



GESTION  
MONDIALE D'ACTIFS

# ÉTATS FINANCIERS ANNUELS 2022

FONDS SÉRIE  
SUNWISE® ESSENTIEL 2

31 DÉCEMBRE 2022

Financière   
Sun Life

*émis par la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie*

# Table des matières

<b>Rapport de l'auditeur indépendant</b> .....	1	<b>Fonds jumelé(s)</b>	
<b>Fonds d'actions</b>		Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	197
Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2.....	4	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2.....	204
Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2.....	10	Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2.....	211
Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2.....	16	Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	218
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	22	Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	225
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	28	Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	232
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	34	Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	239
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	40	Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2.....	246
Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	46	Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du NordMD SunWise Essentiel 2)</i> .....	253
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2.....	52	Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2.....	259
Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2.....	58	Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2.....	266
Fonds distinct Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2.....	64	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2.....	272
Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	70	Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	278
Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2.....	76	Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	284
Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	82	Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	290
Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	88	Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	296
Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	94		
Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	100	<b>Portfeuille(s)</b>	
Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	106	Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2.....	302
<b>Fonds équilibré(s)</b>		Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2.....	309
Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2.....	112	Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2.....	316
Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2.....	119	Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2.....	323
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2.....	126	Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2.....	330
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	133	Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)</i> .....	336
Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2.....	140	Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2.....	343
Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2.....	146	Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2.....	349
<b>Fonds de revenu</b>		Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2.....	355
Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2.....	152	Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2.....	361
Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	158	Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2.....	367
Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2.....	165	Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2.....	373
Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)</i> .....	172	<b>Notes des états financiers</b> .....	379
Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2 <i>(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)</i> .....	178	<b>Avis juridique</b> .....	384
Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2.....	185		
Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2.....	191		

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

## RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux titulaires de contrat de

Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2  
Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)  
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2  
Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

(collectivement, les « Fonds »)

### **Opinion**

Nous avons effectué l'audit des états financiers des Fonds, qui comprennent les états de la situation financière aux 31 décembre 2022 et 2021 (le cas échéant), et les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat et les tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates, ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des principales méthodes comptables.

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière des Fonds aux 31 décembre 2022 et 2021 (le cas échéant), ainsi que de leur performance financière et de leurs flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates, conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS).

### **Fondement de l'opinion**

Nous avons effectué notre audit conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers » du présent rapport. Nous sommes indépendants des Fonds conformément aux règles de déontologie qui s'appliquent à l'audit des états financiers au Canada et nous sommes acquittés des autres responsabilités déontologiques qui nous incombent selon ces règles. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

### **Responsabilités de la direction et des responsables de la gouvernance à l'égard des états financiers**

La direction est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux IFRS, ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation d'états financiers exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs.

Lors de la préparation des états financiers, c'est à la direction qu'il incombe d'évaluer la capacité des Fonds à poursuivre leur exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si la direction a l'intention de liquider les Fonds ou de cesser leur activité ou si aucune autre solution réaliste ne s'offre à elle.

Il incombe aux responsables de la gouvernance de surveiller le processus d'information financière des Fonds.

## Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de cet audit. En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;
- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne des Fonds;
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que des informations y afférentes fournies par cette dernière;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par la direction du principe comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité des Fonds à poursuivre leur exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener les Fonds à cesser leur exploitation;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle.

Nous communiquons aux responsables de la gouvernance notamment l'étendue et le calendrier prévus des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.

Nous fournissons également aux responsables de la gouvernance une déclaration précisant que nous nous sommes conformés aux règles de déontologie pertinentes concernant l'indépendance, et leur communiquons toutes les relations et les autres facteurs qui peuvent raisonnablement être considérés comme susceptibles d'avoir des incidences sur notre indépendance ainsi que les sauvegardes connexes s'il y a lieu.

L'associé responsable de la mission d'audit au terme de laquelle le présent rapport de l'auditeur indépendant est délivré est Jason Neil.

*Ernst & Young S.R.L./S.E.N.C.R.L.*  
Comptables agréés  
Experts-comptables autorisés

Toronto, Canada

28 avril 2023

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	5 962	7 865
Trésorerie	27	11
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	2	23
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	5 991	7 899
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	5 991	7 899
*Placements au coût	6 683	6 200
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	20,45	23,73
Catégorie GPP	28,25	31,76

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	117	155
Distribution de gains en capital provenant des placements	170	110
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 276	239
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 386)	1 443
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(823)	1 947
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	117	148
Frais d'administration	14	18
Frais d'assurance	39	50
Taxe de vente harmonisée	19	25
	189	241
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(1 012)	1 706
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,39)	4,64
Catégorie GPP	(3,17)	6,94
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	269 547	333 561
Catégorie GPP	30 980	22 881

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	7 899	7 756
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 012)	1 706
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	701	1 317
Montant versé au rachat de parts	(1 597)	(2 880)
	(896)	(1 563)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	5 991	7 899

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 012)	1 706
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 276)	(239)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 386	(1 443)
Produit de la vente de placements	8 836	1 912
Achat de placements	(7 735)	(121)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(287)	(265)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	912	1 550
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	701	1 317
Montant versé au rachat de parts	(1 597)	(2 885)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(896)	(1 568)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	16	(18)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	11	29
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	27	11
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	265 135	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	6 683 445	5 961 541	99,51
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>6 683 445</b>	<b>5 961 541</b>	<b>99,51</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				29 272	0,49
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>5 990 813</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	1 200 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
	1 517 003	Enbridge Inc.	76 462 009	80 279 799
	1 155 833	Bank of Nova Scotia (La)	86 786 875	76 677 961
	617 806	Banque de Montréal	72 901 579	75 780 084
	1 378 029	Ressources Teck Limitée, catégorie B	48 309 522	70 513 744
	1 596 264	Suncor Énergie Inc.	60 758 442	68 559 539
	1 209 323	Wheaton Precious Metals Corp.	49 543 111	63 973 187
	580 206	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	39 599 063	58 571 796
	1 861 648	TELUS Corp.	53 969 127	48 644 862
	802 933	Alimentation Couche-Tard Inc.	25 240 897	47 774 514
	61 803	UnitedHealth Group Inc.	30 361 220	44 366 131
	338 856	Banque Royale du Canada	42 936 787	43 136 369
	863 435	US Foods Holding Corp.	38 958 102	39 772 475
	841 745	Brookfield Corp.	45 706 640	35 841 502
	224 434	WSP Global Inc.	26 642 938	35 256 337
	373 547	Advanced Micro Devices Inc.	22 480 237	32 759 541
	197 285	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	23 016 464	31 731 319
	354 261	Banque Toronto-Dominion (La)	28 677 241	31 058 062
	340 067	East West Bancorp Inc.	30 174 158	30 343 702
	303 570	Nutrien Ltd.	29 933 612	30 007 895
	244 946	Amazon.com Inc.	22 346 211	27 859 178

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	5 962	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 441 360	7 865	0,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	303 299	376 865	22 094	21 233
Parts émises contre trésorerie	16 329	56 840	11 429	3 091
Parts rachetées	(58 521)	(130 406)	(10 492)	(2 230)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	261 107	303 299	23 031	22 094

