | EUR | 4.637.823 | 11.756.881,31 | 1,22 |
| Japon/Japan | | | | |
| BENEFIT ONE INC | JPY | 2.503 | 31.548,52 | 0,00 |
| BENESSE HOLDINGS INC | JPY | 38.945 | 587.331,80 | 0,06 |
| TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | JPY | 123.225 | 6.161.189,25 | 0,64 |
| Malte/Malta | | | | |
| KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC | SEK | 200.095 | 2.221.318,94 | 0,23 |
| Norvège/Norway | | | | |
| GRAM CAR --- REGISTERED SHS | NOK | 38.377 | 872.701,35 | 0,09 |
| PGS ASA | NOK | 385.000 | 301.616,79 | 0,03 |
| TGS ASA | NOK | 104.500 | 1.173.982,39 | 0,12 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | | |
| ADYEN | EUR | 7.312 | 8.139.718,40 | 0,84 |
| ASML HOLDING NV - BEARER/REG SHS | EUR | 9.122 | 8.795.432,40 | 0,91 |
| ASR NEDERLAND NV - REG SHS | EUR | 399.245 | 17.770.394,95 | 1,84 |
| AVANTIUM - REGISTERED | EUR | 32.861 | 84.617,08 | 0,01 |
| DSM KONINKLIJKE | EUR | 346.000 | 34.673.573,06 | 3,58 |
| ING GROUP NV | EUR | 549.812 | 8.776.099,14 | 0,91 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V. | EUR | 1.093.754 | 30.384.486,12 | 3,14 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | | |
| ALPHA FINANCIAL SHARES | GBP | 8.348 | 48.738,10 | 0,01 |
| IMPELLAM GROUP PLC | GBP | 152.000 | 529.682,66 | 0,05 |
| LOK 'N' STORE GP REGISTERED SHS | GBP | 50.100 | 649.997,05 | 0,07 |
| MATTIOLI WOODS PLC | GBP | 1.020.047 | 9.480.415,59 | 0,98 |
| TRIDENT ROYALTIES PLC | GBP | 3.417.896 | 1.922.906,63 | 0,20 |
| Suède/Sweden | | | | |
| INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE | SEK | 37.864 | 1.202.974,31 | 0,12 |
| KINNEVIK AB-RDS | SEK | 780.433 | 1.581.494,19 | 0,16 |
| KINNEVIK AB- RDS | SEK | 26.724.990 | 54.156.367,40 | 5,60 |
| Suisse/Switzerland | | | | |
| DSM-FIRMENICH LTD - REG SHS | EUR | 260.904 | 27.551.462,40 | 2,85 |
| Obligations/Bonds | | | | |
| Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles | | | | |
| SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A | EUR | 3.800.000 | 3.951.943,00 | 0,41 |
| États-Unis/United States of America | | | | |
| AVERY DENNISON CORP 1.25 17-25 03/03A | EUR | 6.000.000 | 5.899.110,00 | 0,61 |
| JEFFERIES GROUP 1.0000 19-24 19/07A | EUR | 1.200.000 | 1.198.248,00 | 0,12 |
| France | | | | |
| ARVAL SERVICE LEASE 0.8750 22-25 17/02A | EUR | 1.500.000 | 1.472.310,00 | 0,15 |
| ARVAL SERVICE LEASE 0 21-25 01/10U | EUR | 2.000.000 | 1.904.970,00 | 0,20 |
| BNP PARIBAS 3.3750 18-25 09/01S | USD | 9.100.000 | 8.383.420,10 | 0,87 |
| BUREAU VERITAS 1.8750 18-25 06/01A | EUR | 2.000.000 | 1.981.480,00 | 0,20 |
| CARMILA 2.375 16-24 16/09S | EUR | 1.500.000 | 1.494.315,00 | 0,15 |
| SEB SA 1.3750 20-25 16/06A | EUR | 7.700.000 | 7.526.673,00 | 0,78 |
| Luxembourg | | | | |
| LOGICOR FINANCING 0.6250 22-25 17/11A | EUR | 4.700.000 | 4.466.621,50 | 0,46 |
| TRATON FINANCE LUXEM 0.125 21-24 10/11A | EUR | 2.000.000 | 1.973.180,00 | 0,20 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|---------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| TRATON FINANCE LUXEM 4.1250 23-25 18/01A | EUR | 1.500.000 | 1.500.952,50 | 0,16 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 17.243.479,00 | 1,78 |
| BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A | EUR | 2.000.000 | 1.972.020,00 | 0,20 |
| EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S | EUR | 10.700.000 | 10.372.259,00 | 1,07 |
| INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A | EUR | 5.000.000 | 4.899.200,00 | 0,51 |
| Obligations à taux variables/Floating rate notes | | | 148.058.811,18 | 15,31 |
| Allemagne/Germany | | | 10.681.770,00 | 1,10 |
| DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A | EUR | 11.000.000 | 10.681.770,00 | 1,10 |
| Canada | | | 2.516.437,50 | 0,26 |
| CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q | EUR | 2.500.000 | 2.516.437,50 | 0,26 |
| Danemark/Denmark | | | 3.183.344,00 | 0,33 |
| DANSKE BANK AS FL.R 19-25 27/08A | EUR | 3.200.000 | 3.183.344,00 | 0,33 |
| Espagne/Spain | | | 11.683.178,00 | 1,21 |
| BANCA MARCH SA FL.R 21-25 17/11A | EUR | 3.200.000 | 3.182.448,00 | 0,33 |
| BANCO SANTANDER FL.R 23-25 16/01Q | EUR | 3.000.000 | 3.007.770,00 | 0,31 |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 22-26 27/09A | EUR | 5.500.000 | 5.492.960,00 | 0,57 |
| États-Unis/United States of America | | | 44.572.138,68 | 4,61 |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-26 27/10A | EUR | 2.500.000 | 2.441.037,50 | 0,25 |
| CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A | EUR | 6.100.000 | 5.956.436,50 | 0,62 |
| GOLD SACH GR FL.R 22-25 21/02Q | EUR | 3.700.000 | 3.633.293,11 | 0,38 |
| JP MORGAN CHASE FL.R 14-24 31/07Q | EUR | 8.500.000 | 8.476.136,25 | 0,88 |
| METROPOLITAN LIFE GL FL.R 22-24 20/12Q | EUR | 17.200.000 | 17.225.198,00 | 1,78 |
| WELLS FARGO FL.R 12-24 05/12Q | USD | 7.400.000 | 6.840.037,32 | 0,71 |
| France | | | 15.516.631,50 | 1,60 |
| BNP PARIBAS SA FL.R 19-25 15/07A | EUR | 5.000.000 | 4.994.000,00 | 0,52 |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 22-26 12/10A | EUR | 1.300.000 | 1.302.541,50 | 0,13 |
| SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q | EUR | 7.200.000 | 7.219.980,00 | 0,75 |
| VINCI SA FL.R 24-26 13/05Q | EUR | 2.000.000 | 2.000.110,00 | 0,21 |
| Irlande/Ireland | | | 1.995.680,00 | 0,21 |
| AIB GROUP PLC FL.R 22-26 04/07A26 04/07A | EUR | 2.000.000 | 1.995.680,00 | 0,21 |
| Japon/Japan | | | 12.580.407,00 | 1,30 |
| MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A | EUR | 12.600.000 | 12.580.407,00 | 1,30 |
| Luxembourg | | | 2.920.636,00 | 0,30 |
| OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S | EUR | 2.909.000 | 2.920.636,00 | 0,30 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 24.954.800,00 | 2,58 |
| ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A | EUR | 15.000.000 | 14.901.750,00 | 1,54 |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 18-24 16/11Q | EUR | 10.000.000 | 10.053.050,00 | 1,04 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 11.189.100,00 | 1,16 |
| LLOYDS BANKING GROUP FL.R 20-26 01/04A | EUR | 3.800.000 | 3.790.728,00 | 0,39 |
| UBS AG LONDON BRANCH FL.R 24-26 12/04Q | EUR | 7.400.000 | 7.398.372,00 | 0,76 |
| Suisse/Switzerland | | | 6.264.688,50 | 0,65 |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A | EUR | 6.300.000 | 6.264.688,50 | 0,65 |
| Obligations convertibles/Convertible bonds | | | 267.535.543,76 | 27,66 |
| Allemagne/Germany | | | 28.961.131,00 | 2,99 |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A | EUR | 15.000.000 | 14.432.025,00 | 1,49 |
| RAG-STIFTUNG CV 0 20-26 17/06U17/06U | EUR | 2.000.000 | 1.943.120,00 | 0,20 |
| TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625 20-26 27/08S | EUR | 8.300.000 | 7.613.590,00 | 0,79 |
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A | EUR | 5.200.000 | 4.972.396,00 | 0,51 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Autriche/Austria | | | | |
| AMS AGA 0.00 18-25 05/03U | EUR | 5.400.000 | 5.117.175,00 | 0,53 |
| Belgique/Belgium | | | | |
| GROUPE BRUXELLES CV 2.125 22-25 29/11A | EUR | 5.500.000 | 5.360.410,00 | 0,55 |
| MITHRA PHARMA CV 4.25 20-25 17/12S | EUR | 2.300.000 | 222.939,00 | 0,02 |
| SAGERPAR SA CV 0 21-26 01/04U1-26 01/04U | EUR | 3.200.000 | 2.980.464,00 | 0,31 |
| UMICORE SA CV 0.00 20-25 23/06U | EUR | 10.400.000 | 9.918.584,00 | 1,03 |
| Bermudes/Bermuda | | | | |
| BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A | USD | 3.600.000 | 3.306.659,21 | 0,34 |
| Espagne/Spain | | | | |
| AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S | EUR | 1.000.000 | 949.850,00 | 0,10 |
| CRITERIA CAIXA SAU CV 0 21-25 22/06U | EUR | 6.500.000 | 6.246.565,00 | 0,65 |
| France | | | | |
| ATOS SE CV 0 19-24 06/11U11U | EUR | 20.200.000 | 5.252.000,00 | 0,54 |
| BIGBEN INTERACTIVE CV 1.125 21-26 19/02S | EUR | 2.000.000 | 1.002.340,00 | 0,10 |
| CLARIANE 0.875 20-27 06/03A | EUR | 77.189 | 3.809.002,81 | 0,39 |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U | EUR | 301.846 | 18.297.451,75 | 1,89 |
| GENFIT CV DY CV 3.50 17-25 16/10S | EUR | 109.318 | 2.964.735,74 | 0,31 |
| KORIAN SA CV FL.R 21-99 31/12S | EUR | 49.860 | 1.739.723,43 | 0,18 |
| NEOEN SPA 2.00 20-25 02/06S | EUR | 96.846 | 4.588.757,17 | 0,47 |
| NEOEN SPA CV 2.875 22-27 14/09S | EUR | 3.500.000 | 3.525.900,00 | 0,36 |
| NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S | EUR | 40.948 | 2.612.424,05 | 0,27 |
| SELENA SARL CV 0.00 20-25 25/06U | EUR | 303 | 29.009.371,50 | 3,00 |
| UBISOFT ENTERTA CV 0.0 19-24 24/09U | EUR | 52.946 | 5.998.331,76 | 0,62 |
| VOLTALIA SA CV 21-25 13/01A | EUR | 168.327 | 5.135.873,25 | 0,53 |
| WENDEL CV 2.625 23-26 27/03A | EUR | 17.400.000 | 17.234.700,00 | 1,78 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 19-26 30/07U | EUR | 58.555 | 5.423.744,71 | 0,56 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 20-25 30/07 | EUR | 97.440 | 10.980.708,48 | 1,14 |
| Italie/Italy | | | | |
| NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S | EUR | 6.900.000 | 6.384.363,00 | 0,66 |
| PIRELLI AND C SPA CV 0.00 20-25 22/12U | EUR | 1.100.000 | 1.162.788,00 | 0,12 |
| SELINI CV 4.0 24-28 30/05Q | EUR | 300.000 | 295.792,50 | 0,03 |
| Jersey | | | | |
| DERWENT LONDON CV 1.50 19-25 12/06S | GBP | 13.200.000 | 15.032.291,09 | 1,55 |
| PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S | GBP | 2.500.000 | 2.879.400,84 | 0,30 |
| SIRIUS MINERALS FINA CV 5 19-27 23/05Q | USD | 1.000.000 | 1.269.120,60 | 0,13 |
| Mexique/Mexico | | | | |
| FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A | EUR | 900.000 | 892.327,50 | 0,09 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | | |
| MONDELEZ INTL HDLG NL CV 0 21-24 20/09UU | EUR | 27.800.000 | 27.552.024,00 | 2,85 |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U | USD | 10.600.000 | 9.141.121,53 | 0,95 |
| SIEMENS ENERGY FINAN CV 22-25 14/09S | EUR | 4.000.000 | 6.488.740,00 | 0,67 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | | |
| BARCLAYS BANK PLC CV 0.00 22-25 24/01A | EUR | 2.100.000 | 2.130.261,00 | 0,22 |
| CAPITAL AND COUNTIES CV 2.0 20-26 30/03S | GBP | 2.700.000 | 2.980.731,85 | 0,31 |
| Suisse/Switzerland | | | | |
| SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A | CHF | 10.400.000 | 10.687.739,99 | 1,11 |
| Warrants | | | | |
| France | | | | |
| ARVERNE GROUP 16.06.26 WAR | EUR | 170.545 | 25.581,75 | 0,00 |

