

# 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
Etat combiné des actifs nets au 30/06/24	5
<i>Combined statement of net assets as at 30/06/24</i>	5
Etat combiné des opérations et des variations des actifs nets pour la période clôturée au 30/06/24	6
<i>Combined statement of operations and changes in net assets for the period ended 30/06/24</i>	6
Compartiments :	7
<i>Sub-funds:</i>	7
HELIUM FUND - Helium Fund	7
HELIUM FUND - Helium Performance	17
HELIUM FUND - Helium Selection	27
HELIUM FUND - Helium Alpha	37
HELIUM FUND - Helium Invest	45
HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven	53
Notes aux états financiers	61
<i>Notes to the financial statements</i>	61

**For the following sub-funds of Helium Fund (the "Company") no notification for distribution in the Federal Republic of Germany was submitted and Shares in these sub-funds may NOT be offered to investors within the scope of the German Investment Code. As a consequence, the following Sub-Funds are NOT available to investors in Germany:**

- **HELIUM FUND - Helium Alpha**
- **HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven**

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. Les performances historiques des compartiments sont annexées aux documents d'information clé pour l'investisseur/*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*

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

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

# 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>79.344.930,28</b>
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
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>76.175.751,42</b>
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
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>3.169.178,86</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- 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
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>125.737.630,25</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- 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
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>36.592.151,90</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	601.275.538,21
Rachats d'actions/Redemptions of shares	-690.999.923,69
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>-53.132.233,58</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>3.220.963.849,00</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>3.167.831.615,42</b>

## **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>
<b>Actifs/Assets</b>	<b>835.966.337,85</b>
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
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>13.831.517,98</b>
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
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>822.134.819,87</b>



# 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>17.295.553,78</b>
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
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>15.847.335,77</b>
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
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>1.448.218,01</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- 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
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>39.540.866,95</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- 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
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>9.934.364,62</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	86.948.345,49
Rachats d'actions/Redemptions of shares	-234.728.370,52
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>-137.845.660,41</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>959.980.480,28</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>822.134.819,87</b>

## HELIUM FUND - Helium Fund

### Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23	31/12/22
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>822.134.819,87</b>	<b>959.980.480,28</b>	<b>738.810.509,03</b>
<b>A - EUR</b>				
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>B - EUR</b>				
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
<b>C - EUR</b>				
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
<b>I - EUR</b>				
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
<b>Bcl - EUR</b>				
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
<b>I - CHF</b>				
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
<b>I - USD</b>				
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	-
<b>F - EUR</b>				
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>
<b>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</b>			<b>710.953.030,12</b>	<b>86,48</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>332.595.502,07</b>	<b>40,46</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>111.684.505,89</b>	<b>13,58</b>
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
<b>Australie/Australia</b>			<b>370.737,79</b>	<b>0,05</b>
CSR LTD	AUD	67.000	370.737,79	0,05
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>34.223.553,00</b>	<b>4,16</b>
ANHEUSER-BUSCH INBEV	EUR	623.885	33.764.656,20	4,11
FINANCIERE DE TUBIZE	EUR	4.404	458.896,80	0,06
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>3.230.977,82</b>	<b>0,39</b>
CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	HKD	3.293.000	3.230.977,82	0,39
<b>Espagne/Spain</b>			<b>1.499.896,52</b>	<b>0,18</b>
ARIMA --- BEARER SHS	EUR	179.257	1.498.588,52	0,18
PARQUETOS REUNIDOS	EUR	100	1.308,00	0,00
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>4.086.321,99</b>	<b>0,50</b>
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
<b>Finlande/Finland</b>			<b>4.591.740,87</b>	<b>0,56</b>
CAVERION OYJ	EUR	512.718	4.591.740,87	0,56
<b>France</b>			<b>51.556.238,42</b>	<b>6,27</b>
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
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>				
HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES	USD	63.158	1.275.240,61	0,16
<b>Italie/Italy</b>				
SARAS RAFFINERIE SARDE SPA	EUR	231.995	375.599,91	0,05
<b>Japon/Japan</b>				
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
<b>Malte/Malta</b>				
KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC	SEK	115.000	1.276.651,98	0,16
<b>Norvège/Norway</b>				
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>				
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
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
<b>Suède/Sweden</b>				
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
<b>Obligations/Bonds</b>				
<b>Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles</b>				
SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A	EUR	3.200.000	3.327.952,00	0,40
<b>États-Unis/United States of America</b>				
EVERETT DENNISON CORP 1.25 17-25 03/03A	EUR	2.000.000	1.966.370,00	0,24
<b>France</b>				
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
<b>Luxembourg</b>				
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
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
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>				
			<b>99.371.503,44</b>	<b>12,09</b>

# 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
<b>Allemagne/Germany</b>				
DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A	EUR	9.500.000	9.225.165,00	1,12
<b>Canada</b>				
CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q	EUR	2.300.000	2.315.122,50	0,28
<b>Espagne/Spain</b>				
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
<b>États-Unis/United States of America</b>				
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
<b>France</b>				
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
<b>Irlande/Ireland</b>				
CA AUTO BANK SPA IR FL.R 23-25 13/01Q	EUR	3.000.000	3.010.935,00	0,37
<b>Japon/Japan</b>				
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A	EUR	6.400.000	6.390.048,00	0,78
<b>Luxembourg</b>				
OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S	EUR	2.420.000	2.429.680,00	0,30
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>				
ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A	EUR	6.000.000	5.960.700,00	0,73
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
LLOYDS BANKING GROUP FL.R 20-26 01/04A	EUR	2.000.000	1.995.120,00	0,24
<b>Suisse/Switzerland</b>				
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A	EUR	5.300.000	5.270.293,50	0,64
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>				
<b>Allemagne/Germany</b>				
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
<b>Autriche/Austria</b>				
AMS AGA 0.00 18-25 05/03U	EUR	4.400.000	4.169.550,00	0,51
<b>Belgique/Belgium</b>				
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
<b>Bermudes/Bermuda</b>				
BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A	USD	4.000.000	3.674.065,78	0,45
<b>Espagne/Spain</b>				
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
<b>France</b>			<b>106.288.841,80</b>	<b>12,93</b>
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
<b>Italie/Italy</b>			<b>5.707.712,00</b>	<b>0,69</b>
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
<b>Jersey</b>			<b>16.956.611,97</b>	<b>2,06</b>
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
<b>Mexique/Mexico</b>			<b>694.032,50</b>	<b>0,08</b>
FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A	EUR	700.000	694.032,50	0,08
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>33.911.687,21</b>	<b>4,12</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>4.678.359,43</b>	<b>0,57</b>
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
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>9.557.305,96</b>	<b>1,16</b>
SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A	CHF	9.300.000	9.557.305,96	1,16
<b>Warrants</b>			<b>17.422,43</b>	<b>0,00</b>
<b>France</b>			<b>10.477,95</b>	<b>0,00</b>
ARVERNE GROUP 16.06.26 WAR	EUR	69.853	10.477,95	0,00
<b>Luxembourg</b>			<b>360,73</b>	<b>0,00</b>
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>6.583,75</b>	<b>0,00</b>
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
<b>Autres valeurs mobilières/Other transferable securities</b>			<b>41.164.398,89</b>	<b>5,01</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>2.972.346,84</b>	<b>0,36</b>
<b>Canada</b>			<b>145.487,22</b>	<b>0,02</b>
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>
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>2.826.859,54</b>	<b>0,34</b>
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
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>			<b>0,08</b>	<b>0,00</b>
HEATHER VENT --- REGISTERED SHS	GBP	262.812	0,04	0,00
TAPIR --- REGISTERED SHS	GBP	262.812	0,04	0,00
<b>Suède/Sweden</b>			<b>-</b>	<b>0,00</b>
VICTORIAHEM FASTIGHETER AB	SEK	33.000	-	0,00
<b>Warrants</b>			<b>0,04</b>	<b>0,00</b>
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>0,04</b>	<b>0,00</b>
NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR	GBP	30.188	0,04	0,00
<b>Droits/Rights</b>			<b>38.192.052,01</b>	<b>4,65</b>
<b>Autriche/Austria</b>			<b>2.840.502,00</b>	<b>0,35</b>
BUWOG	EUR	946.834	2.840.502,00	0,35
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>4.082,11</b>	<b>0,00</b>
SUPERMUS PHARMACEUTICALS 31.12.24 RIGHT	USD	25.000	4.082,11	0,00
SUPERMUS PHARMACEUTICALS 31.12.25 RIGHT	USD	25.000	-	0,00
<b>Finlande/Finland</b>			<b>35.347.467,90</b>	<b>4,30</b>
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
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>752.117.429,01</b>	<b>91,48</b>



## **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>
<b>Actifs/Assets</b>	<b>987.283.050,97</b>
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
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>20.092.412,64</b>
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
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>967.190.638,33</b>