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	10
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>10</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	20,45	5 340	261 107	121,41	2,95	0,33	3,28	11,32
2021	23,73	7 197	303 299	4,88	2,95	0,34	3,29	11,61
2020	19,18	7 228	376 865	5,63	2,95	0,34	3,29	11,53
2019	19,34	9 830	508 331	7,00	2,95	0,34	3,29	11,50
2018	16,47	10 191	618 909	7,46	2,95	0,34	3,29	11,58
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	28,25	651	23 031	121,41	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	31,76	702	22 094	4,88	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	24,88	528	21 233	5,63	0,15	0,02	0,17	13,00
2019	24,31	545	22 397	7,00	0,15	0,02	0,17	13,00
2018	20,06	474	23 627	7,46	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 887	5 348
Trésorerie	15	14
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 902	5 362
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 902</b>	<b>5 362</b>
*Placements au coût	4 324	3 871
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	21,15	25,26
Catégorie GPP	29,27	33,87

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	-	9
Distribution de gains en capital provenant des placements	73	62
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 131	179
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 914)	732
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(710)	982
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	60	92
Frais d'administration	8	12
Frais d'assurance	20	31
Taxe de vente harmonisée	9	14
	97	149
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(807)</b>	<b>833</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(4,54)	3,77
Catégorie GPP	(4,07)	5,93
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	132 363	192 655
Catégorie GPP	50 345	17 893

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	5 362	5 033
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(807)	833
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1 458	1 636
Montant versé au rachat de parts	(2 111)	(2 140)
	(653)	(504)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 902	5 362

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(807)	833
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 131)	(179)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 914	(732)
Produit de la vente de placements	6 926	863
Achat de placements	(6 175)	(211)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(73)	(71)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	654	503
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1 458	1 636
Montant versé au rachat de parts	(2 111)	(2 140)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(653)	(504)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	14	15
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	15	14
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	297 722	Fonds d'actions mondiales CI (série I)	4 324 474	3 887 023	99,60
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>4 324 474</b>	<b>3 887 023</b>	<b>99,60</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				15 416	0,40
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 902 439</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	127 471	Microsoft Corp.	36 529 886	41 391 909
	53 135	Elevance Health Inc.	19 180 971	36 905 519
	302 740	Alphabet Inc., catégorie A	19 430 882	36 166 356
	203 500	Apple Inc.	37 022 173	35 800 782
	895 500	Shell PLC	34 919 086	34 095 911
	2 220 100	AIA Group Ltd.	32 207 515	33 428 199
	41 200	Thermo Fisher Scientific Inc.	30 066 829	30 720 132
	313 200	East West Bancorp Inc.	27 741 461	27 946 398
	55 800	Eli Lilly and Co.	27 907 082	27 640 383
	178 900	Prologis Inc.	27 619 042	27 306 656
	455 600	Diageo PLC	27 775 458	27 220 969
	236 220	Amazon.com Inc.	50 510 994	26 866 718
	279 800	Mondelez International Inc., catégorie A	25 507 962	25 250 299
	293 080	Coca-Cola Co. (The)	25 030 169	25 242 377
	276 300	Advanced Micro Devices Inc.	24 798 375	24 231 118
	79 200	Honeywell International Inc.	23 098 166	22 980 846
	81 588	Visa Inc., catégorie A	21 162 490	22 951 279
	95 400	Johnson & Johnson	23 032 835	22 818 163
	835 500	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	23 038 794	22 569 961
	497 900	Bank of America Corp.	23 114 854	22 328 067
	121 500	Safran SA	20 967 028	20 589 706
	704 100	First Quantum Minerals Ltd.	19 146 238	19 918 989
	731 300	Cenovus Energy Inc.	18 706 301	19 211 251
	51 400	Accenture PLC, catégorie A	18 706 476	18 570 890
	98 600	Siemens AG, actions nominatives	18 425 229	18 526 825

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions mondiales CI	159 245	3 887	2,4

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions mondiales CI	1 178 404	5 348	0,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	188 839	210 294	17 442	18 289
Parts émises contre trésorerie	12 471	65 683	36 028	-
Parts rachetées	(79 493)	(87 138)	(8 175)	(847)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	121 817	188 839	45 295	17 442

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	78
2041	106
2042	-
<b>Total</b>	<b>184</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	21,15	2 576	121 817	144,57	2,97	0,32	3,29	10,68
2021	25,26	4 771	188 839	5,54	2,97	0,31	3,28	10,47
2020	21,50	4 522	210 294	8,42	2,97	0,31	3,28	10,59
2019	20,10	4 425	220 180	10,88	2,97	0,30	3,27	10,24
2018	17,07	3 954	231 621	6,77	2,97	0,31	3,28	10,27
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	29,27	1 326	45 295	144,57	0,15	0,02	0,17	10,91
2021	33,87	591	17 442	5,54	0,15	0,02	0,17	11,02
2020	27,95	511	18 289	8,42	0,15	0,02	0,17	11,24
2019	25,32	488	19 277	10,88	0,15	0,02	0,17	11,41
2018	20,86	433	20 745	6,77	0,15	0,02	0,17	11,54

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	441	536
Trésorerie	1	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	442	536
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	442	536
*Placements au coût	458	389
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,23	17,72
Catégorie GPP	23,92	23,83

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	14	-
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	3
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	152	11
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(164)	60
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	2	74
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	6	8
Frais d'administration	1	1
Frais d'assurance	2	2
Taxe de vente harmonisée	1	1
	10	12
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(8)	62
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(0,49)	1,78
Catégorie GPP	0,07	3,09
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	16 416	20 657
Catégorie GPP	7 202	8 260

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	536	517
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(8)	62
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	13	1
Montant versé au rachat de parts	(99)	(44)
	(86)	(43)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	442	536

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(8)	62
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(152)	(11)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	164	(60)
Produit de la vente de placements	583	53
Achat de placements	(486)	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(14)	(3)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	87	41
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	13	1
Montant versé au rachat de parts	(99)	(44)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(86)	(43)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	-	2
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	1	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	14 870	Fonds de valeur mondiale CI (série I)	458 334	440 537	99,65
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>458 334</b>	<b>440 537</b>	<b>99,65</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				1 535	0,35
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>442 072</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	6 427	Willis Towers Watson PLC	1 790 504	2 128 374
	13 335	Intercontinental Exchange Inc.	1 477 130	1 852 323
	5 361	Chubb Ltd.	981 771	1 601 290
	11 789	Sanofi SA	1 385 129	1 535 083
	12 015	Heineken NV	1 421 570	1 530 379
	15 327	Bristol-Myers Squibb Co.	1 164 326	1 493 161
	17 287	TotalEnergies SE	1 078 999	1 469 511
	3 252	Everest Re Group Ltd.	1 100 215	1 458 651
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		1 391 579
	7 252	Hanover Insurance Group Inc.	1 294 113	1 326 870
	1 982	Zurich Insurance Group AG	920 411	1 283 695
	48 330	GSK PLC	1 454 301	1 137 318
	10 535	Medtronic PLC	1 199 518	1 108 628
	17 826	Diageo PLC	824 694	1 065 059
	35 909	NortonLifeLock Inc.	1 098 832	1 041 943
	15 503	Cisco Systems Inc.	928 182	1 000 014
	7 181	Raytheon Technologies Corp.	840 229	981 253
	2 089	Charter Communications Inc., catégorie A	1 260 893	959 146
	7 572	CVS Health Corp.	809 845	955 429
	10 511	Akzo Nobel NV	1 014 292	953 072
	19 705	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc.	906 984	932 722
	5 430	Check Point Software Technologies Ltd.	796 601	927 556
	9 815	Henkel AG & Co., KGaA, privilégiées	1 131 604	924 959
	19 500	Comcast Corp., catégorie A	898 020	923 313
	80 837	Alight Inc.	962 704	915 030