HELIUM FUND - Helium Performance

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|----------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Luxembourg | | | 857,77 | 0,00 |
| BENEVOLENTAI S.A. (BENEVOL) 30.06.26 WAR | EUR | 72.000 | 720,00 | 0,00 |
| LEARND SE 15.10.26 WAR | EUR | 26.070 | 26,07 | 0,00 |
| MARLEY SPOON GROUP SE 20.01.27 WAR | EUR | 46.700 | 46,70 | 0,00 |
| SMG EUROPEAN RECOVERY 27.05.27 WAR | EUR | 65.000 | 65,00 | 0,00 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 15.625,50 | 0,00 |
| QEV TECH WT B.V. 11.11.26 WAR | EUR | 71.025 | 15.625,50 | 0,00 |
| Autres valeurs mobilières/Other transferable securities | | | 4.893.012,21 | 0,51 |
| Actions/Shares | | | 3.659.700,13 | 0,38 |
| Canada | | | 223.475,87 | 0,02 |
| FUSION PHARMACEUTICALS INC | USD | 367.807 | 188.750,97 | 0,02 |
| NEIGHBOURLY PHARMACY INC | CAD | 509.258 | 34.724,90 | 0,00 |
| États-Unis/United States of America | | | 3.436.224,18 | 0,36 |
| ALTABA INC | USD | 1.104.075 | 2.601.156,41 | 0,27 |
| CHINOOK THERAPEUTICS | USD | 149.000 | 97.317,47 | 0,01 |
| DECIBEL THERAPEUTICS INC | USD | 63.246 | 59.011,90 | 0,01 |
| ICOSAVAX INC | USD | 326.100 | 273.841,85 | 0,03 |
| INHIBRX INC | USD | 210.153 | 364.716,19 | 0,04 |
| MIRATI THERAPEUTICS INC | USD | 61.519 | 40.180,36 | 0,00 |
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | 0,08 | 0,00 |
| HEATHER VENT --- REGISTERED SHS | GBP | 250.000 | 0,04 | 0,00 |
| TAPIR --- REGISTERED SHS | GBP | 250.000 | 0,04 | 0,00 |
| Warrants | | | 0,08 | 0,00 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 0,08 | 0,00 |
| NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR | GBP | 73.274 | 0,08 | 0,00 |
| Droits/Rights | | | 1.233.312,00 | 0,13 |
| Autriche/Austria | | | 1.233.312,00 | 0,13 |
| BUWOG RIGHT | EUR | 411.104 | 1.233.312,00 | 0,13 |
| Organismes de placement collectif/Undertakings for Collective Investment | | | 12.039.060,00 | 1,24 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements/Shares/Units in investment funds | | | 12.039.060,00 | 1,24 |
| Luxembourg | | | 12.039.060,00 | 1,24 |
| HELIUM ALPHA -C-EUR- CAP | EUR | 10.000 | 12.039.060,00 | 1,24 |
| Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio | | | 924.080.732,88 | 95,54 |

HELIUM FUND - Helium Selection

HELIUM FUND - Helium Selection

Etat des actifs nets au 30/06/24/Statement of net assets as at 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Actifs/Assets | 879.090.018,78 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/ <i>Securities portfolio at market value</i> | 784.478.816,26 |
| <i>Prix de revient/Cost price</i> | 804.011.410,34 |
| Options (positions longues) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (long positions) at market value</i> | 419.127,49 |
| <i>Options achetées au prix de revient/Options purchased at cost</i> | 439.479,53 |
| Avoirs en banque et liquidités/ <i>Cash at banks and liquidities</i> | 57.544.196,51 |
| A recevoir sur investissements vendus/ <i>Receivable for investments sold</i> | 1.781.580,55 |
| A recevoir sur souscriptions/ <i>Receivable on subscriptions</i> | 1.146.282,81 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/ <i>Net unrealised appreciation on financial futures</i> | 3.271.203,04 |
| Plus-value nette non réalisée sur swaps/ <i>Net unrealised appreciation on swaps</i> | 12.270.139,92 |
| Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Dividends receivable on securities portfolio</i> | 2.377.926,16 |
| Dividendes à recevoir sur swaps/ <i>Dividends receivable on swaps</i> | 826.989,82 |
| Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Interests receivable on securities portfolio</i> | 2.186.502,08 |
| Intérêts à recevoir sur swaps/ <i>Interests receivable on swaps</i> | 175.224,91 |
| Autres intérêts à recevoir/ <i>Other interests receivable</i> | 83.286,55 |
| A recevoir sur change/ <i>Receivable on foreign exchange</i> | 12.076.109,14 |
| Autres actifs/ <i>Other assets</i> | 452.633,54 |
| Passifs/Liabilities | 43.606.079,56 |
| Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (short positions) at market value</i> | 765.907,47 |
| <i>Options vendues au prix de revient/Options sold at cost</i> | 949.203,72 |
| Découvert bancaire/ <i>Bank overdrafts</i> | 17.067.932,80 |
| A payer sur investissements achetés/ <i>Payable on investments purchased</i> | 3.994.559,60 |
| A payer sur rachats/ <i>Payable on redemptions</i> | 4.959.569,95 |
| Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/ <i>Net unrealised depreciation on forward foreign exchange contracts</i> | 2.060.200,37 |
| Commissions de gestion à payer/ <i>Management fees payable</i> | 825.044,25 |
| Commissions de performance à payer/ <i>Performance fees payable</i> | 29.067,60 |
| Dividendes à payer sur swaps/ <i>Dividends payable on swaps</i> | 1.629.418,04 |
| Intérêts à payer sur swaps/ <i>Interests payable on swaps</i> | 123.294,99 |
| Autres intérêts à payer/ <i>Other interests payable</i> | 4.380,90 |
| A payer sur change/ <i>Payable on foreign exchange</i> | 12.059.195,72 |
| Autres passifs/ <i>Other liabilities</i> | 87.507,87 |
| Valeur nette d'inventaire/Net asset value | 835.483.939,22 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/24 au 30/06/24/*Statement of operations and changes in net assets from 01/01/24 to 30/06/24*