## 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>28.549.796,74</b>
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
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>26.764.298,30</b>
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
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>1.785.498,44</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- 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
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>51.036.818,89</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- 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
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>14.907.544,56</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	81.866.161,50
Rachats d'actions/Redemptions of shares	-215.329.650,51
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>-118.555.944,45</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>1.085.746.582,78</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>967.190.638,33</b>

## HELIUM FUND - Helium Performance

### Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23	31/12/22
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>967.190.638,33</b>	<b>1.085.746.582,78</b>	<b>1.248.602.431,66</b>
<b>A - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		47.667,282	55.112,926	72.294,193
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.454,67	1.433,96	1.359,71
<b>A - USD</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		8.316,766	8.636,484	9.665,777
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	USD	1.507,19	1.474,91	1.372,86
<b>B - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		113.387,138	134.624,804	167.509,164
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.373,32	1.357,37	1.292,63
<b>B - USD</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		2.115,725	2.256,450	2.873,406
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	USD	1.444,21	1.416,43	1.323,40
<b>S - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		327.717,637	381.135,539	411.793,947
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.529,75	1.506,42	1.423,98
<b>C - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		9.685,603	9.259,716	8.797,882
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.824,37	1.787,79	1.666,05
<b>D - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		67.893,719	68.521,719	39.206,719
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.235,41	1.219,99	1.154,79
<b>E - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		59.201,656	75.577,887	74.720,840
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.234,44	1.216,91	1.152,38
<b>E - USD</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		16.203,859	7.504,361	6.840,360
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	USD	1.408,23	1.378,09	1.280,23
<b>Bcl - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		25.320,650	28.782,257	122.522,234
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.193,30	1.176,54	1.115,91
<b>E - JPY</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		1,000	1,000	49.557,012
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	JPY	116.398,73	117.089,83	114.835,72
<b>E - GBP</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		88,000	44,000	8,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	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>
<b>A - EUR</b>	55.112,926	2.750,774	10.196,418	47.667,282
<b>A - USD</b>	8.636,484	612,750	932,468	8.316,766
<b>B - EUR</b>	134.624,804	8.429,432	29.667,098	113.387,138
<b>B - USD</b>	2.256,450	82,818	223,543	2.115,725
<b>S - EUR</b>	381.135,539	19.818,400	73.236,302	327.717,637
<b>C - EUR</b>	9.259,716	952,372	526,485	9.685,603
<b>D - EUR</b>	68.521,719	207,000	835,000	67.893,719
<b>E - EUR</b>	75.577,887	4.884,998	21.261,229	59.201,656
<b>E - USD</b>	7.504,361	19.387,775	10.688,277	16.203,859
<b>Bcl - EUR</b>	28.782,257	2.261,616	5.723,223	25.320,650
<b>E - JPY</b>	1,000	0,000	0,000	1,000
<b>E - GBP</b>	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>
<b>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</b>			<b>907.148.660,67</b>	<b>93,79</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>432.515.538,61</b>	<b>44,72</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>135.392.331,75</b>	<b>14,00</b>
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
<b>Australie/Australia</b>			<b>470.338,98</b>	<b>0,05</b>
CSR LTD	AUD	85.000	470.338,98	0,05
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>13.215.750,64</b>	<b>1,37</b>
AGEAS NOM	EUR	284.093	12.125.089,24	1,25
FINANCIERE DE TUBIZE	EUR	10.467	1.090.661,40	0,11
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>6.769.060,42</b>	<b>0,70</b>
CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	HKD	6.899.000	6.769.060,42	0,70
<b>Espagne/Spain</b>			<b>1.751.996,84</b>	<b>0,18</b>
ARIMA --- BEARER SHS	EUR	209.569	1.751.996,84	0,18
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>6.861.922,32</b>	<b>0,71</b>
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
<b>Finlande/Finland</b>			<b>3.134.489,73</b>	<b>0,32</b>
CAVERION OYJ	EUR	350.000	3.134.489,73	0,32
<b>France</b>			<b>32.979.967,20</b>	<b>3,41</b>
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>
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>				
HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES	USD	122.400	2.471.412,18	0,26
<b>Italie/Italy</b>				
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
<b>Japon/Japan</b>				
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
<b>Malte/Malta</b>				
KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC	SEK	200.095	2.221.318,94	0,23
<b>Norvège/Norway</b>				
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>				
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
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
<b>Suède/Sweden</b>				
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
<b>Suisse/Switzerland</b>				
DSM-FIRMENICH LTD - REG SHS	EUR	260.904	27.551.462,40	2,85
<b>Obligations/Bonds</b>				
<b>Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles</b>				
SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A	EUR	3.800.000	3.951.943,00	0,41
<b>États-Unis/United States of America</b>				
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
<b>France</b>				
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
<b>Luxembourg</b>				
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>17.243.479,00</b>	<b>1,78</b>
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
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>			<b>148.058.811,18</b>	<b>15,31</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>10.681.770,00</b>	<b>1,10</b>
DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A	EUR	11.000.000	10.681.770,00	1,10
<b>Canada</b>			<b>2.516.437,50</b>	<b>0,26</b>
CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q	EUR	2.500.000	2.516.437,50	0,26
<b>Danemark/Denmark</b>			<b>3.183.344,00</b>	<b>0,33</b>
DANSKE BANK AS FL.R 19-25 27/08A	EUR	3.200.000	3.183.344,00	0,33
<b>Espagne/Spain</b>			<b>11.683.178,00</b>	<b>1,21</b>
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
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>44.572.138,68</b>	<b>4,61</b>
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
<b>France</b>			<b>15.516.631,50</b>	<b>1,60</b>
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
<b>Irlande/Ireland</b>			<b>1.995.680,00</b>	<b>0,21</b>
AIB GROUP PLC FL.R 22-26 04/07A26 04/07A	EUR	2.000.000	1.995.680,00	0,21
<b>Japon/Japan</b>			<b>12.580.407,00</b>	<b>1,30</b>
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A	EUR	12.600.000	12.580.407,00	1,30
<b>Luxembourg</b>			<b>2.920.636,00</b>	<b>0,30</b>
OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S	EUR	2.909.000	2.920.636,00	0,30
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>24.954.800,00</b>	<b>2,58</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>11.189.100,00</b>	<b>1,16</b>
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
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>6.264.688,50</b>	<b>0,65</b>
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A	EUR	6.300.000	6.264.688,50	0,65
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>			<b>267.535.543,76</b>	<b>27,66</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>28.961.131,00</b>	<b>2,99</b>
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 Denomination	Devise Currency	Quantité/ Nominal Quantity/ Notional	Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR)	% actifs nets % of net assets
<b>Autriche/Austria</b>				
AMS AGA 0.00 18-25 05/03U	EUR	5.400.000	5.117.175,00	0,53
<b>Belgique/Belgium</b>				
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
<b>Bermudes/Bermuda</b>				
BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A	USD	3.600.000	3.306.659,21	0,34
<b>Espagne/Spain</b>				
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
<b>France</b>				
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
<b>Italie/Italy</b>				
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
<b>Jersey</b>				
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
<b>Mexique/Mexico</b>				
FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A	EUR	900.000	892.327,50	0,09
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>				
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
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
<b>Suisse/Switzerland</b>				
SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A	CHF	10.400.000	10.687.739,99	1,11
<b>Warrants</b>				
<b>France</b>				
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>
<b>Luxembourg</b>			<b>857,77</b>	<b>0,00</b>
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>15.625,50</b>	<b>0,00</b>
QEV TECH WT B.V. 11.11.26 WAR	EUR	71.025	15.625,50	0,00
<b>Autres valeurs mobilières/Other transferable securities</b>			<b>4.893.012,21</b>	<b>0,51</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>3.659.700,13</b>	<b>0,38</b>
<b>Canada</b>			<b>223.475,87</b>	<b>0,02</b>
FUSION PHARMACEUTICALS INC	USD	367.807	188.750,97	0,02
NEIGHBOURLY PHARMACY INC	CAD	509.258	34.724,90	0,00
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>3.436.224,18</b>	<b>0,36</b>
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
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>			<b>0,08</b>	<b>0,00</b>
HEATHER VENT --- REGISTERED SHS	GBP	250.000	0,04	0,00
TAPIR --- REGISTERED SHS	GBP	250.000	0,04	0,00
<b>Warrants</b>			<b>0,08</b>	<b>0,00</b>
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>0,08</b>	<b>0,00</b>
NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR	GBP	73.274	0,08	0,00
<b>Droits/Rights</b>			<b>1.233.312,00</b>	<b>0,13</b>
<b>Autriche/Austria</b>			<b>1.233.312,00</b>	<b>0,13</b>
BUWOG RIGHT	EUR	411.104	1.233.312,00	0,13
<b>Organismes de placement collectif/Undertakings for Collective Investment</b>			<b>12.039.060,00</b>	<b>1,24</b>
<b>Actions/Parts de fonds d'investissements/Shares/Units in investment funds</b>			<b>12.039.060,00</b>	<b>1,24</b>
<b>Luxembourg</b>			<b>12.039.060,00</b>	<b>1,24</b>
HELIUM ALPHA -C-EUR- CAP	EUR	10.000	12.039.060,00	1,24
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>924.080.732,88</b>	<b>95,54</b>