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds de valeur mondiale CI	60 146	441	0,7

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société valeur mondiale CI	250 548	536	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	19 303	21 608	8 135	8 347
Parts émises contre trésorerie	761	35	-	-
Parts rachetées	(4 178)	(2 340)	(1 098)	(212)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>15 886</b>	<b>19 303</b>	<b>7 037</b>	<b>8 135</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	9
2042	-
<b>Total</b>	<b>9</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,23	274	15 886	114,33	2,97	0,36	3,33	12,03
2021	17,72	342	19 303	0,56	2,97	0,34	3,31	11,54
2020	15,92	344	21 608	98,25	2,97	0,35	3,32	11,80
2019	16,29	479	29 401	5,22	2,97	0,35	3,32	11,76
2018	14,12	446	31 568	6,19	2,97	0,36	3,33	12,09
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	23,92	168	7 037	114,33	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	23,83	194	8 135	0,56	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	20,75	173	8 347	98,25	0,15	0,02	0,17	13,00
2019	20,57	177	8 583	5,22	0,15	0,02	0,17	13,00
2018	17,28	152	8 804	6,19	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 466	1 932
Trésorerie	5	7
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 471	1 940
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	1
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 471	1 939
*Placements au coût	1 633	1 468
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,84	20,94
Catégorie GPP	24,62	28,00

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	29	26
Distribution de gains en capital provenant des placements	42	35
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	334	119
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(631)	216
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(226)	396
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	29	36
Frais d'administration	4	4
Frais d'assurance	9	12
Taxe de vente harmonisée	5	6
	47	58
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(273)	338
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,18)	3,20
Catégorie GPP	(3,67)	4,93
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	76 316	90 595
Catégorie GPP	8 078	9 684

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 939	2 203
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(273)	338
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	29	230
Montant versé au rachat de parts	(224)	(832)
	(195)	(602)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 471	1 939

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(273)	338
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(334)	(119)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	631	(216)
Produit de la vente de placements	2 021	693
Achat de placements	(1 780)	(35)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(71)	(61)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	194	600
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	29	230
Montant versé au rachat de parts	(225)	(831)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(196)	(601)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(2)	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	7	8
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	5	7
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	65 177	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	1 633 245	1 465 502	99,59
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 633 245</b>	<b>1 465 502</b>	<b>99,59</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				5 986	0,41
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 471 488</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	1 200 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
	1 517 003	Enbridge Inc.	76 462 009	80 279 799
	1 155 833	Bank of Nova Scotia (La)	86 786 875	76 677 961
	617 806	Banque de Montréal	72 901 579	75 780 084
	1 378 029	Ressources Teck Limitée, catégorie B	48 309 522	70 513 744
	1 596 264	Suncor Énergie Inc.	60 758 442	68 559 539
	1 209 323	Wheaton Precious Metals Corp.	49 543 111	63 973 187
	580 206	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	39 599 063	58 571 796
	1 861 648	TELUS Corp.	53 969 127	48 644 862
	802 933	Alimentation Couche-Tard Inc.	25 240 897	47 774 514
	61 803	UnitedHealth Group Inc.	30 361 220	44 366 131
	338 856	Banque Royale du Canada	42 936 787	43 136 369
	863 435	US Foods Holding Corp.	38 958 102	39 772 475
	841 745	Brookfield Corp.	45 706 640	35 841 502
	224 434	WSP Global Inc.	26 642 938	35 256 337
	373 547	Advanced Micro Devices Inc.	22 480 237	32 759 541
	197 285	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	23 016 464	31 731 319
	354 261	Banque Toronto-Dominion (La)	28 677 241	31 058 062
	340 067	East West Bancorp Inc.	30 174 158	30 343 702
	303 570	Nutrien Ltd.	29 933 612	30 007 895
	244 946	Amazon.com Inc.	22 346 211	27 859 178

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	1 466	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société de placements canadiens CI	653 000	1 932	0,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	80 256	110 333	9 230	10 122
Parts émises contre trésorerie	1 473	11 513	-	-
Parts rachetées	(9 953)	(41 590)	(1 485)	(892)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>71 776</b>	<b>80 256</b>	<b>7 745</b>	<b>9 230</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	2
2042	-
<b>Total</b>	<b>2</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,84	1 281	71 776	114,50	2,95	0,35	3,30	11,75
2021	20,94	1 681	80 256	4,78	2,95	0,34	3,29	11,62
2020	17,84	1 969	110 333	11,39	2,95	0,34	3,29	11,45
2019	16,65	1 985	119 198	7,12	2,95	0,33	3,28	11,29
2018	14,10	2 125	150 628	7,34	2,95	0,35	3,30	11,97
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	24,62	190	7 745	114,50	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	28,00	258	9 230	4,78	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	23,12	234	10 122	11,39	0,15	0,02	0,17	13,00
2019	20,92	150	7 154	7,12	0,15	0,02	0,17	13,00
2018	17,17	126	7 336	7,34	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	594	859
Trésorerie	1	4
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	596	863
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	596	863
*Placements au coût	662	536
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	13,16	15,44
Catégorie GPP	18,14	20,62

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	12	11
Distribution de gains en capital provenant des placements	17	15
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	267	50
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(391)	90
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(95)	166
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	13	17
Frais d'administration	2	2
Frais d'assurance	5	6
Taxe de vente harmonisée	2	2
	22	27
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(117)	139
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,40)	2,32
Catégorie GPP	(9,52)	3,60
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	48 291	58 383
Catégorie GPP	82	941

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	863	837
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(117)	139
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	30	36
Montant versé au rachat de parts	(180)	(149)
	(150)	(113)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	596	863

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(117)	139
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(267)	(50)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	391	(90)
Produit de la vente de placements	928	152
Achat de placements	(759)	(8)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(29)	(26)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	147	117
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	30	36
Montant versé au rachat de parts	(180)	(150)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(150)	(114)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	4	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	1	4
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	26 425	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	661 930	594 164	99,74
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>661 930</b>	<b>594 164</b>	<b>99,74</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				1 573	0,26
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>595 737</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	1 200 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
	1 517 003	Enbridge Inc.	76 462 009	80 279 799
	1 155 833	Bank of Nova Scotia (La)	86 786 875	76 677 961
	617 806	Banque de Montréal	72 901 579	75 780 084
	1 378 029	Ressources Teck Limitée, catégorie B	48 309 522	70 513 744
	1 596 264	Suncor Énergie Inc.	60 758 442	68 559 539
	1 209 323	Wheaton Precious Metals Corp.	49 543 111	63 973 187
	580 206	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	39 599 063	58 571 796
	1 861 648	TELUS Corp.	53 969 127	48 644 862
	802 933	Alimentation Couche-Tard Inc.	25 240 897	47 774 514
	61 803	UnitedHealth Group Inc.	30 361 220	44 366 131
	338 856	Banque Royale du Canada	42 936 787	43 136 369
	863 435	US Foods Holding Corp.	38 958 102	39 772 475
	841 745	Brookfield Corp.	45 706 640	35 841 502
	224 434	WSP Global Inc.	26 642 938	35 256 337
	373 547	Advanced Micro Devices Inc.	22 480 237	32 759 541
	197 285	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	23 016 464	31 731 319
	354 261	Banque Toronto-Dominion (La)	28 677 241	31 058 062
	340 067	East West Bancorp Inc.	30 174 158	30 343 702
	303 570	Nutrien Ltd.	29 933 612	30 007 895
	244 946	Amazon.com Inc.	22 346 211	27 859 178