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Revenus/Income | 21.738.315,35 |
| Dividendes sur portefeuille-titres, nets/ <i>Dividends on securities portfolio, net</i> | 8.132.835,16 |
| Dividendes reçus sur swaps/ <i>Dividends received on swaps</i> | 2.187.871,38 |
| Intérêts reçus sur obligations, nets/ <i>Interests on bonds, net</i> | 4.243.963,52 |
| Intérêts reçus sur swaps/ <i>Interests received on swaps</i> | 5.172.122,54 |
| Intérêts bancaires/ <i>Bank interests on cash accounts</i> | 1.745.226,31 |
| Autres revenus/ <i>Other income</i> | 256.296,44 |
| Dépenses/Expenses | 18.859.988,13 |
| Commissions de gestion/ <i>Management fees</i> | 5.008.694,45 |
| Commissions de performance/ <i>Performance fees</i> | 29.067,60 |
| Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/ <i>Depositary and sub-depositary fees</i> | 107.678,26 |
| Commissions d'administration/ <i>Administration fees</i> | 201.667,13 |
| Frais de domiciliation/ <i>Domiciliary fees</i> | 1.087,73 |
| Frais d'audit/ <i>Audit fees</i> | 27.984,19 |
| Frais légaux/ <i>Legal fees</i> | 23.854,02 |
| Frais de transaction/ <i>Transaction fees</i> | 307.905,58 |
| Rémunération administrateurs/ <i>Directors fees</i> | 5.453,18 |
| Taxe d'abonnement/ <i>Subscription tax</i> | 97.121,24 |
| Intérêts payés sur découvert bancaire/ <i>Interests paid on bank overdraft</i> | 708.792,53 |
| Dividendes payés sur swaps/ <i>Dividends paid on swaps</i> | 6.970.575,99 |
| Intérêts payés sur swaps/ <i>Interests paid on swaps</i> | 5.248.527,18 |
| Frais bancaires/ <i>Banking fees</i> | 505,92 |
| Autres dépenses/ <i>Other expenses</i> | 121.073,13 |
| Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments | 2.878.327,22 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on: | |
| - ventes d'investissements/- <i>sales of investment securities</i> | 3.610.590,84 |
| - options | 847.722,43 |
| - contrats de change à terme/- <i>forward foreign exchange contracts</i> | -9.364.540,66 |
| - contrats futures/- <i>financial futures</i> | 9.240.752,38 |
| - swaps | -2.098.788,53 |
| - change/- <i>foreign exchange</i> | 25.121.400,12 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss) | 30.235.463,80 |
| Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on: | |
| - ventes d'investissements/- <i>investments</i> | -26.130.797,53 |
| - options | 283.463,21 |
| - contrats de change à terme/- <i>forward foreign exchange contracts</i> | 176.485,54 |
| - contrats futures/- <i>financial futures</i> | -4.906.946,51 |
| - swaps | 6.679.595,12 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations | 6.337.263,63 |
| Souscriptions d'actions/ <i>Subscriptions of shares</i> | 264.253.900,03 |
| Rachats d'actions/ <i>Redemptions of shares</i> | -143.132.859,59 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets | 127.458.304,07 |
| Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period | 708.025.635,15 |
| Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period | 835.483.939,22 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Statistiques/*Statistics*

| | | 30/06/24 | 31/12/23 | 31/12/22 |
|------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i> | EUR | 835.483.939,22 | 708.025.635,15 | 469.171.142,72 |
| A - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 130.781,856 | 98.591,439 | 81.361,276 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.703,26 | 1.670,82 | 1.558,08 |
| B - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 148.677,958 | 123.606,402 | 68.692,402 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.617,56 | 1.590,96 | 1.490,13 |
| S - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 120.624,270 | 95.803,974 | 104.239,510 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.782,35 | 1.746,23 | 1.623,15 |
| C - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 14.713,436 | 12.463,967 | 11.910,813 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 2.089,08 | 2.037,16 | 1.868,60 |
| Bcl - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 23.015,876 | 43.879,056 | 18.971,430 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.354,33 | 1.328,67 | 1.239,48 |
| A - CHF | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 1.772,893 | 1.148,185 | 644,970 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | CHF | 1.330,46 | 1.320,84 | 1.257,39 |
| A - JPY | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 123.801,045 | 123.801,045 | - |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | JPY | 103.338,00 | 103.226,00 | - |
| A - USD | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 12.997,735 | 8.817,613 | 18.882,865 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | USD | 1.539,75 | 1.498,98 | 1.370,86 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/24 au 30/06/24/Changes in number of shares outstanding from 01/01/24 to 30/06/24