## **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>
<b>Actifs/Assets</b>	<b>879.090.018,78</b>
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
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>43.606.079,56</b>
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
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>835.483.939,22</b>

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

## HELIUM FUND - Helium Selection

### Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23	31/12/22
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>835.483.939,22</b>	<b>708.025.635,15</b>	<b>469.171.142,72</b>
<b>A - EUR</b>				
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>B - EUR</b>				
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
<b>S - EUR</b>				
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
<b>C - EUR</b>				
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
<b>Bcl - EUR</b>				
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
<b>A - CHF</b>				
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
<b>A - JPY</b>				
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	-
<b>A - USD</b>				
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>
<b>A - EUR</b>	98.591,439	66.262,914	34.072,497	130.781,856
<b>B - EUR</b>	123.606,402	37.784,350	12.712,794	148.677,958
<b>S - EUR</b>	95.803,974	37.352,378	12.532,082	120.624,270
<b>C - EUR</b>	12.463,967	3.284,769	1.035,300	14.713,436
<b>Bcl - EUR</b>	43.879,056	8.296,203	29.159,383	23.015,876
<b>A - CHF</b>	1.148,185	722,003	97,295	1.772,893
<b>A - JPY</b>	123.801,045	0,000	0,000	123.801,045
<b>A - USD</b>	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/ <i>Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market</i>			<b>782.456.534,16</b>	<b>93,65</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>377.886.238,66</b>	<b>45,23</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>121.143.957,48</b>	<b>14,50</b>
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
<b>Australie/Australia</b>			<b>581.006,98</b>	<b>0,07</b>
CSR LTD	AUD	105.000	581.006,98	0,07
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>43.935.389,31</b>	<b>5,26</b>
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
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>11.666.057,17</b>	<b>1,40</b>
CFD BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	HKD	11.890.000	11.666.057,17	1,40
<b>Espagne/Spain</b>			<b>1.482.236,36</b>	<b>0,18</b>
ARIMA --- BEARER SHS	EUR	177.301	1.482.236,36	0,18
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>7.401.464,70</b>	<b>0,89</b>
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
<b>Finlande/Finland</b>			<b>2.575.359,45</b>	<b>0,31</b>
CAVERION OYJ	EUR	287.567	2.575.359,45	0,31
<b>France</b>			<b>35.851.072,70</b>	<b>4,29</b>
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
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>			<b>1.900.927,87</b>	<b>0,23</b>
HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES	USD	94.146	1.900.927,87	0,23
<b>Italie/Italy</b>			<b>667.814,83</b>	<b>0,08</b>
SARAS RAFFINERIE SARDE SPA	EUR	412.486	667.814,83	0,08
<b>Japon/Japan</b>			<b>5.416.936,99</b>	<b>0,65</b>
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
<b>Malte/Malta</b>			<b>2.481.311,89</b>	<b>0,30</b>
KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC	SEK	223.515	2.481.311,89	0,30
<b>Norvège/Norway</b>			<b>3.054.900,84</b>	<b>0,37</b>
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>78.407.829,60</b>	<b>9,38</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>13.227.264,54</b>	<b>1,58</b>
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
<b>Suède/Sweden</b>			<b>48.092.707,95</b>	<b>5,76</b>
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
<b>Obligations/Bonds</b>			<b>44.082.526,74</b>	<b>5,28</b>
<b>Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles</b>			<b>3.223.953,50</b>	<b>0,39</b>
SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A	EUR	3.100.000	3.223.953,50	0,39
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>5.914.465,00</b>	<b>0,71</b>
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
<b>France</b>			<b>17.930.371,24</b>	<b>2,15</b>
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
<b>Luxembourg</b>			<b>3.841.612,00</b>	<b>0,46</b>
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>
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>13.172.125,00</b>	<b>1,58</b>
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
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>			<b>143.933.232,72</b>	<b>17,23</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>9.225.165,00</b>	<b>1,10</b>
DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-26 03/09A	EUR	9.500.000	9.225.165,00	1,10
<b>Canada</b>			<b>1.912.492,50</b>	<b>0,23</b>
CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q	EUR	1.900.000	1.912.492,50	0,23
<b>Danemark/Denmark</b>			<b>7.460.962,50</b>	<b>0,89</b>
DANSKE BANK AS FL.R 19-25 27/08A	EUR	7.500.000	7.460.962,50	0,89
<b>Espagne/Spain</b>			<b>8.396.863,50</b>	<b>1,01</b>
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
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>31.388.562,12</b>	<b>3,76</b>
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
<b>France</b>			<b>21.208.770,00</b>	<b>2,54</b>
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
<b>Irlande/Ireland</b>			<b>12.531.050,00</b>	<b>1,50</b>
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
<b>Japon/Japan</b>			<b>6.140.436,75</b>	<b>0,73</b>
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A	EUR	6.150.000	6.140.436,75	0,73
<b>Luxembourg</b>			<b>2.201.772,00</b>	<b>0,26</b>
OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S	EUR	2.193.000	2.201.772,00	0,26
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>26.307.768,00</b>	<b>3,15</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>10.588.788,00</b>	<b>1,27</b>
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
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>6.570.602,35</b>	<b>0,79</b>
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
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>			<b>216.511.187,13</b>	<b>25,91</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>26.594.555,00</b>	<b>3,18</b>
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 Denomination	Devise Currency	Quantité/ Nominal Quantity/ Notional	Valeur d'évaluation (en EUR) Market value (in EUR)	% actifs nets % of net assets
ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A	EUR	4.400.000	4.207.412,00	0,50
<b>Autriche/Austria</b>			<b>4.169.550,00</b>	<b>0,50</b>
AMS AGA 0.00 18-25 05/03U	EUR	4.400.000	4.169.550,00	0,50
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>27.628.440,50</b>	<b>3,31</b>
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
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>2.755.549,33</b>	<b>0,33</b>
BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A	USD	3.000.000	2.755.549,33	0,33
<b>Espagne/Spain</b>			<b>6.623.157,00</b>	<b>0,79</b>
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
<b>France</b>			<b>86.077.610,81</b>	<b>10,30</b>
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
<b>Italie/Italy</b>			<b>7.353.946,50</b>	<b>0,88</b>
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
<b>Jersey</b>			<b>13.765.921,25</b>	<b>1,65</b>
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
<b>Mexique/Mexico</b>			<b>694.032,50</b>	<b>0,08</b>
FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A	EUR	700.000	694.032,50	0,08
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>35.407.651,21</b>	<b>4,24</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>3.693.738,61</b>	<b>0,44</b>
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
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>1.747.034,42</b>	<b>0,21</b>
SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A	CHF	1.700.000	1.747.034,42	0,21
<b>Warrants</b>			<b>43.348,91</b>	<b>0,01</b>
<b>France</b>			<b>32.081,40</b>	<b>0,00</b>
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>
<b>Luxembourg</b>			<b>476,51</b>	<b>0,00</b>
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>10.791,00</b>	<b>0,00</b>
QEV TECH WT B.V. 11.11.26 WAR	EUR	49.050	10.791,00	0,00
<b>Autres valeurs mobilières/Other transferable securities</b>			<b>2.022.282,10</b>	<b>0,24</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>1.872.282,04</b>	<b>0,22</b>
<b>Canada</b>			<b>231.003,89</b>	<b>0,03</b>
FUSION PHARMACEUTICALS INC	USD	396.534	203.493,07	0,02
NEIGHBOURLY PHARMACY INC	CAD	403.460	27.510,82	0,00
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>1.641.278,11</b>	<b>0,20</b>
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
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>			<b>0,04</b>	<b>0,00</b>
HEATHER VENT --- REGISTERED SHS	GBP	165.000	0,02	0,00
TAPIR --- REGISTERED SHS	GBP	165.000	0,02	0,00
<b>Warrants</b>			<b>0,06</b>	<b>0,00</b>
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>0,06</b>	<b>0,00</b>
NEW ENERGY ONE ACQ CORP 07.03.27 WAR	GBP	46.538	0,06	0,00
<b>Droits/Rights</b>			<b>150.000,00</b>	<b>0,02</b>
<b>Autriche/Austria</b>			<b>150.000,00</b>	<b>0,02</b>
BUWOG RIGHT	EUR	50.000	150.000,00	0,02
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>784.478.816,26</b>	<b>93,90</b>