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	594	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société de placements canadiens CI	653 000	859	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	54 667	62 433	937	944
Parts émises contre trésorerie	2 155	2 445	-	-
Parts rachetées	(11 605)	(10 211)	(899)	(7)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	45 217	54 667	38	937

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	29
2039	7
2040	-
2041	5
2042	-
<b>Total</b>	<b>41</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	13,16	595	45 217	119,02	2,95	0,30	3,25	10,11
2021	15,44	844	54 667	3,92	2,95	0,29	3,24	9,80
2020	13,15	821	62 433	84,92	2,95	0,30	3,25	10,11
2019	12,27	890	72 596	3,78	2,95	0,29	3,24	9,90
2018	10,37	1 027	99 033	3,47	2,95	0,29	3,24	9,87
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	18,14	1	38	119,02	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	20,62	19	937	3,92	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	17,03	16	944	84,92	0,15	0,02	0,17	13,00
2019	15,41	15	951	3,78	0,15	0,02	0,17	13,00
2018	12,63	12	957	3,47	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	2 992	4 198
Trésorerie	1	14
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	2
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 993	4 214
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	2 993	4 214
*Placements au coût	3 353	3 016
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	19,54	21,83
Catégorie GPP	27,01	29,25

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	59	55
Distribution de gains en capital provenant des placements	86	36
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 144	135
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 543)	777
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(254)	1 003
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	61	68
Frais d'administration	8	8
Frais d'assurance	20	22
Taxe de vente harmonisée	10	12
	99	110
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(353)	893
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,26)	4,36
Catégorie GPP	(1,44)	6,50
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	147 249	163 756
Catégorie GPP	13 609	27 416

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	4 214	3 693
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(353)	893
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	540	392
Montant versé au rachat de parts	(1 408)	(764)
	(868)	(372)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	2 993	4 214

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(353)	893
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 144)	(135)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 543	(777)
Produit de la vente de placements	5 491	631
Achat de placements	(4 537)	(137)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(145)	(91)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	855	384
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	540	394
Montant versé au rachat de parts	(1 408)	(771)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(868)	(377)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(13)	7
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	14	7
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	1	14
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	133 071	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	3 352 977	2 992 091	99,95
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 352 977</b>	<b>2 992 091</b>	<b>99,95</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				1 380	0,05
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>2 993 471</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	1 200 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
	1 517 003	Enbridge Inc.	76 462 009	80 279 799
	1 155 833	Bank of Nova Scotia (La)	86 786 875	76 677 961
	617 806	Banque de Montréal	72 901 579	75 780 084
	1 378 029	Ressources Teck Limitée, catégorie B	48 309 522	70 513 744
	1 596 264	Suncor Énergie Inc.	60 758 442	68 559 539
	1 209 323	Wheaton Precious Metals Corp.	49 543 111	63 973 187
	580 206	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	39 599 063	58 571 796
	1 861 648	TELUS Corp.	53 969 127	48 644 862
	802 933	Alimentation Couche-Tard Inc.	25 240 897	47 774 514
	61 803	UnitedHealth Group Inc.	30 361 220	44 366 131
	338 856	Banque Royale du Canada	42 936 787	43 136 369
	863 435	US Foods Holding Corp.	38 958 102	39 772 475
	841 745	Brookfield Corp.	45 706 640	35 841 502
	224 434	WSP Global Inc.	26 642 938	35 256 337
	373 547	Advanced Micro Devices Inc.	22 480 237	32 759 541
	197 285	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	23 016 464	31 731 319
	354 261	Banque Toronto-Dominion (La)	28 677 241	31 058 062
	340 067	East West Bancorp Inc.	30 174 158	30 343 702
	303 570	Nutrien Ltd.	29 933 612	30 007 895
	244 946	Amazon.com Inc.	22 346 211	27 859 178

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	2 992	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions canadiennes sélect CI	830 105	4 198	0,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	158 447	174 118	25 829	28 112
Parts émises contre trésorerie	16 044	19 025	8 263	36
Parts rachetées	(43 380)	(34 696)	(18 098)	(2 319)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	131 111	158 447	15 994	25 829

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	37
2041	16
2042	-
<b>Total</b>	<b>53</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	19,54	2 561	131 111	139,70	2,95	0,34	3,29	11,52
2021	21,83	3 459	158 447	5,64	2,95	0,35	3,30	11,71
2020	17,53	3 053	174 118	2,64	2,95	0,34	3,29	11,59
2019	16,66	3 636	218 259	6,34	2,95	0,35	3,30	11,79
2018	14,08	4 201	298 447	13,16	2,95	0,34	3,29	11,52
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	27,01	432	15 994	139,70	0,15	0,02	0,17	12,93
2021	29,25	755	25 829	5,64	0,15	0,02	0,17	12,93
2020	22,77	640	28 112	2,64	0,15	0,02	0,17	12,97
2019	20,97	633	30 208	6,34	0,15	0,02	0,17	12,94
2018	17,17	556	32 382	13,16	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	2 831	3 887
Trésorerie	7	2
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 838	3 890
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>2 838</b>	<b>3 890</b>
*Placements au coût	3 094	2 729
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	25,52	30,52
Catégorie GPP	35,24	40,85

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	-	11
Distribution de gains en capital provenant des placements	28	20
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	900	225
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 421)	719
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(493)	975
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	57	74
Frais d'administration	7	10
Frais d'assurance	19	24
Taxe de vente harmonisée	9	11
	92	119
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(585)</b>	<b>856</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(5,05)	5,97
Catégorie GPP	(5,38)	8,94
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	104 663	129 655
Catégorie GPP	10 443	9 187

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	3 890	3 937
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(585)	856
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	582	445
Montant versé au rachat de parts	(1 049)	(1 348)
	(467)	(903)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	2 838	3 890