| | Nombre d'actions au 01/01/24 <i>Shares outstanding as at 01/01/24</i> | Nombre d'actions émises <i>Shares issued</i> | Nombre d'actions rachetées <i>Shares redeemed</i> | Nombre d'actions au 30/06/24 <i>Shares outstanding as at 30/06/24</i> |
|------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| A - EUR | 98.591,439 | 66.262,914 | 34.072,497 | 130.781,856 |
| B - EUR | 123.606,402 | 37.784,350 | 12.712,794 | 148.677,958 |
| S - EUR | 95.803,974 | 37.352,378 | 12.532,082 | 120.624,270 |
| C - EUR | 12.463,967 | 3.284,769 | 1.035,300 | 14.713,436 |
| Bcl - EUR | 43.879,056 | 8.296,203 | 29.159,383 | 23.015,876 |
| A - CHF | 1.148,185 | 722,003 | 97,295 | 1.772,893 |
| A - JPY | 123.801,045 | 0,000 | 0,000 | 123.801,045 |
| A - USD | 8.817,613 | 5.935,940 | 1.755,818 | 12.997,735 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé/Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market | | | 782.456.534,16 | 93,65 |
| Actions/Shares | | | 377.886.238,66 | 45,23 |
| Allemagne/Germany | | | 121.143.957,48 | 14,50 |
| AAREAL BANK --- REGISTERED SHS | EUR | 12.237 | 442.979,40 | 0,05 |
| ADIDAS AG - REG SHS | EUR | 33.594 | 7.491.462,00 | 0,90 |
| ADTRAN NETWORKS SE | EUR | 38.646 | 764.417,88 | 0,09 |
| ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE | EUR | 14.703 | 3.815.428,50 | 0,46 |
| BAYER AG REG SHS | EUR | 314.627 | 8.299.860,26 | 0,99 |
| COMMERZBK | EUR | 255.501 | 3.624.281,69 | 0,43 |
| COVESTRO AG | EUR | 72.784 | 3.988.563,20 | 0,48 |
| DEUTSCHE POST AG REG SHS | EUR | 196.823 | 7.437.941,17 | 0,89 |
| E.ON SE | EUR | 1.364.447 | 16.721.297,99 | 2,00 |
| ENCAVIS --- BEARER SHS | EUR | 38.569 | 659.529,90 | 0,08 |
| GEA GROUP AG - INHABER-AKT | EUR | 38.957 | 1.515.427,30 | 0,18 |
| HOCHTIEF AG | EUR | 25.149 | 2.670.823,80 | 0,32 |
| MERCK KGAA - BEARER SHS | EUR | 10.978 | 1.698.845,50 | 0,20 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS | EUR | 8.157 | 3.809.319,00 | 0,46 |
| OHB AG | EUR | 9.077 | 394.849,50 | 0,05 |
| OHB SE | EUR | 71.156 | 3.102.401,60 | 0,37 |
| PFEIFF VACUUM TECHNOLOGY | EUR | 7.683 | 1.210.840,80 | 0,14 |
| RWE AG | EUR | 214.908 | 6.866.310,60 | 0,82 |
| SAP AG | EUR | 73.162 | 13.865.662,24 | 1,66 |
| SCHALTBAU HLDG --- REGISTERED SHS | EUR | 14.907 | 857.152,50 | 0,10 |
| SCOUT24 | EUR | 72.369 | 5.152.672,80 | 0,62 |
| SIEMENS ENERGY - REG SHS | EUR | 79.965 | 1.943.949,15 | 0,23 |
| SILICON SENSOR INTL AG | EUR | 57.121 | 3.450.108,40 | 0,41 |
| SOFTWARE | EUR | 72.211 | 2.599.596,00 | 0,31 |
| SYNLAB AG | EUR | 81.547 | 913.326,40 | 0,11 |
| VANTAGE TOWERS AG | EUR | 61.565 | 2.345.626,50 | 0,28 |
| VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT | EUR | 147.071 | 15.501.283,40 | 1,86 |
| Australie/Australia | | | 581.006,98 | 0,07 |
| CSR LTD | AUD | 105.000 | 581.006,98 | 0,07 |
| Belgique/Belgium | | | 43.935.389,31 | 5,26 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | EUR | 677.361 | 36.658.777,32 | 4,39 |
| FINANCIERE DE TUBIZE | EUR | 17.889 | 1.864.033,80 | 0,22 |
| SYENSQO SA/NV | EUR | 64.767 | 5.412.578,19 | 0,65 |
| Bermudes/Bermuda | | | 11.666.057,17 | 1,40 |
| CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | HKD | 11.890.000 | 11.666.057,17 | 1,40 |
| Espagne/Spain | | | 1.482.236,36 | 0,18 |
| ARIMA --- BEARER SHS | EUR | 177.301 | 1.482.236,36 | 0,18 |
| États-Unis/United States of America | | | 7.401.464,70 | 0,89 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | USD | 169.687 | 6.193.753,62 | 0,74 |
| HIBBETT SPORTS | USD | 13.601 | 1.106.734,98 | 0,13 |
| PERFICIENT INC | USD | 1.447 | 100.976,10 | 0,01 |
| Finlande/Finland | | | 2.575.359,45 | 0,31 |
| CAVERION OYJ | EUR | 287.567 | 2.575.359,45 | 0,31 |
| France | | | 35.851.072,70 | 4,29 |
| AXA SA | EUR | 37.000 | 1.131.090,00 | 0,14 |
| CHRISTIAN DIOR | EUR | 6.423 | 4.313.044,50 | 0,52 |
| LAGARDERE SA | EUR | 29.831 | 617.501,70 | 0,07 |
| MEDINCELL SA | EUR | 430.105 | 5.720.396,50 | 0,68 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|---------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| SMCP SAS | EUR | 372.000 | 691.920,00 | 0,08 |
| VIVENDI SA | EUR | 2.240.000 | 21.853.440,00 | 2,62 |
| VOYAGEURS DU MONDE SA | EUR | 10.700 | 1.523.680,00 | 0,18 |
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | 1.900.927,87 | 0,23 |
| HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES | USD | 94.146 | 1.900.927,87 | 0,23 |
| Italie/Italy | | | 667.814,83 | 0,08 |
| SARAS RAFFINERIE SARDE SPA | EUR | 412.486 | 667.814,83 | 0,08 |
| Japon/Japan | | | 5.416.936,99 | 0,65 |
| BENEFIT ONE INC | JPY | 2.002 | 25.233,78 | 0,00 |
| BENESSE HOLDINGS INC | JPY | 31.049 | 468.251,76 | 0,06 |
| TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | JPY | 98.470 | 4.923.451,45 | 0,59 |
| Malte/Malta | | | 2.481.311,89 | 0,30 |
| KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC | SEK | 223.515 | 2.481.311,89 | 0,30 |
| Norvège/Norway | | | 3.054.900,84 | 0,37 |
| GRAM CAR --- REGISTERED SHS | NOK | 33.478 | 761.297,02 | 0,09 |
| PGS ASA | NOK | 335.000 | 262.445,78 | 0,03 |
| TGS ASA | NOK | 180.800 | 2.031.158,04 | 0,24 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 78.407.829,60 | 9,38 |
| ADYEN | EUR | 7.125 | 7.931.550,00 | 0,95 |
| ASML HOLDING NV - BEARER/REG SHS | EUR | 8.889 | 8.570.773,80 | 1,03 |
| AVANTIUM - REGISTERED | EUR | 85.015 | 218.913,63 | 0,03 |
| DSM KONINKLIJKE | EUR | 184.000 | 18.439.125,56 | 2,21 |
| EXOR REG | EUR | 76.329 | 7.457.343,30 | 0,89 |
| ING GROUP NV | EUR | 535.713 | 8.551.050,91 | 1,02 |
| WOLTERS KLUWER NV - BEARER/REG SHS | EUR | 175.963 | 27.239.072,40 | 3,26 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 13.227.264,54 | 1,58 |
| ALPHA FINANCIAL SHARES | GBP | 8.908 | 52.007,55 | 0,01 |
| IMPELLAM GROUP PLC | GBP | 121.000 | 421.655,27 | 0,05 |
| LOK 'N' STORE GP REGISTERED SHS | GBP | 53.430 | 693.200,45 | 0,08 |
| MATTIOLI WOODS PLC | GBP | 1.116.295 | 10.374.953,82 | 1,24 |
| TRIDENT ROYALTIES PLC | GBP | 2.995.821 | 1.685.447,45 | 0,20 |
| Suède/Sweden | | | 48.092.707,95 | 5,76 |
| INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE | SEK | 33.512 | 1.064.707,24 | 0,13 |
| KINNEVIK AB-RDS | SEK | 657.014 | 1.331.394,01 | 0,16 |
| KINNEVIK AB- RDS | SEK | 22.550.282 | 45.696.606,70 | 5,47 |
| Obligations/Bonds | | | 44.082.526,74 | 5,28 |
| Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles | | | 3.223.953,50 | 0,39 |
| SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A | EUR | 3.100.000 | 3.223.953,50 | 0,39 |
| États-Unis/United States of America | | | 5.914.465,00 | 0,71 |
| AVERY DENNISON CORP 1.25 17-25 03/03A | EUR | 5.000.000 | 4.915.925,00 | 0,59 |
| JEFFERIES GROUP 1.0000 19-24 19/07A | EUR | 1.000.000 | 998.540,00 | 0,12 |
| France | | | 17.930.371,24 | 2,15 |
| ARVAL SERVICE LEASE 0.8750 22-25 17/02A | EUR | 2.000.000 | 1.963.080,00 | 0,23 |
| ARVAL SERVICE LEASE 0 21-25 01/10U | EUR | 1.000.000 | 952.485,00 | 0,11 |
| BNP PARIBAS 3.3750 18-25 09/01S | USD | 5.900.000 | 5.435.404,24 | 0,65 |
| SEB SA 1.3750 20-25 16/06A | EUR | 9.800.000 | 9.579.402,00 | 1,15 |
| Luxembourg | | | 3.841.612,00 | 0,46 |
| LOGICOR FINANCING 0.6250 22-25 17/11A | EUR | 3.200.000 | 3.041.104,00 | 0,36 |
| TRATON FINANCE LUXEM 4.1250 23-25 18/01A | EUR | 800.000 | 800.508,00 | 0,10 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|---------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 13.172.125,00 | 1,58 |
| BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A | EUR | 2.000.000 | 1.972.020,00 | 0,24 |
| EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S | EUR | 6.500.000 | 6.300.905,00 | 0,75 |
| INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A | EUR | 5.000.000 | 4.899.200,00 | 0,59 |
| Obligations à taux variables/Floating rate notes | | | 143.933.232,72 | 17,23 |
| Allemagne/Germany | | | 9.225.165,00 | 1,10 |
| DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A | EUR | 9.500.000 | 9.225.165,00 | 1,10 |
| Canada | | | 1.912.492,50 | 0,23 |
| CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q | EUR | 1.900.000 | 1.912.492,50 | 0,23 |
| Danemark/Denmark | | | 7.460.962,50 | 0,89 |
| DANSKE BANK AS FL.R 19-25 27/08A | EUR | 7.500.000 | 7.460.962,50 | 0,89 |
| Espagne/Spain | | | 8.396.863,50 | 1,01 |
| BANCA MARCH SA FL.R 21-25 17/11A | EUR | 900.000 | 895.063,50 | 0,11 |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 20-25 11/02Q | EUR | 3.000.000 | 3.007.560,00 | 0,36 |
| BANCO SANTANDER SA FL.R 22-26 27/09A | EUR | 4.500.000 | 4.494.240,00 | 0,54 |
| États-Unis/United States of America | | | 31.388.562,12 | 3,76 |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-26 27/10A | EUR | 2.500.000 | 2.441.037,50 | 0,29 |
| CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A | EUR | 6.000.000 | 5.858.790,00 | 0,70 |
| GOLD SACH GR FL.R 22-25 21/02Q | EUR | 3.000.000 | 2.945.913,33 | 0,35 |
| JP MORGAN CHASE FL.R 14-24 31/07Q | EUR | 4.000.000 | 3.988.770,00 | 0,48 |
| METROPOLITAN LIFE GL FL.R 22-24 20/12Q | EUR | 12.900.000 | 12.918.898,50 | 1,55 |
| WELLS FARGO FL.R 12-24 05/12Q | USD | 3.500.000 | 3.235.152,79 | 0,39 |
| France | | | 21.208.770,00 | 2,54 |
| BNP PARIBAS SA FL.R 19-25 15/07A | EUR | 10.400.000 | 10.387.520,00 | 1,24 |
| CREDIT AGRICOLE SA FL.R 22-26 12/10A | EUR | 4.000.000 | 4.007.820,00 | 0,48 |
| SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q | EUR | 4.800.000 | 4.813.320,00 | 0,58 |
| VINCI SA FL.R 24-26 13/05Q | EUR | 2.000.000 | 2.000.110,00 | 0,24 |
| Irlande/Ireland | | | 12.531.050,00 | 1,50 |
| AIB GROUP PLC FL.R 22-26 04/07A26 04/07A | EUR | 2.500.000 | 2.494.600,00 | 0,30 |
| CA AUTO BANK SPA IR FL.R 23-25 13/01Q | EUR | 10.000.000 | 10.036.450,00 | 1,20 |
| Japon/Japan | | | 6.140.436,75 | 0,73 |
| MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A | EUR | 6.150.000 | 6.140.436,75 | 0,73 |
| Luxembourg | | | 2.201.772,00 | 0,26 |
| OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S | EUR | 2.193.000 | 2.201.772,00 | 0,26 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 26.307.768,00 | 3,15 |
| ING GROEP NV FL.R 21-25 29/11A | EUR | 4.400.000 | 4.333.318,00 | 0,52 |
| ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A | EUR | 12.000.000 | 11.921.400,00 | 1,43 |
| VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 18-24 16/11Q | EUR | 10.000.000 | 10.053.050,00 | 1,20 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 10.588.788,00 | 1,27 |
| LLOYDS BANKING GROUP FL.R 20-26 01/04A | EUR | 4.000.000 | 3.990.240,00 | 0,48 |
| UBS AG LONDON BRANCH FL.R 24-26 12/04Q | EUR | 6.600.000 | 6.598.548,00 | 0,79 |
| Suisse/Switzerland | | | 6.570.602,35 | 0,79 |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A | EUR | 5.200.000 | 5.170.854,00 | 0,62 |
| UBS GROUP SA FL.R 20-26 29/01A | EUR | 1.430.000 | 1.399.748,35 | 0,17 |
| Obligations convertibles/Convertible bonds | | | 216.511.187,13 | 25,91 |
| Allemagne/Germany | | | 26.594.555,00 | 3,18 |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A | EUR | 13.000.000 | 12.507.755,00 | 1,50 |
| RAG-STIFTUNG CV 0.00 18-24 02/10U | EUR | 800.000 | 791.668,00 | 0,09 |
| RAG-STIFTUNG CV 0 20-26 17/06U17/06U | EUR | 3.500.000 | 3.400.460,00 | 0,41 |
| TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625 20-26 27/08S | EUR | 6.200.000 | 5.687.260,00 | 0,68 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A | EUR | 4.400.000 | 4.207.412,00 | 0,50 |
| Autriche/Austria | | | 4.169.550,00 | 0,50 |
| AMS AGA 0.00 18-25 05/03U | EUR | 4.400.000 | 4.169.550,00 | 0,50 |
| Belgique/Belgium | | | 27.628.440,50 | 3,31 |
| GROUPE BRUXELLES CV 2.125 22-25 29/11A | EUR | 16.700.000 | 16.276.154,00 | 1,95 |
| MITHRA PHARMA CV 4.25 20-25 17/12S | EUR | 700.000 | 67.851,00 | 0,01 |
| SAGERPAR SA CV 0 21-26 01/04U1-26 01/04U | EUR | 2.900.000 | 2.701.045,50 | 0,32 |
| UMICORE SA CV 0.00 20-25 23/06U | EUR | 9.000.000 | 8.583.390,00 | 1,03 |
| Bermudes/Bermuda | | | 2.755.549,33 | 0,33 |
| BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A | USD | 3.000.000 | 2.755.549,33 | 0,33 |
| Espagne/Spain | | | 6.623.157,00 | 0,79 |
| AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S | EUR | 700.000 | 664.895,00 | 0,08 |
| CRITERIA CAIXA SAU CV 0 21-25 22/06U | EUR | 6.200.000 | 5.958.262,00 | 0,71 |
| France | | | 86.077.610,81 | 10,30 |
| ATOS SE CV 0 19-24 06/11U11U | EUR | 17.300.000 | 4.498.000,00 | 0,54 |
| BIGBEN INTERACTIVE CV 1.125 21-26 19/02S | EUR | 1.400.000 | 701.638,00 | 0,08 |
| CLARIANE 0.875 20-27 06/03A | EUR | 58.710 | 2.897.129,85 | 0,35 |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U | EUR | 259.797 | 15.748.504,44 | 1,88 |
| GENFIT CV DY CV 3.50 17-25 16/10S | EUR | 93.001 | 2.522.213,99 | 0,30 |
| KORIAN SA CV FL.R 21-99 31/12S | EUR | 41.280 | 1.440.348,64 | 0,17 |
| NEOEN SPA 2.00 20-25 02/06S | EUR | 80.871 | 3.831.829,72 | 0,46 |
| NEOEN SPA CV 2.875 22-27 14/09S | EUR | 2.500.000 | 2.518.500,00 | 0,30 |
| NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S | EUR | 29.159 | 1.860.302,64 | 0,22 |
| SELENA SARL CV 0.00 20-25 25/06U | EUR | 254 | 24.318.087,00 | 2,91 |
| UBISOFT ENTERTA CV 0.0 19-24 24/09U | EUR | 42.529 | 4.818.174,20 | 0,58 |
| VOLTALIA SA CV 21-25 13/01A | EUR | 128.370 | 3.916.733,79 | 0,47 |
| WENDEL CV 2.625 23-26 27/03A | EUR | 14.400.000 | 14.263.200,00 | 1,71 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 19-26 30/07U | EUR | 29.613 | 2.742.948,54 | 0,33 |
| Italie/Italy | | | 7.353.946,50 | 0,88 |
| NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S | EUR | 6.600.000 | 6.106.782,00 | 0,73 |
| PIRELLI AND C SPA CV 0.00 20-25 22/12U | EUR | 900.000 | 951.372,00 | 0,11 |
| SELINI CV 4.0 24-28 30/05Q | EUR | 300.000 | 295.792,50 | 0,04 |
| Jersey | | | 13.765.921,25 | 1,65 |
| DERWENT LONDON CV 1.50 19-25 12/06S | GBP | 9.700.000 | 11.046.456,33 | 1,32 |
| PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S | GBP | 1.700.000 | 1.957.992,56 | 0,23 |
| SIRIUS MINERALS FINA CV 5 19-27 23/05Q | USD | 600.000 | 761.472,36 | 0,09 |
| Mexique/Mexico | | | 694.032,50 | 0,08 |
| FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A | EUR | 700.000 | 694.032,50 | 0,08 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 35.407.651,21 | 4,24 |
| MONDELEZ INTL HDLG NL CV 0 21-24 20/09UU | EUR | 23.600.000 | 23.389.488,00 | 2,80 |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U | USD | 6.600.000 | 5.691.641,71 | 0,68 |
| SIEMENS ENERGY FINAN CV 22-25 14/09S | EUR | 3.900.000 | 6.326.521,50 | 0,76 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 3.693.738,61 | 0,44 |
| BARCLAYS BANK PLC CV 0.00 22-25 24/01A | EUR | 1.900.000 | 1.927.379,00 | 0,23 |
| CAPITAL AND COUNTIES CV 2.0 20-26 30/03S | GBP | 1.600.000 | 1.766.359,61 | 0,21 |
| Suisse/Switzerland | | | 1.747.034,42 | 0,21 |
| SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A | CHF | 1.700.000 | 1.747.034,42 | 0,21 |
| Warrants | | | 43.348,91 | 0,01 |
| France | | | 32.081,40 | 0,00 |
| ARVERNE GROUP 16.06.26 WAR | EUR | 213.876 | 32.081,40 | 0,00 |