## **HELIUM FUND - Helium Alpha**

# HELIUM FUND - Helium Alpha

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

	<i>Exprimé en Expressed in EUR</i>
<b>Actifs/Assets</b>	<b>19.275.204,78</b>
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/Securities portfolio at market value	16.606.839,77
<i>Prix de revient/Cost price</i>	16.815.834,10
Avoirs en banque et liquidités/Cash at banks and liquidities	2.363.256,39
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/Net unrealised appreciation on forward foreign exchange contracts	41.463,25
Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/Net unrealised appreciation on financial futures	2.340,00
Plus-value nette non réalisée sur swaps/Net unrealised appreciation on swaps	182.784,11
Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/Dividends receivable on securities portfolio	20.997,75
Dividendes à recevoir sur swaps/Dividends receivable on swaps	18.986,38
Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/Interests receivable on securities portfolio	30.460,53
Intérêts à recevoir sur swaps/Interests receivable on swaps	5.910,00
Autres intérêts à recevoir/Other interests receivable	1.255,60
Autres actifs/Other assets	911,00
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>523.624,79</b>
Découvert bancaire/Bank overdrafts	476.316,70
Commissions de gestion à payer/Management fees payable	165,51
Dividendes à payer sur swaps/Dividends payable on swaps	44.120,89
Autres passifs/Other liabilities	3.021,69
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>18.751.579,99</b>

# HELIUM FUND - Helium Alpha

## 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>599.905,87</b>
Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net	76.821,76
Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps	117.979,97
Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net	32.488,40
Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps	337.038,90
Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts	35.537,25
Autres revenus/Other income	39,59
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>482.698,60</b>
Commissions de gestion/Management fees	1.051,65
Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depositary and sub-depositary fees	7.037,05
Commissions d'administration/Administration fees	11.293,12
Frais de domiciliation/Domiciliary fees	1.087,77
Frais d'audit/Audit fees	717,20
Frais légaux/Legal fees	3.171,70
Frais de transaction/Transaction fees	41.113,59
Rémunération administrateurs/Directors fees	128,36
Taxe d'abonnement/Subscription tax	4.572,56
Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft	13.413,77
Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps	249.731,45
Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps	136.463,59
Autres dépenses/Other expenses	12.916,79
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>117.207,27</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- ventes d'investissements/- sales of investment securities	1.496.995,88
- contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts	57.213,96
- contrats futures/- financial futures	15.985,00
- swaps	-229.531,57
- change/- foreign exchange	45.888,98
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>1.503.759,52</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- ventes d'investissements/- investments	-988.805,40
- contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts	38.285,42
- contrats futures/- financial futures	1.140,00
- swaps	190.253,20
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>744.632,74</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	97.673,04
Rachats d'actions/Redemptions of shares	-249.192,32
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>593.113,46</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>18.158.466,53</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>18.751.579,99</b>

## HELIUM FUND - Helium Alpha

### Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23	31/12/22
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>18.751.579,99</b>	<b>18.158.466,53</b>	<b>18.446.119,81</b>
<b>A - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		50,000	50,000	50,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.074,89	1.039,32	1.061,00
<b>A - USD</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		1,000	1,000	1,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	USD	1.150,75	1.104,58	1.105,58
<b>B - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		5,000	5,000	5,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.041,99	1.010,20	1.036,81
<b>S - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		111,651	111,651	100,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.110,61	1.071,22	1.088,16
<b>C - EUR</b>				
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		15.422,764	15.558,042	15.719,832
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.203,91	1.155,73	1.162,74



## HELIUM FUND - Helium Alpha

---

**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**

	<b>Nombre d'actions au 01/01/24 Shares outstanding as at 01/01/24</b>	<b>Nombre d'actions émises Shares issued</b>	<b>Nombre d'actions rachetées Shares redeemed</b>	<b>Nombre d'actions au 30/06/24 Shares outstanding as at 30/06/24</b>
<b>A - EUR</b>	50,000	0,000	0,000	50,000
<b>A - USD</b>	1,000	0,000	0,000	1,000
<b>B - EUR</b>	5,000	0,000	0,000	5,000
<b>S - EUR</b>	111,651	0,000	0,000	111,651
<b>C - EUR</b>	15.558,042	81,509	216,787	15.422,764

# HELIUM FUND - Helium Alpha

## 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/ <i>Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market</i>			<b>16.606.839,77</b>	<b>88,56</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>11.920.512,82</b>	<b>63,57</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>1.196.018,34</b>	<b>6,38</b>
BASF SE - NAMEN-AKT	EUR	963	43.513,16	0,23
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	348	30.756,24	0,16
BEIERSDORF AG	EUR	707	96.540,85	0,51
COMMERZBK	EUR	2.423	34.370,26	0,18
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	EUR	828	64.501,20	0,34
DAIMLER TRUCK HOLDING AG - REG SHS	EUR	1.444	53.673,48	0,29
DR ING HCF PORSCHE AKTIENGESELLSCH	EUR	562	39.070,24	0,21
FREENET AG - REG SHS	EUR	3.451	85.584,80	0,46
HENKEL AG & CO KGAA PREFERENTIAL SHARE	EUR	283	23.551,26	0,13
HOCHTIEF AG	EUR	1.262	134.024,40	0,71
JUNGHEINRICH VORZ.STIMMRECHTSLOS	EUR	2.426	74.623,76	0,40
RATIONAL NAMEN	EUR	243	188.932,50	1,01
STROEER OUT-OF-HOME MEDIA A	EUR	877	52.488,45	0,28
TAG IMMOBILIEN AG	EUR	1.820	24.879,40	0,13
TEAMVIEWER - BEARER SHS	EUR	11.258	117.927,55	0,63
ZALANDO SE	EUR	6.011	131.580,79	0,70
<b>Autriche/Austria</b>			<b>186.075,84</b>	<b>0,99</b>
RAIFFEISEN BANK	EUR	11.472	186.075,84	0,99
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>1.132.367,93</b>	<b>6,04</b>
ACKERMANS AND VAN HAAREN NV	EUR	1.677	270.835,50	1,44
AEDIFICA SA	EUR	3.203	181.449,95	0,97
AGEAS NOM	EUR	1.765	75.330,20	0,40
BEKAERT SA	EUR	3.093	120.874,44	0,64
COLRUYT	EUR	3.508	156.386,64	0,83
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	EUR	628	54.918,60	0,29
LOTUS BAKERIES NV	EUR	4	38.520,00	0,21
MONTEA NV	EUR	1.095	86.614,50	0,46
UCB	EUR	1.063	147.438,10	0,79
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>93.005,34</b>	<b>0,50</b>
HAFNIA LTD	NOK	11.832	93.005,34	0,50
<b>Danemark/Denmark</b>			<b>1.416.960,80</b>	<b>7,56</b>
DEMANT A/S	DKK	2.389	96.553,73	0,51
FLSMIDTH & CO. SHS	DKK	1.303	60.489,66	0,32
GENMAB AS	DKK	1.177	275.411,17	1,47
GN GREAT NORDIC	DKK	1.297	33.757,88	0,18
LK-ABELLO --- BEARER AND/OR REGISTERED S	DKK	13.723	281.730,52	1,50
NKT A/S (NORDISKE KABEL-OG TRAADFARBIKK)	DKK	889	72.658,28	0,39
NOVO NORDISK - BEARER AND/OR REGISTERED	DKK	936	126.214,94	0,67
PANDORA	DKK	1.858	261.853,31	1,40
ROCKWOOL SHS -B-	DKK	247	93.600,63	0,50
ROYAL UNIBREW A/S	DKK	610	45.152,16	0,24
VESTAS WIND SYSTEMS AS - BEARER/ REG SHS	DKK	3.216	69.538,52	0,37
<b>Finlande/Finland</b>			<b>616.661,41</b>	<b>3,29</b>
KONECRANES PLC	EUR	614	32.511,30	0,17
METSO CORPORATION	EUR	3.184	31.470,66	0,17
NOKIA OYJ	EUR	14.867	52.904,22	0,28
QT GROUP PLC	EUR	697	54.052,35	0,29
STORA ENSO -R-	EUR	13.616	173.672,08	0,93
UPM-KYMMENE CORP - REG SHS	EUR	8.340	272.050,80	1,45