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(585)	856
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(900)	(225)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 421	(719)
Produit de la vente de placements	4 545	1 068
Achat de placements	(3 981)	(53)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(28)	(31)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	472	896
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	582	445
Montant versé au rachat de parts	(1 049)	(1 348)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(467)	(903)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	5	(7)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	2	9
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	7	2
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	52 593	Fonds d'actions américaines sélectionnées CI (catégorie I)	3 094 372	2 830 810	99,74
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 094 372</b>	<b>2 830 810</b>	<b>99,74</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				7 344	0,26
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>2 838 154</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	56 972	Humana Inc.	31 201 463	39 510 382
	341 159	NextEra Energy Inc.	32 200 451	38 617 288
	112 401	Microsoft Corp.	12 814 650	36 498 435
	256 200	Alphabet Inc., catégorie C	23 293 409	30 779 976
	67 835	Air Products and Chemicals Inc.	23 454 461	28 313 246
	77 735	Danaher Corp.	17 425 241	27 936 302
	192 697	Starbucks Corp.	24 108 615	25 882 444
	221 780	Amazon.com Inc.	42 753 405	25 224 370
	111 614	Analog Devices Inc.	23 606 786	24 789 092
	73 956	Stryker Corp.	23 331 229	24 482 354
	86 563	Visa Inc., catégorie A	17 565 667	24 350 781
	51 505	Mastercard Inc., catégorie A	23 383 091	24 249 915
	222 814	Activision Blizzard Inc.	20 245 737	23 094 381
	108 759	Cheniere Energy Inc.	15 624 990	22 083 063
	28 960	Broadcom Inc.	11 590 754	21 924 516
	41 736	United Rentals Inc.	16 387 920	20 084 978
	101 768	AMETEK Inc.	13 140 957	19 252 560
	184 307	Edwards Lifesciences Corp.	24 426 702	18 619 051
	24 147	Thermo Fisher Scientific Inc.	12 245 804	18 004 830
	331 849	Bank of America Corp.	12 191 268	14 881 596
	82 097	Apple Inc.	15 716 793	14 442 933
	23 097	Costco Wholesale Corp.	13 155 405	14 276 279
	81 919	Ross Stores Inc.	12 915 526	12 874 290
	277 440	US Foods Holding Corp.	12 235 926	12 779 741
	108 404	CF Industries Holdings Inc.	13 395 818	12 505 572

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	620 950	2 831	0,5

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions américaines CI	323 926	3 887	1,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	115 645	147 606	8 836	9 518
Parts émises contre trésorerie	12 845	15 459	6 879	-
Parts rachetées	(36 932)	(47 420)	(1 469)	(682)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	91 558	115 645	14 246	8 836

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	93
2042	-
<b>Total</b>	<b>93</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	25,52	2 336	91 558	127,13	2,96	0,33	3,29	11,01
2021	30,52	3 529	115 645	2,15	2,96	0,32	3,28	10,73
2020	24,61	3 633	147 606	5,24	2,96	0,32	3,28	10,93
2019	23,63	4 465	188 956	8,59	2,96	0,32	3,28	10,68
2018	19,45	4 315	221 800	8,45	2,96	0,32	3,28	10,69
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	35,24	502	14 246	127,13	0,15	0,02	0,17	12,85
2021	40,85	361	8 836	2,15	0,15	0,02	0,17	12,86
2020	31,95	304	9 518	5,24	0,15	0,02	0,17	12,93
2019	29,73	291	9 792	8,59	0,15	0,02	0,17	12,85
2018	23,72	242	10 211	8,45	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	752	1 021
Trésorerie	2	4
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	754	1 025
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>754</b>	<b>1 025</b>
*Placements au coût	815	925
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	20,36	21,18
Catégorie GPP	28,22	28,45

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	25	-
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	124	26
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(159)	86
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(10)	112
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	14	19
Frais d'administration	2	3
Frais d'assurance	5	6
Taxe de vente harmonisée	2	3
	23	31
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(33)</b>	<b>81</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(0,97)	1,51
Catégorie GPP	(0,09)	2,44
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	33 549	42 117
Catégorie GPP	6 172	7 167

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 025	1 189
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(33)	81
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	11	91
Montant versé au rachat de parts	(249)	(336)
	(238)	(245)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	754	1 025

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(33)	81
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(124)	(26)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	159	(86)
Produit de la vente de placements	1 286	284
Achat de placements	(1 027)	(6)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(25)	-
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	236	247
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	11	91
Montant versé au rachat de parts	(249)	(337)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(238)	(246)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(2)	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	4	3
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	2	4
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	74 854	Fonds de gestion d'actions internationales Sélect CI (série I)	814 617	751 614	99,67
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>814 617</b>	<b>751 614</b>	<b>99,67</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				2 463	0,33
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>754 077</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	1 309 750	iShares China Large-Cap ETF	44 988 432	50 187 262
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		8 192 037
	429 993	Alibaba Group Holding Ltd.	9 695 713	6 433 410
	407 110	BAE Systems PLC	4 347 958	5 704 434
	53 733	Fomento Económico Mexicano SAB de CV, CAAE	5 546 231	5 683 580
	28 528	Novo Nordisk AS, catégorie B	2 785 495	5 215 645
	6 701 923	Lloyds Banking Group PLC	5 769 998	4 981 704
	31 485	Nestlé SA, actions nominatives	4 609 342	4 939 655
	128 008	Shell PLC	3 832 766	4 912 925
	63 474	HeidelbergCement AG	5 749 646	4 901 682
	11 070	Linde PLC	2 505 043	4 900 865
	26 287	AstraZeneca PLC	4 446 845	4 827 069
	80 500	Diageo PLC	4 406 134	4 809 676
	1 512 625	Indus Towers Ltd.	9 263 848	4 714 850
	253 532	Galp Energia SGPS SA	4 030 533	4 633 753
	499 377	Glencore PLC	2 669 702	4 515 535
	92 043	S <sup>TM</sup> icroelectronics NV	3 669 073	4 402 748
	127 867	Accor SA	5 504 525	4 327 434
	672 961	Rakuten Group Inc.	8 008 641	4 137 982
	503 929	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, actions B	6 410 327	3 982 164
	342 089	Grifols SA, CAAE	6 893 943	3 937 102
	219 633	Glanbia PLC	4 165 494	3 794 538
	156 044	Assicurazioni Generali SpA	3 581 511	3 757 790
	16 539	Capgemini SE	3 576 857	3 738 348
	3 836 369	Kunlun Energy Co., Ltd.	4 198 118	3 706 776

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds de gestion d'actions internationales Sélect CI	423 380	752	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions internationales CI Black Creek	262 062	1 021	0,4

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	38 930	49 995	7 062	7 237
Parts émises contre trésorerie	554	4 049	-	-
Parts rachetées	(10 805)	(15 114)	(1 032)	(175)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>28 679</b>	<b>38 930</b>	<b>6 030</b>	<b>7 062</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	12
2041	31
2042	-
<b>Total</b>	<b>43</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	20,36	584	28 679	126,49	2,97	0,36	3,33	12,09
2021	21,18	824	38 930	0,57	2,97	0,34	3,31	11,51
2020	20,01	1 001	49 995	6,28	2,97	0,34	3,31	11,46
2019	21,26	1 467	68 971	8,08	2,97	0,35	3,32	11,63
2018	18,37	1 546	84 153	16,28	2,97	0,35	3,32	11,90
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	28,22	170	6 030	126,49	0,15	0,02	0,17	12,79
2021	28,45	201	7 062	0,57	0,15	0,02	0,17	12,79
2020	26,05	188	7 237	6,28	0,15	0,02	0,17	12,89
2019	26,82	199	7 435	8,08	0,15	0,02	0,17	12,78
2018	22,46	175	7 780	16,28	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 678	2 476
Trésorerie	6	7
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	2
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 684	2 485
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	1
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 684	2 484
*Placements au coût	1 872	1 660
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	26,85	33,36
Catégorie GPP	37,73	45,44

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	-	6
Distribution de gains en capital provenant des placements	17	39
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	598	173
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 010)	470
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(395)	688
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	36	47
Frais d'administration	4	6
Frais d'assurance	12	16
Taxe de vente harmonisée	6	8
	58	77
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(453)	611
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(6,96)	7,58
Catégorie GPP	(9,36)	11,07
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	63 375	77 896
Catégorie GPP	1 313	1 833