HELIUM FUND - Helium Selection

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|----------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Luxembourg | | | 476,51 | 0,00 |
| BENEVOLENTAI S.A. (BENEVOL) 30.06.26 WAR | EUR | 42.624 | 426,24 | 0,00 |
| LEARND SE 15.10.26 WAR | EUR | 17.765 | 17,77 | 0,00 |
| MARLEY SPOON GROUP SE 20.01.27 WAR | EUR | 32.500 | 32,50 | 0,00 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 10.791,00 | 0,00 |
| QEV TECH WT B.V. 11.11.26 WAR | EUR | 49.050 | 10.791,00 | 0,00 |
| Autres valeurs mobilières/Other transferable securities | | | 2.022.282,10 | 0,24 |
| Actions/Shares | | | 1.872.282,04 | 0,22 |
| Canada | | | 231.003,89 | 0,03 |
| FUSION PHARMACEUTICALS INC | USD | 396.534 | 203.493,07 | 0,02 |
| NEIGHBOURLY PHARMACY INC | CAD | 403.460 | 27.510,82 | 0,00 |
| États-Unis/United States of America | | | 1.641.278,11 | 0,20 |
| ALTABA INC | USD | 386.000 | 909.400,51 | 0,11 |
| CHINOOK THERAPEUTICS | USD | 87.000 | 56.822,95 | 0,01 |
| DECIBEL THERAPEUTICS INC | USD | 36.969 | 34.494,05 | 0,00 |
| ICOSAVAX INC | USD | 279.500 | 234.709,59 | 0,03 |
| INHIBRX INC | USD | 219.427 | 380.811,03 | 0,05 |
| MIRATI THERAPEUTICS INC | USD | 38.338 | 25.039,98 | 0,00 |
| Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands | | | 0,04 | 0,00 |
| HEATHER VENT --- REGISTERED SHS | GBP | 165.000 | 0,02 | 0,00 |
| TAPIR --- REGISTERED SHS | GBP | 165.000 | 0,02 | 0,00 |
| Warrants | | | 0,06 | 0,00 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 0,06 | 0,00 |
| NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR | GBP | 46.538 | 0,06 | 0,00 |
| Droits/Rights | | | 150.000,00 | 0,02 |
| Autriche/Austria | | | 150.000,00 | 0,02 |
| BUWOG RIGHT | EUR | 50.000 | 150.000,00 | 0,02 |
| Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio | | | 784.478.816,26 | 93,90 |

HELIUM FUND - Helium Invest

HELIUM FUND - Helium Invest

Etat des actifs nets au 30/06/24/Statement of net assets as at 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Actifs/Assets | 249.943.831,56 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/ <i>Securities portfolio at market value</i> | 231.478.711,50 |
| <i>Prix de revient/Cost price</i> | 231.752.577,70 |
| Avoirs en banque et liquidités/ <i>Cash at banks and liquidities</i> | 15.207.885,04 |
| A recevoir sur souscriptions/ <i>Receivable on subscriptions</i> | 80.197,85 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/ <i>Net unrealised appreciation on forward foreign exchange contracts</i> | 69.666,75 |
| Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/ <i>Net unrealised appreciation on financial futures</i> | 163.950,00 |
| Plus-value nette non réalisée sur swaps/ <i>Net unrealised appreciation on swaps</i> | 1.991.334,84 |
| Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Dividends receivable on securities portfolio</i> | 165.222,23 |
| Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/ <i>Interests receivable on securities portfolio</i> | 766.237,22 |
| Intérêts à recevoir sur swaps/ <i>Interests receivable on swaps</i> | 11.316,83 |
| Autres intérêts à recevoir/ <i>Other interests receivable</i> | 9.309,30 |
| Passifs/Liabilities | 2.000.795,44 |
| Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/ <i>Options (short positions) at market value</i> | 125.250,00 |
| <i>Options vendues au prix de revient/Options sold at cost</i> | 283.750,00 |
| Découvert bancaire/ <i>Bank overdrafts</i> | 158.209,83 |
| A payer sur rachats/ <i>Payable on redemptions</i> | 489.253,55 |
| Commissions de gestion à payer/ <i>Management fees payable</i> | 141.350,99 |
| Dividendes à payer sur swaps/ <i>Dividends payable on swaps</i> | 694.971,92 |
| Intérêts à payer sur swaps/ <i>Interests payable on swaps</i> | 349.274,40 |
| Autres passifs/ <i>Other liabilities</i> | 42.484,75 |
| Valeur nette d'inventaire/Net asset value | 247.943.036,12 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/24 au 30/06/24/Statement of operations and changes in net assets from 01/01/24 to 30/06/24