# HELIUM FUND - Helium Alpha

## 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
<b>Italie/Italy</b>			<b>652.309,20</b>	<b>3,48</b>
AZIMUT HOLDING SPA	EUR	5.898	129.873,96	0,69
DIASORIN	EUR	1.040	96.782,40	0,52
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	EUR	3.343	32.594,25	0,17
ITALGAS SPA PREFERENTIAL SHARE	EUR	9.895	45.536,79	0,24
IVECO GROUP N.V.	EUR	6.526	68.327,22	0,36
MONCLER SPA	EUR	4.893	279.194,58	1,49
<b>Luxembourg</b>			<b>209.070,05</b>	<b>1,11</b>
ARCELORMITTAL SA	EUR	385	8.227,45	0,04
TENARIS - REG SHS	EUR	13.996	200.842,60	1,07
<b>Norvège/Norway</b>			<b>386.614,74</b>	<b>2,06</b>
BAKKAFROST	NOK	1.950	92.617,10	0,49
MOWI ASA - REG SHS	NOK	4.716	73.437,60	0,39
NORDIC VLSI	NOK	4.431	55.370,51	0,30
NORSK HYDRO ASA	NOK	13.807	80.459,67	0,43
SALMAR	NOK	1.083	53.336,20	0,28
TOMRA SYSTEMS ASA - REG SHS	NOK	2.812	31.393,66	0,17
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>1.628.552,22</b>	<b>8,68</b>
ADYEN	EUR	252	280.526,40	1,50
BESI - REG SHS	EUR	1.920	299.808,00	1,60
FUGRO - BEARER AND - REG SHS	EUR	12.473	281.390,88	1,50
IMCD	EUR	1.793	231.834,90	1,24
RANDSTAD BR	EUR	1.958	82.882,14	0,44
REDCARE PHARMACY N.V.	EUR	1.246	142.044,00	0,76
UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	EUR	10.280	285.578,40	1,52
VAN LANSCH KEMP - CERT. OF SHS	EUR	653	24.487,50	0,13
<b>Pologne/Poland</b>			<b>284.017,30</b>	<b>1,51</b>
INPOST SA	EUR	17.255	284.017,30	1,51
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>473.648,70</b>	<b>2,53</b>
ALLFUNDS GROUP PLC	EUR	55.512	290.882,88	1,55
SUBSEA 7 SA	NOK	7.949	139.872,87	0,75
TORM PLC	DKK	1.176	42.892,95	0,23
<b>Suède/Sweden</b>			<b>2.430.052,59</b>	<b>12,96</b>
BETSSON AB	SEK	2.187	23.873,95	0,13
BIOTAGE	SEK	192	2.759,05	0,01
BIOVITRUM AB	SEK	5.484	137.027,52	0,73
CAMURUS AB	SEK	5.079	268.493,39	1,43
DOMETIC GROUP AB	SEK	11.624	68.924,69	0,37
ELEKTA INSTRUMENT -B- FREE	SEK	38.544	224.811,70	1,20
EMBRACER GRP --- REGISTERED SHS	SEK	60.672	124.497,87	0,66
EVOLUTION AB	SEK	2.967	288.596,30	1,54
FORTNOX AB	SEK	25.931	146.173,16	0,78
GETINGE -B-	SEK	17.182	272.565,56	1,45
HEMNET GRP	SEK	10.217	288.236,42	1,54
HOLMEN - REG SHS	SEK	991	36.426,89	0,19
KINNEVIK AB (PUBL) AK B	SEK	12.630	96.755,81	0,52
SECTRA AB-B SHS	SEK	944	20.144,21	0,11
SSAB - REGISTERED -B-	SEK	30.572	155.041,79	0,83
SVENSKA CELLULOSA SCA AB-SHS-B-	SEK	9.662	133.267,50	0,71
THULE CORP	SEK	1.853	45.386,26	0,24
VOLVO AB -B-	SEK	4.064	97.070,52	0,52
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>1.215.158,36</b>	<b>6,48</b>
ARYZTA	CHF	21.132	35.108,46	0,19
BELIMO HOLDING LTD	CHF	59	27.605,42	0,15

# HELIUM FUND - Helium Alpha

## 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
DORMA+KABA HLDG N NAMEN-AKT.	CHF	112	53.613,00	0,29
INFICON HOLDING AG	CHF	34	48.225,95	0,26
INTERROLL-HOLDING NOM.	CHF	36	99.060,28	0,53
KARDEX HOLDING AG	CHF	620	146.783,66	0,78
LANDIS+GYR GR	CHF	926	69.806,97	0,37
LOGITECH INTERNATIONAL SA - NAMEN-AKT	CHF	1.902	171.664,86	0,92
PARTNERS GROUP HOLDING AG - NAMNE-AKT	CHF	174	208.500,08	1,11
SCHINDLER HOLDING SA	CHF	222	52.050,88	0,28
SONOVA HOLDING LTD - NAMEN-AKT	CHF	224	64.568,19	0,34
STRAUMANN HOLDING LTD - REG SHS	CHF	1.814	209.644,57	1,12
YPSOMED HOLDING AG NAM.AKT	CHF	68	28.526,04	0,15
<b>Obligations/Bonds</b>			<b>1.191.120,00</b>	<b>6,35</b>
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>299.562,00</b>	<b>1,60</b>
JEFFERIES GROUP 1.0000 19-24 19/07A	EUR	300.000	299.562,00	1,60
<b>Luxembourg</b>			<b>295.977,00</b>	<b>1,58</b>
TRATON FINANCE LUXEM 0.125 21-24 10/11A	EUR	300.000	295.977,00	1,58
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>299.778,00</b>	<b>1,60</b>
MERCEDESBENZ INTL FI 3.625 23-24 16/12A	EUR	300.000	299.778,00	1,60
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>295.803,00</b>	<b>1,58</b>
BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A	EUR	300.000	295.803,00	1,58
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>			<b>2.282.576,76</b>	<b>12,17</b>
<b>Danemark/Denmark</b>			<b>298.438,50</b>	<b>1,59</b>
DANSKE BANK AS FL.R 19-25 27/08A	EUR	300.000	298.438,50	1,59
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>1.085.201,26</b>	<b>5,79</b>
BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-26 27/10A	EUR	300.000	292.924,50	1,56
CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A	EUR	202.000	197.245,93	1,05
GOLD SACH GR FL.R 22-25 21/02Q	EUR	300.000	294.591,33	1,57
METROPOLITAN LIFE GL FL.R 22-24 20/12Q	EUR	300.000	300.439,50	1,60
<b>France</b>			<b>299.640,00</b>	<b>1,60</b>
BNP PARIBAS SA FL.R 19-25 15/07A	EUR	300.000	299.640,00	1,60
<b>Irlande/Ireland</b>			<b>200.729,00</b>	<b>1,07</b>
CA AUTO BANK SPA IR FL.R 23-25 13/01Q	EUR	200.000	200.729,00	1,07
<b>Japon/Japan</b>			<b>199.689,00</b>	<b>1,06</b>
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A	EUR	200.000	199.689,00	1,06
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>198.879,00</b>	<b>1,06</b>
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A	EUR	200.000	198.879,00	1,06
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>			<b>1.212.630,19</b>	<b>6,47</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>192.427,00</b>	<b>1,03</b>
DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A	EUR	200.000	192.427,00	1,03
<b>Espagne/Spain</b>			<b>288.303,00</b>	<b>1,54</b>
CRITERIA CAIXA SAU CV 0 21-25 22/06U	EUR	300.000	288.303,00	1,54
<b>France</b>			<b>225.384,00</b>	<b>1,20</b>
WORLDLINE SA CV 0.00 20-25 30/07	EUR	2.000	225.384,00	1,20
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>198.216,00</b>	<b>1,06</b>
MONDELEZ INTL HDLG NL CV 0 21-24 20/09UU	EUR	200.000	198.216,00	1,06
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>308.300,19</b>	<b>1,64</b>
SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A	CHF	300.000	308.300,19	1,64
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>16.606.839,77</b>	<b>88,56</b>

## **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>
<b>Actifs/Assets</b>	<b>249.943.831,56</b>
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
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>2.000.795,44</b>
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
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>247.943.036,12</b>

# 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>7.144.399,83</b>
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
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>10.379.718,40</b>
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
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>-3.235.318,57</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- 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
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>-2.342.662,01</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- 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
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>983.415,94</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	101.109.459,82
Rachats d'actions/Redemptions of shares	-97.559.850,75
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>4.533.025,01</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>243.410.011,11</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>247.943.036,12</b>