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	2 484	2 302
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(453)	611
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	9	401
Montant versé au rachat de parts	(356)	(830)
	(347)	(429)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 684	2 484

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(453)	611
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(598)	(173)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 010	(470)
Produit de la vente de placements	2 483	732
Achat de placements	(2 078)	(225)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(17)	(45)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	347	430
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	9	401
Montant versé au rachat de parts	(357)	(829)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(348)	(428)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	7	5
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	6	7
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	31 173	Fonds d'actions américaines sélectionnées CI (catégorie I)	1 871 978	1 677 878	99,61
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 871 978</b>	<b>1 677 878</b>	<b>99,61</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				6 598	0,39
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 684 476</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	56 972	Humana Inc.	31 201 463	39 510 382
	341 159	NextEra Energy Inc.	32 200 451	38 617 288
	112 401	Microsoft Corp.	12 814 650	36 498 435
	256 200	Alphabet Inc., catégorie C	23 293 409	30 779 976
	67 835	Air Products and Chemicals Inc.	23 454 461	28 313 246
	77 735	Danaher Corp.	17 425 241	27 936 302
	192 697	Starbucks Corp.	24 108 615	25 882 444
	221 780	Amazon.com Inc.	42 753 405	25 224 370
	111 614	Analog Devices Inc.	23 606 786	24 789 092
	73 956	Stryker Corp.	23 331 229	24 482 354
	86 563	Visa Inc., catégorie A	17 565 667	24 350 781
	51 505	Mastercard Inc., catégorie A	23 383 091	24 249 915
	222 814	Activision Blizzard Inc.	20 245 737	23 094 381
	108 759	Cheniere Energy Inc.	15 624 990	22 083 063
	28 960	Broadcom Inc.	11 590 754	21 924 516
	41 736	United Rentals Inc.	16 387 920	20 084 978
	101 768	AMETEK Inc.	13 140 957	19 252 560
	184 307	Edwards Lifesciences Corp.	24 426 702	18 619 051
	24 147	Thermo Fisher Scientific Inc.	12 245 804	18 004 830
	331 849	Bank of America Corp.	12 191 268	14 881 596
	82 097	Apple Inc.	15 716 793	14 442 933
	23 097	Costco Wholesale Corp.	13 155 405	14 276 279
	81 919	Ross Stores Inc.	12 915 526	12 874 290
	277 440	US Foods Holding Corp.	12 235 926	12 779 741
	108 404	CF Industries Holdings Inc.	13 395 818	12 505 572

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	620 950	1 678	0,3

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	611 927	2 476	0,4

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	71 883	88 474	1 886	595
Parts émises contre trésorerie	315	12 260	-	1 329
Parts rachetées	(11 251)	(28 851)	(619)	(38)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>60 947</b>	<b>71 883</b>	<b>1 267</b>	<b>1 886</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	4
2039	-
2040	-
2041	49
2042	-
<b>Total</b>	<b>53</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	26,85	1 636	60 947	114,93	2,96	0,32	3,28	10,92
2021	33,36	2 398	71 883	11,40	2,96	0,33	3,29	11,10
2020	25,78	2 282	88 474	8,83	2,96	0,32	3,28	10,88
2019	24,54	2 435	99 240	5,44	2,96	0,33	3,29	11,04
2018	20,21	2 335	115 554	15,85	2,96	0,33	3,29	10,99
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	37,73	48	1 267	114,93	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	45,44	86	1 886	11,40	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	34,04	20	595	8,83	0,15	0,02	0,17	13,00
2019	31,39	85	2 710	5,44	0,15	0,02	0,17	13,00
2018	25,06	70	2 775	15,85	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	790	1 062
Trésorerie	3	5
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	793	1 067
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	2	1
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	2	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	791	1 066
*Placements au coût	738	899
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	23,96	25,98

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	39	16
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	79
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	21	150
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(111)	(109)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	5	7
	(46)	143
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	24	36
Frais d'administration	3	5
Frais d'assurance	6	9
Taxe de vente harmonisée	3	5
	36	55
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(82)	88
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,25)	1,78
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	36 324	49 657

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 066	1 504
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(82)	88
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	16	141
Montant versé au rachat de parts	(209)	(667)
	(193)	(526)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	791	1 066

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(82)	88
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(21)	(150)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	111	109
Produit de la vente de placements	225	665
Achat de placements	(4)	(88)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(39)	(95)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	191	529
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	16	141
Montant versé au rachat de parts	(209)	(667)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(193)	(526)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(2)	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	5	2
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	3	5
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	23 388	Fonds Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup> (série O)	737 645	789 885	99,90
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>737 645</b>	<b>789 885</b>	<b>99,90</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				757	0,10
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>790 642</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	35 000 641	Oil & Natural Gas Corp. Ltd.	72 821 433	84 344 567
	120 000	Elevance Health Inc.	11 076 988	83 347 366
	220 800	Microsoft Corp.	61 998 774	71 697 355
	900 000	DB Insurance Co., Ltd.	55 322 414	63 199 822
	1 300 000	ITOCHU Corp.	23 530 554	55 222 322
	4 200 000	Simplo Technology Co., Ltd.	35 683 970	52 653 100
	260 000	Universal Health Services Inc., catégorie B	36 786 156	49 598 916
	1 900 000	Jumbo SA	17 198 217	44 006 358
	13 533 282	Redington India Ltd.	9 441 623	39 982 056
	330 660	Alphabet Inc. catégorie C	41 856 251	39 725 631
	450 000	TotalEnergies SE CAAE	31 292 105	37 825 344
	800 000	Fukuda Denshi Co.	26 315 288	37 692 157
	700 000	British American Tobacco PLC	30 135 199	37 493 218
	600 000	Altria Group Inc.	30 965 717	37 134 804
	150 000	Johnson & Johnson	34 208 245	35 877 615
	188 504	T-Mobile US Inc.	28 122 787	35 732 818
	550 000	ASR Nederland NV	19 727 968	35 354 228
	1 000 000	Imperial Brands PLC	38 404 617	33 729 682
	295 760	Amazon.com Inc.	48 654 369	33 638 559
	1 125 000	Seria Co., Ltd.	947 566	33 293 977
	7 750 000	Kingboard Holdings Ltd.	24 464 300	33 276 268
	200 000	Nestlé SA	31 151 685	31 279 955
	2 350 035	Britvic PLC	29 252 520	29 889 755
	146 492	NVIDIA Corp.	29 445 643	28 986 894
	22 000 854	Daqin Railway Co., Ltd., catégorie A	37 804 829	28 840 009

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Fidelity, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.fidelity.ca](http://www.fidelity.ca).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup>	3 782 649	790	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup>	4 476 464	1 062	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	41 043	61 523
Parts émises contre trésorerie	684	5 566
Parts rachetées	(8 726)	(26 046)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>33 001</b>	<b>41 043</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	23,96	791	33 001	5,04	3,22	0,40	3,62	12,36
2021	25,98	1 066	41 043	14,34	3,22	0,40	3,62	12,28
2020	24,44	1 504	61 523	9,85	3,22	0,40	3,62	12,36
2019	20,66	1 544	74 702	4,62	3,24	0,40	3,64	12,57
2018	19,96	1 757	88 008	6,88	3,23	0,41	3,64	12,61