| | <i>Exprimé en Expressed in EUR</i> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Revenus/Income | 7.144.399,83 |
| Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net | 380.424,46 |
| Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps | 312.747,87 |
| Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net | 1.825.257,12 |
| Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps | 4.188.819,40 |
| Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts | 431.371,94 |
| Autres revenus/Other income | 5.779,04 |
| Dépenses/Expenses | 10.379.718,40 |
| Commissions de gestion/Management fees | 922.367,80 |
| Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depositary and sub-depositary fees | 28.978,61 |
| Commissions d'administration/Administration fees | 58.296,25 |
| Frais de domiciliation/Domiciliary fees | 1.087,73 |
| Amortissement des frais d'établissement/Amortisation of formation expenses | 1.882,38 |
| Frais d'audit/Audit fees | 9.885,25 |
| Frais légaux/Legal fees | 8.981,50 |
| Frais de transaction/Transaction fees | 8.381,92 |
| Rémunération administrateurs/Directors fees | 2.030,28 |
| Taxe d'abonnement/Subscription tax | 24.169,52 |
| Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft | 197.043,35 |
| Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps | 1.105.812,00 |
| Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps | 7.985.327,66 |
| Frais bancaires/Banking fees | 296,87 |
| Autres dépenses/Other expenses | 25.177,28 |
| Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments | -3.235.318,57 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on: | |
| - ventes d'investissements/- sales of investment securities | -6.806.307,31 |
| - options | 772.578,00 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | 497.187,86 |
| - contrats futures/- financial futures | 418.555,00 |
| - swaps | -319.221,58 |
| - change/- foreign exchange | 6.329.864,59 |
| Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss) | -2.342.662,01 |
| Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on: | |
| - ventes d'investissements/- investments | 2.260.876,07 |
| - options | 1.153.364,00 |
| - contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts | 54.104,32 |
| - contrats futures/- financial futures | 433.570,00 |
| - swaps | -575.836,44 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations | 983.415,94 |
| Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares | 101.109.459,82 |
| Rachats d'actions/Redemptions of shares | -97.559.850,75 |
| Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets | 4.533.025,01 |
| Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period | 243.410.011,11 |
| Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period | 247.943.036,12 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Statistiques/*Statistics*

| | | 30/06/24 | 31/12/23 | 31/12/22 |
|------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i> | EUR | 247.943.036,12 | 243.410.011,11 | 205.892.520,01 |
| A - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 80.212,183 | 36.123,076 | 14.174,737 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.277,87 | 1.276,77 | 1.196,92 |
| A - USD | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 12.490,929 | 8.767,209 | 5.684,204 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | USD | 1.363,47 | 1.352,55 | 1.243,13 |
| B - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 26.864,261 | 30.573,064 | 22.751,894 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.244,82 | 1.247,05 | 1.175,38 |
| S - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 48.749,912 | 48.744,204 | 56.649,654 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.284,15 | 1.282,40 | 1.200,98 |
| C - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 14.694,297 | 18.581,680 | 23.018,306 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.359,94 | 1.353,98 | 1.260,30 |
| Bcl - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 3.732,869 | 3.921,312 | 2.753,485 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.275,43 | 1.274,58 | 1.195,29 |
| D - EUR | | | | |
| Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i> | | 6.763,521 | 43.023,218 | 45.341,097 |
| Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i> | EUR | 1.295,69 | 1.296,08 | 1.218,04 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/24 au 30/06/24/*Changes in number of shares outstanding from 01/01/24 to 30/06/24*

| | Nombre d'actions au 01/01/24 <i>Shares outstanding as at 01/01/24</i> | Nombre d'actions émises <i>Shares issued</i> | Nombre d'actions rachetées <i>Shares redeemed</i> | Nombre d'actions au 30/06/24 <i>Shares outstanding as at 30/06/24</i> |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| A - EUR | 36.123,076 | 53.553,898 | 9.464,791 | 80.212,183 |
| A - USD | 8.767,209 | 3.723,720 | 0,000 | 12.490,929 |
| B - EUR | 30.573,064 | 2.226,648 | 5.935,451 | 26.864,261 |
| S - EUR | 48.744,204 | 18.148,369 | 18.142,661 | 48.749,912 |
| C - EUR | 18.581,680 | 1.123,814 | 5.011,197 | 14.694,297 |
| Bcl - EUR | 3.921,312 | 811,008 | 999,451 | 3.732,869 |
| D - EUR | 43.023,218 | 642,087 | 36.901,784 | 6.763,521 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé/Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market | | | 231.468.914,44 | 93,36 |
| Actions/Shares | | | 22.704.375,44 | 9,16 |
| Finlande/Finland | | | 895.568,49 | 0,36 |
| CAVERION OYJ | EUR | 100.000 | 895.568,49 | 0,36 |
| Japon/Japan | | | 1.532.343,39 | 0,62 |
| BENEFIT ONE INC | JPY | 622 | 7.839,86 | 0,00 |
| BENESSE HOLDINGS INC | JPY | 1.891 | 28.518,28 | 0,01 |
| TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | JPY | 29.920 | 1.495.985,25 | 0,60 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 6.864.565,76 | 2,77 |
| DSM KONINKLIJKE | EUR | 68.500 | 6.864.565,76 | 2,77 |
| Suède/Sweden | | | 13.411.897,80 | 5,41 |
| KINNEVIK AB-RDS | SEK | 671.685 | 1.361.123,79 | 0,55 |
| KINNEVIK AB- RDS | SEK | 5.946.795 | 12.050.774,01 | 4,86 |
| Obligations/Bonds | | | 21.599.346,78 | 8,71 |
| Allemagne/Germany | | | 328.268,70 | 0,13 |
| ACCENTRO REAL ESTATE 5.625 20-26 13/02S | EUR | 810.000 | 328.268,70 | 0,13 |
| Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles | | | 6.655.904,00 | 2,68 |
| SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A | EUR | 6.400.000 | 6.655.904,00 | 2,68 |
| France | | | 519.694,08 | 0,21 |
| BNP PARIBAS FL.R 85-XX XX/XXA | EUR | 940 | 519.694,08 | 0,21 |
| Luxembourg | | | 6.309.110,00 | 2,54 |
| LAGFIN SCA 3.50 23-28 08/06S | EUR | 5.800.000 | 5.358.765,00 | 2,16 |
| LOGICOR FINANCING 0.6250 22-25 17/11A | EUR | 1.000.000 | 950.345,00 | 0,38 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 7.786.370,00 | 3,14 |
| EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S | EUR | 5.000.000 | 4.846.850,00 | 1,95 |
| INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A | EUR | 3.000.000 | 2.939.520,00 | 1,19 |
| Obligations à taux variables/Floating rate notes | | | 17.104.189,21 | 6,90 |
| Canada | | | 1.308.547,50 | 0,53 |
| CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q | EUR | 1.300.000 | 1.308.547,50 | 0,53 |
| Espagne/Spain | | | 1.989.030,00 | 0,80 |
| BANCA MARCH SA FL.R 21-25 17/11A | EUR | 2.000.000 | 1.989.030,00 | 0,80 |
| États-Unis/United States of America | | | 7.498.806,21 | 3,02 |
| BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-26 27/10A | EUR | 2.000.000 | 1.952.830,00 | 0,79 |
| WELLS FARGO FL.R 12-24 05/12Q | USD | 6.000.000 | 5.545.976,21 | 2,24 |
| France | | | 3.910.822,50 | 1,58 |
| SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q | EUR | 3.900.000 | 3.910.822,50 | 1,58 |
| Luxembourg | | | 1.402.588,00 | 0,57 |
| OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S | EUR | 1.397.000 | 1.402.588,00 | 0,57 |
| Suisse/Switzerland | | | 994.395,00 | 0,40 |
| CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A | EUR | 1.000.000 | 994.395,00 | 0,40 |
| Obligations convertibles/Convertible bonds | | | 170.061.003,01 | 68,59 |
| Allemagne/Germany | | | 35.125.502,50 | 14,17 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA CV 2 20-25 17/11S/11S | EUR | 2.500.000 | 2.448.325,00 | 0,99 |
| DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A | EUR | 6.000.000 | 5.772.810,00 | 2,33 |
| LEG IMMOBILIEN SE CV 0.875 17-25 01/09S | EUR | 6.000.000 | 5.828.340,00 | 2,35 |
| MORPHOSYS AG CV 0.625 20-25 16/10S | EUR | 2.600.000 | 2.574.325,00 | 1,04 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Portefeuille-titres au 30/06/24/Securities portfolio as at 30/06/24