## HELIUM FUND - Helium Invest

### Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23	31/12/22
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>247.943.036,12</b>	<b>243.410.011,11</b>	<b>205.892.520,01</b>
<b>A - EUR</b>				
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
<b>A - USD</b>				
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>B - EUR</b>				
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
<b>S - EUR</b>				
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
<b>C - EUR</b>				
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
<b>Bcl - EUR</b>				
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
<b>D - EUR</b>				
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>
<b>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</b>			<b>231.468.914,44</b>	<b>93,36</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>22.704.375,44</b>	<b>9,16</b>
<b>Finlande/Finland</b>			<b>895.568,49</b>	<b>0,36</b>
CAVERION OYJ	EUR	100.000	895.568,49	0,36
<b>Japon/Japan</b>			<b>1.532.343,39</b>	<b>0,62</b>
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
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>6.864.565,76</b>	<b>2,77</b>
DSM KONINKLIJKE	EUR	68.500	6.864.565,76	2,77
<b>Suède/Sweden</b>			<b>13.411.897,80</b>	<b>5,41</b>
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
<b>Obligations/Bonds</b>			<b>21.599.346,78</b>	<b>8,71</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>328.268,70</b>	<b>0,13</b>
ACCENTRO REAL ESTATE 5.625 20-26 13/02S	EUR	810.000	328.268,70	0,13
<b>Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles</b>			<b>6.655.904,00</b>	<b>2,68</b>
SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A	EUR	6.400.000	6.655.904,00	2,68
<b>France</b>			<b>519.694,08</b>	<b>0,21</b>
BNP PARIBAS FL.R 85-XX XX/XXA	EUR	940	519.694,08	0,21
<b>Luxembourg</b>			<b>6.309.110,00</b>	<b>2,54</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>7.786.370,00</b>	<b>3,14</b>
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
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>			<b>17.104.189,21</b>	<b>6,90</b>
<b>Canada</b>			<b>1.308.547,50</b>	<b>0,53</b>
CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q	EUR	1.300.000	1.308.547,50	0,53
<b>Espagne/Spain</b>			<b>1.989.030,00</b>	<b>0,80</b>
BANCA MARCH SA FL.R 21-25 17/11A	EUR	2.000.000	1.989.030,00	0,80
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>7.498.806,21</b>	<b>3,02</b>
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
<b>France</b>			<b>3.910.822,50</b>	<b>1,58</b>
SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q	EUR	3.900.000	3.910.822,50	1,58
<b>Luxembourg</b>			<b>1.402.588,00</b>	<b>0,57</b>
OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S	EUR	1.397.000	1.402.588,00	0,57
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>994.395,00</b>	<b>0,40</b>
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A	EUR	1.000.000	994.395,00	0,40
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>			<b>170.061.003,01</b>	<b>68,59</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>35.125.502,50</b>	<b>14,17</b>
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
<b>Autriche/Austria</b>			<b>7.391.475,00</b>	<b>2,98</b>
AMS AGA 0.00 18-25 05/03U	EUR	7.800.000	7.391.475,00	2,98
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>4.948.634,00</b>	<b>2,00</b>
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
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>3.674.065,78</b>	<b>1,48</b>
BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A	USD	4.000.000	3.674.065,78	1,48
<b>Espagne/Spain</b>			<b>854.865,00</b>	<b>0,34</b>
AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S	EUR	900.000	854.865,00	0,34
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>1.306.864,00</b>	<b>0,53</b>
JPM CHASE FIN CO LLC CV 0 22-25 14/01U1U	EUR	1.300.000	1.306.864,00	0,53
<b>France</b>			<b>69.184.258,33</b>	<b>27,90</b>
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
<b>Irlande/Ireland</b>			<b>6.350.025,00</b>	<b>2,56</b>
GLANBIA CO-OPERATI CV 1.875 22-27 27/01S	EUR	5.500.000	6.350.025,00	2,56
<b>Italie/Italy</b>			<b>12.409.327,50</b>	<b>5,00</b>
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
<b>Jersey</b>			<b>2.303.520,67</b>	<b>0,93</b>
PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S	GBP	2.000.000	2.303.520,67	0,93
<b>Mexique/Mexico</b>			<b>2.379.540,00</b>	<b>0,96</b>
FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A	EUR	2.400.000	2.379.540,00	0,96
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>9.286.612,29</b>	<b>3,75</b>
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
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>7.498.071,89</b>	<b>3,02</b>
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
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>7.348.241,05</b>	<b>2,96</b>
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
<b>Autres valeurs mobilières/Other transferable securities</b>			<b>9.797,06</b>	<b>0,00</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>9.797,06</b>	<b>0,00</b>
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>9.797,06</b>	<b>0,00</b>
CHINOOK THERAPEUTICS	USD	15.000	9.797,06	0,00
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>231.478.711,50</b>	<b>93,36</b>

# **HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven**

# HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

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

	Exprimé en Expressed in EUR
<b>Actifs/Assets</b>	<b>278.943.440,20</b>
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation/Securities portfolio at market value	243.688.314,78
Prix de revient/Cost price	241.709.154,10
Options (positions longues) à la valeur d'évaluation/Options (long positions) at market value	47.142,62
Options achetées au prix de revient/Options purchased at cost	46.994,27
Avoirs en banque et liquidités/Cash at banks and liquidities	32.891.978,47
A recevoir sur investissements vendus/Receivable for investments sold	96.289,58
Plus-value nette non réalisée sur contrats futures/Net unrealised appreciation on financial futures	613.240,66
Plus-value nette non réalisée sur swaps/Net unrealised appreciation on swaps	490.185,90
Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres/Dividends receivable on securities portfolio	12.887,09
Dividendes à recevoir sur swaps/Dividends receivable on swaps	64.417,08
Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres/Interests receivable on securities portfolio	709.723,35
Autres intérêts à recevoir/Other interests receivable	8.310,80
A recevoir sur change/Receivable on foreign exchange	319.632,01
Autres actifs/Other assets	1.317,86
<b>Passifs/Liabilities</b>	<b>2.615.838,31</b>
Options (positions courtes) à la valeur d'évaluation/Options (short positions) at market value	119.703,93
Options vendues au prix de revient/Options sold at cost	147.990,23
Découvert bancaire/Bank overdrafts	1.213.450,56
A payer sur investissements achetés/Payable on investments purchased	408.738,65
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme/Net unrealised depreciation on forward foreign exchange contracts	63.802,20
Commissions de gestion à payer/Management fees payable	126.507,43
Commissions de performance à payer/Performance fees payable	140.598,15
Dividendes à payer sur swaps/Dividends payable on swaps	97.622,21
Intérêts à payer sur swaps/Interests payable on swaps	88.733,89
Autres intérêts à payer/Other interests payable	845,30
A payer sur change/Payable on foreign exchange	320.361,26
Autres passifs/Other liabilities	35.474,73
<b>Valeur nette d'inventaire/Net asset value</b>	<b>276.327.601,89</b>

# HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

## 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>
<b>Revenus/Income</b>	<b>4.016.958,71</b>
Dividendes sur portefeuille-titres, nets/Dividends on securities portfolio, net	311.045,74
Dividendes reçus sur swaps/Dividends received on swaps	222.858,81
Intérêts reçus sur obligations, nets/Interests on bonds, net	1.188.317,01
Intérêts reçus sur swaps/Interests received on swaps	1.258.433,05
Intérêts bancaires/Bank interests on cash accounts	442.068,65
Autres revenus/Other income	594.235,45
<b>Dépenses/Expenses</b>	<b>3.841.712,22</b>
Commissions de gestion/Management fees	728.488,42
Commissions de performance/Performance fees	140.598,15
Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire/Depositary and sub-depositary fees	32.163,21
Commissions d'administration/Administration fees	42.170,92
Frais de domiciliation/Domiciliary fees	1.087,73
Amortissement des frais d'établissement/Amortisation of formation expenses	4.923,25
Frais d'audit/Audit fees	2.148,19
Frais légaux/Legal fees	9.561,37
Frais de transaction/Transaction fees	60.110,24
Rémunération administrateurs/Directors fees	3.258,49
Taxe d'abonnement/Subscription tax	11.926,66
Intérêts payés sur découvert bancaire/Interests paid on bank overdraft	161.604,74
Dividendes payés sur swaps/Dividends paid on swaps	236.462,90
Intérêts payés sur swaps/Interests paid on swaps	2.384.371,31
Frais bancaires/Banking fees	852,00
Autres dépenses/Other expenses	21.984,64
<b>Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements/Net income / (loss) from investments</b>	<b>175.246,49</b>
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :/Net realised profit / (loss) on:</b>	
- ventes d'investissements/- sales of investment securities	-4.221.479,34
- options	328.068,00
- contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts	472.026,78
- contrats futures/- financial futures	1.899.966,12
- swaps	871.037,65
- change/- foreign exchange	6.238.517,40
<b>Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s/Net realised profit / (loss)</b>	<b>5.763.383,10</b>
<b>Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :/Movement in net unrealised appreciation / (depreciation) on:</b>	
- ventes d'investissements/- investments	-1.603.261,77
- options	703.352,65
- contrats de change à terme/- forward foreign exchange contracts	-417.323,93
- contrats futures/- financial futures	-738.009,63
- swaps	-23.210,01
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations/Net increase / (decrease) in net assets as a result of operations</b>	<b>3.684.930,41</b>
Souscriptions d'actions/Subscriptions of shares	66.999.998,33
<b>Augmentation / (diminution) nette des actifs/Net increase / (decrease) in net assets</b>	<b>70.684.928,74</b>
<b>Actifs nets au début de la période/Net assets at the beginning of the period</b>	<b>205.642.673,15</b>
<b>Actifs nets à la fin de la période/Net assets at the end of the period</b>	<b>276.327.601,89</b>

# HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

---

## Statistiques/*Statistics*

		30/06/24	31/12/23
<b>Total des actifs nets/<i>Total Net Assets</i></b>	<b>EUR</b>	<b>276.327.601,89</b>	<b>205.642.673,15</b>
<b>A - EUR</b>			
Nombre d'actions/ <i>Number of shares</i>		264.244,488	200.000,000
Valeur nette d'inventaire par action/ <i>Net asset value per share</i>	EUR	1.045,73	1.028,21



## HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

---

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	200.000,000	64.244,488	0,000	264.244,488

# HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

## 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/ <i>Transferable securities admitted to an official stock exchange listing and/or dealt in on another regulated market</i>			<b>243.688.314,78</b>	<b>88,19</b>
<b>Actions/Shares</b>			<b>29.864.408,40</b>	<b>10,81</b>
<b>Allemagne/Germany</b>				
OHB SE	EUR	1.000	43.600,00	0,02
<b>Australie/Australia</b>				
CSR LTD	AUD	15.000	83.001,00	0,03
<b>Belgique/Belgium</b>				
FINANCIERE DE TUBIZE	EUR	3.538	368.659,60	0,13
<b>Espagne/Spain</b>				
ARIMA --- BEARER SHS	EUR	44.881	375.205,16	0,14
<b>États-Unis/United States of America</b>				
APARTMENT INCOME REIT CORP	USD	30.475	1.112.369,49	0,40
HIBBETT SPORTS	USD	2.080	169.252,90	0,06
PERFICIENT INC	USD	363	25.331,25	0,01
<b>France</b>				
MEDINCELL SA	EUR	38.599	513.366,70	0,19
SMCP SAS	EUR	74.000	137.640,00	0,05
VIVENDI SA	EUR	447.000	4.360.932,00	1,58
VOYAGEURS DU MONDE SA	EUR	2.100	299.040,00	0,11
<b>Îles Vierges Britanniques/British Virgin Islands</b>				
HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGIES	USD	12.259	247.524,85	0,09
<b>Italie/Italy</b>				
SARAS RAFFINERIE SARDE SPA	EUR	102.893	166.583,77	0,06
<b>Japon/Japan</b>				
BENEFIT ONE INC	JPY	526	6.629,85	0,00
BENESSE HOLDINGS INC	JPY	1.598	24.099,53	0,01
TAISHO PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	JPY	25.100	1.254.987,62	0,45
<b>Malte/Malta</b>				
KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC	SEK	37.680	418.297,80	0,15
<b>Norvège/Norway</b>				
GRAM CAR --- REGISTERED SHS	NOK	8.165	185.673,88	0,07
PGS ASA	NOK	80.000	62.673,62	0,02
TGS ASA	NOK	35.900	403.310,70	0,15
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>				
AVANTIUM - REGISTERED	EUR	50.395	129.767,13	0,05
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>				
ALPHA FINANCIAL SHARES	GBP	2.248	13.124,49	0,00
LOK 'N' STORE GP REGISTERED SHS	GBP	13.485	174.954,30	0,06
MATTIOLI WOODS PLC	GBP	368.360	3.423.573,51	1,24
TRIDENT ROYALTIES PLC	GBP	906.267	509.865,38	0,18
<b>Suède/Sweden</b>				
KINNEVIK AB-RDS	SEK	168.198	340.841,76	0,12
KINNEVIK AB- RDS	SEK	7.409.133	15.014.102,11	5,43
<b>Obligations/Bonds</b>			<b>10.982.438,00</b>	<b>3,97</b>
<b>Antilles Néerlandaises/Netherlands Antilles</b>				
SIMON GLOBAL DEVELOP 3.5 23-26 14/11A	EUR	4.300.000	4.471.935,50	1,62

# HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

## 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
<b>Luxembourg</b>			<b>3.301.111,50</b>	<b>1,19</b>
LAGFIN SCA 3.50 23-28 08/06S	EUR	2.600.000	2.402.205,00	0,87
LOGICOR FINANCING 0.75 19-24 15/07A/07A	EUR	900.000	898.906,50	0,33
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>3.209.391,00</b>	<b>1,16</b>
EC FINANCE PLC 3.0000 21-26 15/10S	EUR	2.300.000	2.229.551,00	0,81
INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A	EUR	1.000.000	979.840,00	0,35
<b>Obligations à taux variables/Floating rate notes</b>			<b>13.916.795,00</b>	<b>5,04</b>
<b>Canada</b>			<b>503.287,50</b>	<b>0,18</b>
CAN IMP BK SYD FL.R 24-27 29/01Q	EUR	500.000	503.287,50	0,18
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>7.420.934,00</b>	<b>2,69</b>
BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-26 27/10A	EUR	4.000.000	3.905.660,00	1,41
CITIGROUP INC FL.R 18-26 24/07A	EUR	3.600.000	3.515.274,00	1,27
<b>France</b>			<b>2.105.827,50</b>	<b>0,76</b>
SOCIETE GENERALE SUB FL.R 24-26 19/01Q	EUR	2.100.000	2.105.827,50	0,76
<b>Japon/Japan</b>			<b>2.196.579,00</b>	<b>0,79</b>
MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 22-25 19/09A	EUR	2.200.000	2.196.579,00	0,79
<b>Luxembourg</b>			<b>695.772,00</b>	<b>0,25</b>
OPUS CHARTERED ISSU FL.R 24-25 22/04S	EUR	693.000	695.772,00	0,25
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>994.395,00</b>	<b>0,36</b>
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 20-26 02/04A	EUR	1.000.000	994.395,00	0,36
<b>Obligations convertibles/Convertible bonds</b>			<b>188.924.673,38</b>	<b>68,37</b>
<b>Allemagne/Germany</b>			<b>33.082.195,00</b>	<b>11,97</b>
DEUTSCHE LUFTHANSA CV 2 20-25 17/11S/11S	EUR	700.000	685.531,00	0,25
DEUTSCHE POST AG CV 0.05 17-25 30/06A	EUR	10.600.000	10.198.631,00	3,69
LEG IMMOBILIEN SE CV 0.875 17-25 01/09S	EUR	2.700.000	2.622.753,00	0,95
RAG-STIFTUNG CV 0 20-26 17/06U17/06U	EUR	5.400.000	5.246.424,00	1,90
TAG IMMOBILIEN AG CV 0.625 20-26 27/08S	EUR	10.200.000	9.356.460,00	3,39
ZALANDO SE CV 0.05 20-25 06/08A	EUR	5.200.000	4.972.396,00	1,80
<b>Autriche/Austria</b>			<b>5.875.275,00</b>	<b>2,13</b>
AMS AGA 0.00 18-25 05/03U	EUR	6.200.000	5.875.275,00	2,13
<b>Belgique/Belgium</b>			<b>24.365.103,00</b>	<b>8,82</b>
GROUPE BRUXELLES CV 2.125 22-25 29/11A	EUR	10.500.000	10.233.510,00	3,70
SAGERPAR SA CV 0 21-26 01/04U1-26 01/04U	EUR	7.800.000	7.264.881,00	2,63
UMICORE SA CV 0.00 20-25 23/06U	EUR	7.200.000	6.866.712,00	2,48
<b>Bermudes/Bermuda</b>			<b>5.694.801,96</b>	<b>2,06</b>
BW OFFSHORE CV 2.50 19-24 12/11A	USD	6.200.000	5.694.801,96	2,06
<b>Espagne/Spain</b>			<b>7.974.151,00</b>	<b>2,89</b>
AUDAX RENOVABLES CV 2.75 20-25 30/11S	EUR	200.000	189.970,00	0,07
CRITERIA CAIXA SAU CV 0 21-25 22/06U	EUR	8.100.000	7.784.181,00	2,82
<b>États-Unis/United States of America</b>			<b>2.513.200,00</b>	<b>0,91</b>
JPM CHASE FIN CO LLC CV 0 22-25 14/01U1U	EUR	2.500.000	2.513.200,00	0,91
<b>France</b>			<b>63.411.801,00</b>	<b>22,95</b>
ATOS SE CV 0 19-24 06/11U11U	EUR	6.100.000	1.586.000,00	0,57
CLARIANE 0.875 20-27 06/03A	EUR	31.120	1.535.661,40	0,56
EDENRED SA CV 0.00 19-24 06/09U	EUR	180.931	10.967.765,82	3,97
GENFIT CV DY CV 3.50 17-25 16/10S	EUR	103.742	2.813.513,01	1,02
KORIAN SA CV FL.R 21-99 31/12S	EUR	46.000	1.605.039,67	0,58
NEOEN SPA 2.00 20-25 02/06S	EUR	31.482	1.491.680,13	0,54
NEOEN SPA CV 2.875 22-27 14/09S	EUR	800.000	805.920,00	0,29

## HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven

### 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>
NEXITY SA CV 0.25 18-25 02/03S	EUR	48.228	3.076.877,68	1,11
NEXITY SA CV 0.875 21-28 19/04S	EUR	11.000	369.561,50	0,13
ORPEA CV 2.00 24-31 07/02A	EUR	1.100.000	1.061.065,50	0,38
SELENA SARL CV 0.00 20-25 25/06U	EUR	146	13.978.113,00	5,06
UBISOFT ENTERTA CV 0.0 19-24 24/09U	EUR	50.268	5.694.937,12	2,06
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.875 23-31 05/12S	EUR	600.000	544.188,00	0,20
VOLTALIA SA CV 21-25 13/01A	EUR	85.000	2.593.459,32	0,94
WENDEL CV 2.625 23-26 27/03A	EUR	5.500.000	5.447.750,00	1,97
WORLDLINE SA CV 0.00 19-26 30/07U	EUR	106.236	9.840.268,85	3,56
<b>Irlande/Ireland</b>			<b>2.540.010,00</b>	<b>0,92</b>
GLANBIA CO-OPERATI CV 1.875 22-27 27/01S	EUR	2.200.000	2.540.010,00	0,92
<b>Italie/Italy</b>			<b>8.387.519,50</b>	<b>3,04</b>
NEXI SPA CV 1.75 20-27 24/04S	EUR	2.800.000	2.590.756,00	0,94
PIRELLI AND C SPA CV 0.00 20-25 22/12U	EUR	700.000	739.956,00	0,27
SELINI CV 4.0 24-28 30/05Q	EUR	2.100.000	2.070.547,50	0,75
SNAM CV 3.25 23-28 29/09S	EUR	3.000.000	2.986.260,00	1,08
<b>Jersey</b>			<b>1.913.232,70</b>	<b>0,69</b>
PHP FINANCE JERS CV 2.875 19-25 15/07S	GBP	1.000.000	1.151.760,34	0,42
SIRIUS MINERALS FINA CV 5 19-27 23/05Q	USD	600.000	761.472,36	0,28
<b>Mexique/Mexico</b>			<b>3.767.605,00</b>	<b>1,36</b>
FOME EC CV 2.625 23-26 24/02A	EUR	3.800.000	3.767.605,00	1,36
<b>Pays-Bas/Netherlands</b>			<b>18.055.150,72</b>	<b>6,53</b>
BASIC FIT NV CV 1.5 21-28 17/06S	EUR	1.800.000	1.634.103,00	0,59
MONDELEZ INTL HDLG NL CV 0 21-24 20/09UU	EUR	11.000.000	10.901.880,00	3,95
QIAGEN NV CV 0.00 20-27 17/12U	USD	6.400.000	5.519.167,72	2,00
<b>Royaume-Uni/United Kingdom</b>			<b>4.084.706,62</b>	<b>1,48</b>
CAPITAL AND COUNTIES CV 2.0 20-26 30/03S	GBP	3.700.000	4.084.706,62	1,48
<b>Suisse/Switzerland</b>			<b>7.259.921,88</b>	<b>2,63</b>
CEMBRA MONEY BANK SA CV 0 19-26 09/07U	CHF	2.600.000	2.589.173,98	0,94
SWISS PRIME SITE AG CV 0.325 18-25 16/01A	CHF	4.545.000	4.670.747,90	1,69
<b>Total du portefeuille-titres/Total securities portfolio</b>			<b>243.688.314,78</b>	<b>88,19</b>

# **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.

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

- HELIUM FUND - Helium Fund;
- HELIUM FUND - Helium Performance;
- HELIUM FUND - Helium Selection;
- HELIUM FUND - Helium Alpha;
- HELIUM FUND - Helium Invest;
- HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven.

*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.*

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

- HELIUM FUND - Helium Fund;
- HELIUM FUND - Helium Performance;
- HELIUM FUND - Helium Selection;
- HELIUM FUND - Helium Alpha;
- HELIUM FUND - Helium Invest;
- HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven.

### 2 - Principales méthodes comptables/2 - Principal accounting policies

#### 2.1 - Conversion des devises étrangères/2.1 - Foreign currency translation

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:

# HELIUM FUND

## Notes aux états financiers/Notes to the financial statements

### 2 - Principales méthodes comptables/2 - Principal accounting policies

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
<b>TOTAL</b>				<b>29,067.60</b>		
HELIUM FUND – Syquant Global Event- Driven	Classe A EUR	LU2643775955	EUR	140,598.15	209,288,191.17	0,07
<b>TOTAL</b>				<b>140,598.15</b>		

### 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 Fund	HELIUM FUND - Helium Performance	HELIUM FUND - Helium Selection
Actifs/Assets used En valeur absolue/In absolute terms En % de la valeur nette d'inventaire totale/ As a % of total net asset value	En EUR/ In EUR 6.962.500,99 0,85%	En EUR/ In EUR 10.338.451,26 1,07%	En EUR/ In EUR 16.121.245,35 1,93%
Ventilation des transactions sur base de la date de maturité résiduelle Transactions classified according to residual maturities  De 1 semaine à 1 mois *(voir note) From 1 week to 1 month *(see note)	En EUR/ In EUR  6.962.500,99	En EUR/ In EUR  10.338.451,26	En EUR/ In EUR  16.121.245,35
Les 10 principales contreparties/ The 10 largest counterparties Première contrepartie/First name  Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades  Pays d'établissement/Country of establishment  Seconde contrepartie/Second name  Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades  Pays d'établissement/Country of establishment  Troisième contrepartie/Third name  Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades  Pays d'établissement/Country of establishment  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	En EUR/ In EUR Morgan Stanley Europe SE  4.636.530,51  Allemagne/Germany  BNP Paribas  1.578.157,34  France/France BOFA SECURITIES EUROPE SA  747.813,14  France/France	En EUR/ In EUR Morgan Stanley Europe SE  6.134.617,71  Allemagne/Germany  BNP Paribas  2.982.164,22  France/France JP MorganSecurities Ltd  1.221.669,33  Allemagne/Germany	En EUR/ In EUR Morgan Stanley Europe SE  11.974.577,94  Allemagne/Germany  BNP Paribas  2.729.221,23  France/France JP MorganSecurities Ltd  1.417.446,18  Allemagne/Germany
Revenus et coûts/ Revenues and expenditures Revenus du Fonds:/ Revenues of the Fund: En valeur absolue/ In absolute amount En % des revenus bruts/ In % of gross revenue Coûts du Fonds:/ Expenditure component of the Fund:	En EUR/ In EUR 171.025.501,89 100% 166.045.170,52	En EUR/ In EUR 206.808.867,66 100% 210.279.948,25	En EUR/ In EUR 153.114.360,18 100% 153.398.491,59



# 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 Alpha	HELIUM FUND - Helium Invest	HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven
Actifs/Assets used En valeur absolue/In absolute terms En % de la valeur nette d'inventaire totale/ As a % of total net asset value	En EUR/ In EUR 862.795,29 4,60%	En EUR/ In EUR 2.517.415,21 1,02%	En EUR/ In EUR 1.718.707,43 0,62%
Ventilation des transactions sur base de la date de maturité résiduelle/Transactions classified according to residual maturities  De 1 semaine à 1 mois *(voir note)/ From 1 week to 1 month *(see note)	En EUR/ In EUR  862.795,29	En EUR/ In EUR  2.517.415,21	En EUR/ In EUR  1.718.707,43
Les 10 principales contreparties/ The 10 largest counterparties	En EUR/ In EUR	En EUR/ In EUR	En EUR/ In EUR
Première contrepartie/First name	Morgan Stanley Europe SE	Morgan Stanley Europe SE	Morgan Stanley Europe SE
Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades	862.795,29	1.617.367,05	1.402.718,38
Pays d'établissement/Country of establishment	Allemagne/Germany	Allemagne/Germany	Allemagne/Germany
Seconde contrepartie/Second name	-	BNP Paribas	BNP Paribas
Volumes bruts des positions ouvertes/Gross volumes for open trades	-	855.711,04	315.989,05
Pays d'établissement/Country of establishment	-	France/France	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 Revenus du Fonds:/ Revenues of the Fund: En valeur absolue/ In absolute amount En % des revenus bruts/ In % of gross revenue Coûts du Fonds:/Expenditure component of the Fund:	En EUR/ In EUR 3.961.005,78 100% 3.931.460,32	En EUR/ In EUR 40.310.375,16 100% 45.786.094,70	En EUR/ In EUR 1.602.511,71 100% 16.894.226,42

\*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 Alpha	-	-	-	527.237,13	40.000,00	-	-	-
HELIUM FUND - Helium Invest	-	-	863.499,82	876.893,67	30,77	35.000,00	-	-
HELIUM FUND - Syquant Global Event-Driven	1.240,26	-	27.264,64	2.212.761,35	101.110,01	-	-	-