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Étoile toile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	937	1 174
Trésorerie	4	4
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	941	1 178
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	2	1
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	2	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>939</b>	<b>1 177</b>
*Placements au coût	775	874
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	20,17	21,60

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	54	14
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	57
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	49	74
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(138)	128
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	6	7
	(29)	280
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	28	33
Frais d'administration	3	4
Frais d'assurance	7	9
Taxe de vente harmonisée	4	4
	42	50
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(71)</b>	<b>230</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,43)	3,90
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	49 773	59 092

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 177	1 195
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(71)	230
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	6	42
Montant versé au rachat de parts	(173)	(290)
	(167)	(248)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	939	1 177

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(71)	230
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(49)	(74)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	138	(128)
Produit de la vente de placements	205	319
Achat de placements	(3)	(30)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(54)	(71)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	167	246
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	6	42
Montant versé au rachat de parts	(173)	(290)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(167)	(248)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	4	6
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	4	4
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	15 956	Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> (série O)	775 462	936 658	99,76
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>775 462</b>	<b>936 658</b>	<b>99,76</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				2 221	0,24
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>938 879</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	2 655 000	Banque Royale du Canada	264 052 182	337 981 500
	2 885 000	Banque Toronto-Dominion	176 459 753	252 927 950
	2 440 000	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	203 737 054	246 318 000
	3 580 000	Rogers Communications Inc., catégorie B, sans droit de vote	218 687 513	226 864 600
	2 490 000	Canadian Natural Resources Ltd.	98 090 902	187 223 100
	1 085 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	125 152 677	174 511 400
	1 455 367	CGI Inc., catégorie A, sous-vote	118 878 413	169 855 883
	2 775 000	Alimentation Couche-Tard Inc.	77 423 798	165 112 500
	2 058 000	Dollarama Inc.	83 420 398	162 973 020
	724 000	Intact Corporation financière	67 072 948	141 114 840
	1 325 000	Nutrien Ltd.	100 592 850	130 976 250
	2 915 000	Suncor Énergie Inc.	94 727 683	125 199 250
	1 730 000	Agnico Eagle Mines Ltd. (Canada)	129 074 159	121 722 800
	2 500 000	Brookfield Asset Management Inc., catégorie A	100 970 970	106 450 000
	1 390 000	Metro inc.	25 438 595	104 208 300
	517 000	Franco-Nevada Corp. (Canada)	52 777 776	95 422 690
	43 500	Constellation Software Inc.	28 086 195	91 957 260
	670 000	Groupe TMX Limitée	40 506 519	90 798 400
	735 000	Banque de Montréal	95 482 301	90 155 100
	520 000	WSP Global Inc.	62 023 066	81 686 800
	450 000	George Weston Limitée	64 282 534	75 595 500
	1 400 000	Corporation TC Énergie	89 045 104	75 572 000
	2 300 000	Power Corporation of Canada, sous-vote	59 976 976	73 255 000
	1 150 000	Fortis Inc.	62 455 688	62 307 000
	875 000	Tourmaline Oil Corp.	22 688 142	59 780 000

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Fidelity, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.fidelity.ca](http://www.fidelity.ca).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup>	5 275 683	937	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup>	6 073 694	1 174	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	54 510	67 109
Parts émises contre trésorerie	268	2 177
Parts rachetées	(8 225)	(14 776)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>46 553</b>	<b>54 510</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	20,17	939	46 553	5,52	3,20	0,35	3,55	11,03
2021	21,60	1 177	54 510	8,59	3,20	0,36	3,56	11,31
2020	17,81	1 195	67 109	14,72	3,21	0,34	3,55	10,64
2019	16,41	1 196	72 859	5,68	3,20	0,35	3,55	11,07
2018	14,19	1 181	83 227	5,90	3,20	0,36	3,56	11,12

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 871	5 212
Trésorerie	6	2
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	-
	3 879	5 214
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 879</b>	<b>5 214</b>
*Placements au coût	4 402	3 706
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	29,81	32,60
Catégorie GPP	41,29	43,74

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	24	30
Distribution de gains en capital provenant des placements	309	17
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 432	198
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 037)	554
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(272)	799
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	85	104
Frais d'administration	11	14
Frais d'assurance	29	35
Taxe de vente harmonisée	15	18
	140	171
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(412)</b>	<b>628</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,83)	3,74
Catégorie GPP	(2,53)	5,31
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	142 299	161 486
Catégorie GPP	3 966	4 495

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	5 214	5 046
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(412)	628
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	163	882
Montant versé au rachat de parts	(1 086)	(1 342)
	(923)	(460)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 879	5 214

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(412)	628
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 432)	(198)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 037	(554)
Produit de la vente de placements	6 087	788
Achat de placements	(5 019)	(175)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(333)	(47)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	928	442
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	162	882
Montant versé au rachat de parts	(1 086)	(1 350)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(924)	(468)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4	(26)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	2	28
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	6	2
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	232 771	Fonds chefs de file mondiaux CI (série I)	4 401 540	3 871 291	99,81
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>4 401 540</b>	<b>3 871 291</b>	<b>99,81</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				7 431	0,19
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 878 722</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	4 366 765	Interpublic Group of Cos. Inc. (The)	136 594 692	196 948 700
	2 215 173	HeidelbergCement AG	223 660 202	171 063 328
	5 244 533	Makita Corp.	243 213 549	166 651 790
	2 369 893	Murata Manufacturing Co., Ltd.	209 755 243	161 077 459
	4 567 219	DBS Group Holdings Ltd.	96 861 471	156 608 760
	4 292 076	Bureau Veritas SA	125 806 529	153 096 079
	5 535 962	Weir Group PLC (The)	141 456 699	151 243 403
	2 131 819	Stericycle Inc.	165 231 841	144 006 633
	3 961 624	Essity AB, catégorie B	126 997 482	140 489 976
	904 994	Baidu Inc., CAAE	173 793 344	140 156 891
	424 033	Kuehne + Nagel International AG, actions nominatives	128 601 095	133 623 614
	1 887 666	Amadeus IT Group SA	154 763 012	132 830 999
	34 745 974	ConvaTec Group PLC	101 006 412	132 294 323
	23 729 633	DS Smith PLC	137 397 022	124 881 758
	8 269 004	BAE Systems PLC	80 751 812	115 865 455
	1 150 690	Paypal Holdings Inc.	122 069 254	110 963 200
	301 792	Zebra Technologies Corp., catégorie A	112 732 242	104 775 887
	1 016 264	DKSH Holding AG	91 942 511	104 468 400
	1 023 466	Nutrien Ltd.	88 141 882	101 169 614
	2 056 362	Ebara Corp.	93 993 834	100 136 870
	3 357 439	MISUMI Group Inc.	103 097 374	99 724 585
	632 724	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	49 963 866	89 543 151
	457 170	Schneider Electric SE	68 192 788	86 617 334
	7 749 545	Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	143 721 191	85 868 313
	933 298	PriceSmart Inc.	96 514 341	76 806 804