| Description Denomination | Devise Currency | Quantité/ Nominal Quantity/ Notional | Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR) | % actifs nets % of net assets |
|--------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| RAG-STIFTUNG CV 0.00 18-24 02/10U | EUR | 100.000 | 98.958,50 | 0,04 |
| RAG-STIFTUNG CV 0 20-26 17/06U17/06U | EUR | 5.400.000 | 5.246.424,00 | 2,12 |
| TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625 20-26 27/08S | EUR | 13.300.000 | 12.200.090,00 | 4,92 |
| ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A | EUR | 1.000.000 | 956.230,00 | 0,39 |
| Autriche/Austria | | | 7.391.475,00 | 2,98 |
| AMS AGA 0.00 18-25 05/03U | EUR | 7.800.000 | 7.391.475,00 | 2,98 |
| Belgique/Belgium | | | 4.948.634,00 | 2,00 |
| GROUPE BRUXELLES CV 2.125 22-25 29/11A | EUR | 1.300.000 | 1.267.006,00 | 0,51 |
| MITHRA PHARMA CV 4.25 20-25 17/12S | EUR | 1.100.000 | 106.623,00 | 0,04 |
| SAGERPAR SA CV 0 21-26 01/04U1-26 01/04U | EUR | 2.200.000 | 2.049.069,00 | 0,83 |
| UMICORE SA CV 0.00 20-25 23/06U | EUR | 1.600.000 | 1.525.936,00 | 0,62 |
| Bermudes/Bermuda | | | 3.674.065,78 | 1,48 |
| BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A | USD | 4.000.000 | 3.674.065,78 | 1,48 |
| Espagne/Spain | | | 854.865,00 | 0,34 |
| AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S | EUR | 900.000 | 854.865,00 | 0,34 |
| États-Unis/United States of America | | | 1.306.864,00 | 0,53 |
| JPM CHASE FIN CO LLC CV 0 22-25 14/01U1U | EUR | 1.300.000 | 1.306.864,00 | 0,53 |
| France | | | 69.184.258,33 | 27,90 |
| ATOS SE CV 0 19-24 06/11U11U | EUR | 12.500.000 | 3.250.000,00 | 1,31 |
| BIGBEN INTERACTIVE CV 1.125 21-26 19/02S | EUR | 1.200.000 | 601.404,00 | 0,24 |
| CLARIANE 0.875 20-27 06/03A | EUR | 63.890 | 3.152.744,44 | 1,27 |
| EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U | EUR | 96.122 | 5.826.771,46 | 2,35 |
| FNAC DARTY SA 0.25 21-27 23/03A | EUR | 38.258 | 2.738.524,67 | 1,10 |
| GENFIT CV DY CV 3.50 17-25 16/10S | EUR | 178.345 | 4.836.767,93 | 1,95 |
| KORIAN SA CV FL.R 21-99 31/12S | EUR | 116.028 | 4.048.468,31 | 1,63 |
| NEOEN SPA CV 2.875 22-27 14/09S | EUR | 1.000.000 | 1.007.400,00 | 0,41 |
| NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S | EUR | 91.000 | 5.805.670,32 | 2,34 |
| NEXITY SA CV 0.875 21-28 19/04S | EUR | 35.751 | 1.201.108,47 | 0,48 |
| ORPEA CV 2.00 24-31 07/02A | EUR | 2.200.000 | 2.122.131,00 | 0,86 |
| SELENA SARL CV 0.00 20-25 25/06U | EUR | 50 | 4.787.025,00 | 1,93 |
| SOITEC SA CV 0.0 20-25 01/10U | EUR | 15.000 | 2.504.317,50 | 1,01 |
| UBISOFT ENTERTA CV 0.0 19-24 24/09U | EUR | 33.754 | 3.824.041,29 | 1,54 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT 2.875 23-31 05/12S | EUR | 1.400.000 | 1.269.772,00 | 0,51 |
| VOLTALIA SA CV 21-25 13/01A | EUR | 179.513 | 5.477.172,50 | 2,21 |
| WORLDLINE SA CV 0.00 19-26 30/07U | EUR | 180.628 | 16.730.939,44 | 6,75 |
| Irlande/Ireland | | | 6.350.025,00 | 2,56 |
| GLANBIA CO-OPERATI CV 1.875 22-27 27/01S | EUR | 5.500.000 | 6.350.025,00 | 2,56 |
| Italie/Italy | | | 12.409.327,50 | 5,00 |
| NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S | EUR | 5.600.000 | 5.181.512,00 | 2,09 |
| PIRELLI AND C SPA CV 0.00 20-25 22/12U | EUR | 1.800.000 | 1.902.744,00 | 0,77 |
| PRYSMIAN SPA CV 0.0 21-26 02/02U | EUR | 200.000 | 287.154,00 | 0,12 |
| SELINI CV 4.0 24-28 30/05Q | EUR | 4.100.000 | 4.042.497,50 | 1,63 |
| SNAM CV 3.25 23-28 29/09S | EUR | 1.000.000 | 995.420,00 | 0,40 |
| Jersey | | | 2.303.520,67 | 0,93 |
| PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S | GBP | 2.000.000 | 2.303.520,67 | 0,93 |
| Mexique/Mexico | | | 2.379.540,00 | 0,96 |
| FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A | EUR | 2.400.000 | 2.379.540,00 | 0,96 |
| Pays-Bas/Netherlands | | | 9.286.612,29 | 3,75 |
| BASIC FIT NV CV 1.5 21-28 17/06S | EUR | 3.800.000 | 3.449.773,00 | 1,39 |
| CM COM NV CV 2 21-26 09/09S | EUR | 900.000 | 560.848,50 | 0,23 |
| FUGRO NV CV 4.50 17-24 02/11S | EUR | 2.300.000 | 2.740.158,38 | 1,11 |
| QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U | USD | 2.000.000 | 1.724.739,91 | 0,70 |

HELIUM FUND - Helium Invest

Portefeuille-titres au 30/06/24/*Securities portfolio as at 30/06/24*

| Description <i>Denomination</i> | Devise <i>Currency</i> | Quantité/ Nominal <i>Quantity/ Notional</i> | Valeur d'évaluation (en EUR) <i>Market value (in EUR)</i> | % actifs nets <i>% of net assets</i> |
|----------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| SIEMENS ENERGY FINAN CV 22-25 14/09S | EUR | 500.000 | 811.092,50 | 0,33 |
| Royaume-Uni/United Kingdom | | | 7.498.071,89 | 3,02 |
| BARCLAYS BANK PLC CV 0.00 22-25 24/01A | EUR | 100.000 | 101.441,00 | 0,04 |
| CAPITAL AND COUNTIES CV 2.0 20-26 30/03S | GBP | 6.700.000 | 7.396.630,89 | 2,98 |
| Suisse/Switzerland | | | 7.348.241,05 | 2,96 |
| CEMBRA MONEY BANK SA CV 0 19-26 09/07U | CHF | 3.400.000 | 3.385.842,89 | 1,37 |
| IDORSIA SA CV 1.625 21-28 04/08A | CHF | 800.000 | 375.839,26 | 0,15 |
| SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A | CHF | 3.490.000 | 3.586.558,90 | 1,45 |
| Autres valeurs mobilières/Other transferable securities | | | 9.797,06 | 0,00 |
| Actions/Shares | | | 9.797,06 | 0,00 |
| États-Unis/United States of America | | | 9.797,06 | 0,00 |
| CHINOOK THERAPEUTICS | USD | 15.000 | 9.797,06 | 0,00 |
| Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio | | | 231.478.711,50 | 93,36 |

HELIUM FUND

Notes aux états financiers

Notes to the financial statements

HELIUM FUND

Notes aux états financiers/Notes to the financial statements

1 - Généralités/1 - General information

HELIUM FUND (le « Fonds ») a été constitué dans les Iles Caïmans le 22 juillet 2005 en tant que société à responsabilité limitée sous le numéro d'enregistrement CB-152300 et a transféré son siège social à Luxembourg le 3 avril 2013.

Depuis le 3 avril 2013, le Fonds est une société d'investissement à capital variable (« SICAV ») à compartiments multiples sous la forme d'une société anonyme de droit Luxembourgeois et est considéré comme un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») en vertu de la partie I de la loi modifiée luxembourgeoise du 17 décembre 2010 (Loi de 2010) sur les organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

Syquant Capital SAS a été désigné comme Société de Gestion du Fonds. Syquant Capital SAS a été créé en juin 2005 comme société par actions simplifiées et agréée par l'Autorité des Marchés Financiers sous le numéro GP-05000030 le 9 septembre 2005.

En tant que structure à compartiments multiples, le Fonds peut lancer différents compartiments qui se distinguent du Fonds entre autres par leur politique d'investissement spécifique ou toute autre caractéristique spécifique telles que détaillées dans le prospectus. Chaque compartiment peut offrir différentes classes d'actions, offrant chacune des caractéristiques spécifiques décrites dans le prospectus.

Le Fonds est enregistré au Registre de Commerce et des Sociétés du Luxembourg sous le numéro B 176.451. Ses statuts ont été déposés auprès du Registre de Commerce et des Sociétés du Luxembourg et publiés au Mémorial C le 22 avril 2013.

Etant donné que certaines Classes d'actions ne sont pas autorisées à être distribuées en Suisse, celles-ci ne sont pas présentées dans ce rapport semi-annuel. La somme des valeurs nettes d'inventaire par part présentées dans ce rapport ne correspond donc pas à la valeur nette d'inventaire de chaque compartiment auquel elles se rapportent.

Au 30 juin 2024, quatre compartiments sont actifs, à savoir:

- HELIUM FUND - Helium Fund;
- HELIUM FUND - Helium Performance;
- HELIUM FUND - Helium Selection;
- HELIUM FUND - Helium Invest.

HELIUM FUND (the « Fund ») was incorporated in the Cayman Islands on July 22, 2005 as an open-ended investment company with limited liability under registration number CB-152300 and transferred its registered office to Luxembourg on April 3, 2013.

As from April 3, 2013, the Fund is an umbrella investment company with variable capital (société d'investissement à capital variable) taking the form of a société anonyme in the Grand Duchy of Luxembourg. It qualifies as an undertaking for collective investment in transferable securities (« UCITS ») under Part I of the amended Luxembourg law of December 17, 2010 (2010 Law) relating to Undertakings of Collective Investment in Transferable Securities.

Syquant Capital SAS, has been designated as Management Company of the Fund. Syquant Capital SAS was incorporated on June 2005 as a "société par actions simplifiées" and has been registered with the Autorité des Marchés Financiers on September 9, 2005 under number GP-05000030.

As an umbrella structure, the Fund may operate separate sub-funds, each being distinguished among others by their specific investment policy or any other specific feature as further detailed in the prospectus of the Fund. Within each sub-fund, different Classes of shares, the characteristics of which are further detailed in the prospectus of the Fund, may be issued.

The Fund is registered with the Luxembourg register of commerce and companies under number B 176.451. Its Articles of Incorporation have been registered with the Luxembourg trade and companies register and thereafter published in the Mémorial C on April 22, 2013.

Since certain classes of shares are not authorized for distribution in Switzerland, these are not presented in this semi-annual report. The sum of the net asset values per party given in this report does not therefore does not correspond to the net asset value of each sub-fund to which they relate.

As of June 30, 2024, four sub-funds are active, namely:

- HELIUM FUND - Helium Fund;
- HELIUM FUND - Helium Performance;
- HELIUM FUND - Helium Selection;
- HELIUM FUND - Helium Invest.

HELIUM FUND

Notes aux états financiers/Notes to the financial statements

2 - Principales méthodes comptables/2 - Principal accounting policies

Les avoirs en banques, les autres actifs nets et la valeur de marché des investissements exprimés en devises autres que la devise de référence de chaque compartiment ont été convertis aux taux de change en vigueur à la date de clôture. Les produits et charges enregistrés dans des devises autres que la devise de référence de chaque compartiment ont été convertis aux taux de change en vigueur aux dates des transactions.

Le bénéfice ou perte net(te) réalisés(e) sur change est indiqué(e) dans l'état des opérations et des variations des actifs nets. Le coût d'acquisition des titres en portefeuille et les transactions, exprimés en d'autres devises que la devise de base du compartiment, sont convertis aux cours de change en vigueur à la date d'acquisition ou de transaction.

Les taux de change suivants ont été utilisés par le Fonds en date du 30 juin 2024:

Cash at banks, other net assets as well as the market value of the securities portfolio in currencies other than the reference currency of the sub-fund are translated into the reference currency of the sub-fund at the exchange rate prevailing at the year-end. Income and expenses in currencies other than the reference currency of the sub-fund are translated into the currency of the sub-fund at the exchange rate prevailing at the transaction date.

The net realised profit and loss on foreign exchange are recorded in the statement of operations and changes in net assets. The acquisition cost of portfolio securities portfolio and transactions expressed in currencies other than the base currency of the sub-fund are translated at the exchange rates prevailing at the date of acquisition or transaction.

The following exchange rates were used by the Fund as at June 30, 2024:

| | | | | | | | | |
|---------|------------|-----|---------|----------|-----|---------|----------|-----|
| 1 EUR = | 1,6048 | AUD | 1 EUR = | 1,46655 | CAD | 1 EUR = | 0,96305 | CHF |
| 1 EUR = | 7,45745 | DKK | 1 EUR = | 0,84785 | GBP | 1 EUR = | 8,3676 | HKD |
| 1 EUR = | 394,925 | HUF | 1 EUR = | 4,0375 | ILS | 1 EUR = | 172,4017 | JPY |
| 1 EUR = | 1.475,2639 | KRW | 1 EUR = | 19,59745 | MXN | 1 EUR = | 11,4115 | NOK |
| 1 EUR = | 4,3085 | PLN | 1 EUR = | 11,35 | SEK | 1 EUR = | 1,4525 | SGD |
| 1 EUR = | 1,07175 | USD | 1 EUR = | 19,57015 | ZAR | | | |

3 - Commission de performance/3 - Performance fees

En application des orientations ESMA sur les commissions de performance (ESMA34-39-992) et la Circulaire CSSF 20/764, le tableau ci-dessous présente le montant des commissions de performance chargées pour chaque catégorie d'actions concernée ainsi que le pourcentage de ces commissions calculé en fonction de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») de la catégorie d'actions. Seules les catégories d'actions pour lesquelles des commissions de performance ont été chargées sont présentées.

In application of the ESMA Guidelines on performance fees (ESMA34-39-992) and Circular CSSF 20/764, the table below displays the actual amount of performance fees charged by each relevant Share Class and the percentage of these fees based on the Share Class Net Asset Value ("NAV"). Only the Share Classes for which performance fees have been charged are shown below.

| Compartiments / Sub-funds | Classe d'actions / Share class | Code ISIN / ISIN Code | Devise du compartiment / Sub-fund currency | Montants des commissions de performance au 30/06/24 (en devise du compartiment) / Performance fee amounts as of 30/06/24 (in sub-fund currency) | VNI moyenne de la Classe d'actions (en devise du compartiment) / Average NAV of the Share Class (in sub-fund currency) | % de la VNI moyenne de la Classe d'actions / % of Average NAV of the Share Class |
|-----------------------------------|--------------------------------------|--------------------------|--------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| HELIUM FUND - Helium Selection | Classe A JPY | LU1734047274 | EUR | 29,067.60 | 75,505,042.37 | 0,04 |
| TOTAL | | | | 29,067.60 | | |

4 - Changement dans la composition du portefeuille-titres/4 - Changes in the composition of securities portfolio

Le rapport concernant les changements intervenus dans la composition des portefeuille-titres au cours de la période terminée au 30 juin 2024 peut être obtenu sans frais et sur simple demande auprès du siège social du Fonds.

The report on the changes in the securities portfolio for the financial period ended June 30, 2024 is available free of charge upon request at the registered office of the Fund.

HELIUM FUND

Notes aux états financiers/Notes to the financial statements

5 - Informations relatives à SFTR (Securities Financing Transactions Regulation)/5 - Securities Financing Transactions Regulation (SFTR) Disclosures

| CONTRATS « EQUITY SWAPS » | HELIUM FUND - Helium Invest |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| Actifs/Assets used | En EUR/ In EUR |
| En valeur absolue/In absolute terms | 2.517.415,21 |
| En % de la valeur nette d'inventaire totale/ As a % of total net asset value | 1,02% |
| Ventilation des transactions sur base de la date de maturité résiduelle/Transactions classified according to residual maturities | En EUR/ In EUR |
| De 1 semaine à 1 mois *(voir note)/ From 1 week to 1 month *(see note) | 2.517.415,21 |
| Les 10 principales contreparties/ The 10 largest counterparties | En EUR/ In EUR |
| Première contrepartie/First name | Morgan Stanley Europe SE |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | 1.617.367,05 |
| Pays d'établissement/Country of establishment | Allemagne/Germany |
| Seconde contrepartie/Second name | BNP Paribas |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | 855.711,04 |
| Pays d'établissement/Country of establishment | France/France |
| Troisième contrepartie/Third name | JP Morgan Securities Ltd |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | 44.337,12 |
| Pays d'établissement/Country of establishment | Allemagne/Germany |
| Quatrième contrepartie/Fourth name | |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | |
| Pays d'établissement/Country of establishment | |
| Cinquième contrepartie/Fifth name | |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | |
| Pays d'établissement/Country of establishment | |
| Sixième contrepartie/Sixth name | |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | |
| Pays d'établissement/Country of establishment | |
| Septième contrepartie/Seventh name | |
| Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades | |
| Pays d'établissement/Country of establishment | |
| Revenus et coûts/ Revenues and expenditures | En EUR/ In EUR |
| Revenus du Fonds:/ Revenues of the Fund: | |
| En valeur absolue/ In absolute amount | 40.310.375,16 |
| En % des revenus bruts/ In % of gross revenue | 100% |
| Coûts du Fonds:/Expenditure component of the Fund: | 45.786.094,70 |

*La réinitialisation des transactions d'Equity Swap a été prise en compte pour classer les transactions en fonction de leurs échéances résiduelles/Reset of Equity Swap transactions has been taken into consideration to classify that transactions according to their residual maturities.

HELIUM FUND

Notes aux états financiers/Notes to the financial statements

5 - Informations relatives à SFTR (Securities Financing Transactions Regulation)/5 - Securities Financing Transactions Regulation (SFTR) Disclosures

Il n'y a aucune réutilisation du collatéral liée aux opérations de « equity swaps ». Toutes les opérations ouvertes à la fin de la période ont été traitées par règlement bilatéral.

Les revenus et dépenses du Fonds comprennent les intérêts, les dividendes, les réalisations et les variations de résultat non réalisé sur les « equity swaps »,

There is no reuse of collateral cash related to Equity Swaps transactions. All trades open at the end of the year have been transacted through bilateral settlement.

Revenues and expenditures of the Fund includes interests, dividends, realised on Equity Swaps,

The following amounts have been granted as collateral by the sub-fund related to the mentioned-below counterparties:

| | Bank of America | CACEIS Bank, Luxembourg Branch | Goldman Sachs | Morgan Stanley | JP Morgan | BNP | Barclays | Société Générale |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------------------------|---------------|----------------|------------|-----------|------------|---------------------|
| | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR | En/In EUR |
| HELIUM FUND - Helium Fund | - | - | 6.185.595,68 | 10.351.335,05 | 269.753,32 | 93.772,91 | 239.605,00 | - |
| HELIUM.FUND - Helium Performance | - | - | 763.724,18 | 9.891.170,66 | 242.403,08 | 44.229,52 | - | - |
| HELIUM FUND - Helium Selection | - | - | 1.277.429,77 | 12.871.902,27 | 149.028,31 | 73.700,43 | - | - |
| HELIUM FUND - Helium Invest | - | - | 863.499,82 | 876.893,67 | 30,77 | 35.000,00 | - | - |