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds chefs de file mondiaux CI	3 577 796	3 871	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société chefs de file mondiaux CI Black Creek	1 145 445	5 212	0,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	153 735	172 814	4 634	1 102
Parts émises contre trésorerie	5 067	23 196	320	3 632
Parts rachetées	(34 164)	(42 275)	(1 006)	(100)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>124 638</b>	<b>153 735</b>	<b>3 948</b>	<b>4 634</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	83
2042	-
<b>Total</b>	<b>83</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	29,81	3 716	124 638	122,52	2,97	0,35	3,32	11,88
2021	32,60	5 011	153 735	4,19	2,97	0,36	3,33	12,00
2020	28,96	5 005	172 814	6,98	2,97	0,35	3,32	11,81
2019	25,67	5 388	209 894	8,41	2,97	0,35	3,32	11,78
2018	22,11	5 889	266 295	18,67	2,97	0,34	3,31	11,51
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	41,29	163	3 948	122,52	0,15	0,02	0,17	11,65
2021	43,74	203	4 634	4,19	0,15	0,02	0,17	11,86
2020	37,66	41	1 102	6,98	0,15	0,02	0,17	12,36
2019	32,36	36	1 112	8,41	0,15	0,02	0,17	11,79
2018	27,01	34	1 265	18,67	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	165	273
Trésorerie	1	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	166	274
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	166	274
*Placements au coût	138	193
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,89	20,52

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	8	5
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	2
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	24	9
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(53)	40
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(21)	56
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	4	5
Frais d'administration	1	1
Frais d'assurance	1	2
Taxe de vente harmonisée	1	1
	7	9
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(28)	47
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,62)	3,37
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	10 780	13 884

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	274	250
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(28)	47
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	3	6
Montant versé au rachat de parts	(83)	(29)
	(80)	(23)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	166	274

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(28)	47
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(24)	(9)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	53	(40)
Produit de la vente de placements	88	36
Achat de placements	(1)	(4)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(8)	(7)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	80	23
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	3	6
Montant versé au rachat de parts	(83)	(29)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(80)	(23)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	-
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	1	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	10 603	Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life (série I)	137 612	165 248	99,72
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>137 612</b>	<b>165 248</b>	<b>99,72</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				456	0,28
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>165 704</b>	<b>100,00</b>

## Les principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	11 587 655	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	121 867 559	144 182 879
	375 245	iShares Global Tech ETF	14 606 042	22 793 428
	166 925	iShares Global Healthcare ETF	11 693 984	19 197 856
	282 030	iShares S&P Global Consumer Discretionary Index ETF	9 137 547	11 224 794
	84 202	iShares Global Consumer Staples ETF	4 276 049	6 804 340
	70 511	iShares Global Comm Services ETF	5 827 610	5 203 080
	29 523	iShares S&P Global Industrials Index ETF (couvert en \$ CA)	864 027	1 157 892
	24 093	iShares Global Real Estate Index ETF	725 668	650 511
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		332 231
	270	iShares Global Utilities ETF	22 015	21 321

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life	221 675	165	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life	250 483	273	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	13 364	14 532
Parts émises contre trésorerie	132	356
Parts rachetées	(4 235)	(1 524)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>9 261</b>	<b>13 364</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	1
2042	-
<b>Total</b>	<b>1</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,89	166	9 261	4,54	3,13	0,24	3,37	8,28
2021	20,52	274	13 364	4,36	3,13	0,26	3,39	8,77
2020	17,18	250	14 532	5,24	3,14	0,26	3,40	8,87
2019	16,18	236	14 570	6,99	3,14	0,27	3,41	9,06
2018	13,50	216	16 019	4,41	3,14	0,27	3,41	9,26

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	225	292
Trésorerie	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	1
	225	293
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>225</b>	<b>293</b>
*Placements au coût	182	199
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	28,44	33,66

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	3	-
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	6
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	10	13
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(50)	29
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(37)	48
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	5	6
Frais d'administration	1	1
Frais d'assurance	1	2
Taxe de vente harmonisée	1	1
	8	10
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(45)</b>	<b>38</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(5,38)	4,14
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	8 364	9 051

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	293	260
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(45)	38
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	17	39
Montant versé au rachat de parts	(40)	(44)
	(23)	(5)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	225	293

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(45)	38
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(10)	(13)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	50	(29)
Produit de la vente de placements	46	50
Achat de placements	(16)	(35)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(3)	(6)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	22	5
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	18	38
Montant versé au rachat de parts	(40)	(44)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(22)	(6)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	-	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	-	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	7 147	Fonds croissance mondial MFS Sun Life (série I)	181 733	225 069	99,94
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>181 733</b>	<b>225 069</b>	<b>99,94</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				130	0,06
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>225 199</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	137 833	Microsoft Corp.	32 690 626	44 788 301
	359 763	Alphabet Inc.	38 734 739	43 008 942
	99 832	Visa Inc.	23 890 998	28 103 324
	261 673	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	22 384 695	26 446 336
	63 642	Accenture PLC	17 716 178	23 010 218
	371 900	Tencent Holdings Ltd.	27 554 915	21 367 286
	128 068	NIKE Inc.	17 528 393	20 304 373
	184 761	Church & Dwight Co Inc.	19 772 487	20 180 188
	113 146	Apple Inc.	13 294 876	19 919 325
	316 022	Boston Scientific Corp.	16 029 528	19 812 661
	72 907	ICON PLC	19 341 439	19 189 172
	183 916	Amphenol Corp.	12 812 135	18 973 977
	195 516	HDFC Bank Ltd.	14 419 322	18 122 908
	108 131	Electronic Arts Inc.	17 059 874	17 900 960
	17 618	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton S.E.	11 514 067	17 319 440
	37 311	Adobe Inc.	18 492 775	17 013 226
	41 788	Aon PLC	11 591 416	16 994 228
	21 278	Thermo Fisher Scientific Inc.	10 836 007	15 876 837
	171 863	Fortive Corp.	14 593 650	14 961 676
	95 100	Ross Stores Inc.	12 588 268	14 956 380
	40 886	Danaher Corp.	10 830 873	14 703 958
	96 900	KOSE Corp.	16 388 110	14 189 455
	233 731	Diageo PLC	12 089 005	13 793 048
	51 235	Equifax Inc.	12 390 410	13 492 723
	105 325	Aptiv PLC	13 703 238	13 290 676

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds croissance mondial MFS Sun Life	968 417	225	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds croissance mondial MFS Sun Life	958 599	292	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	8 692	8 796
Parts émises contre trésorerie	579	1 305
Parts rachetées	(1 352)	(1 409)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>7 919</b>	<b>8 692</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	3
2039	6
2040	-
2041	7
2042	5
<b>Total</b>	<b>21</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	28,44	225	7 919	8,01	3,17	0,37	3,54	11,88
2021	33,66	293	8 692	14,56	3,17	0,34	3,51	10,90
2020	29,54	260	8 796	50,00	3,17	0,32	3,49	10,16
2019	25,63	340	13 268	6,85	3,17	0,31	3,48	9,86
2018	20,36	248	12 182	12,64	3,17	0,22	3,39	7,15

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 447	4 113
Trésorerie	7	6
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 455	4 119
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	9	8
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	9	8
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 446</b>	<b>4 111</b>
*Placements au coût	3 045	3 349
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,17	18,49
Catégorie Revenu	17,72	19,02

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	101	86
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	113
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	80	71
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(362)	87
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(181)	357
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	76	87
Frais d'administration	12	14
Frais d'assurance	6	7
Taxe de vente harmonisée	11	12
	105	120
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(286)</b>	<b>237</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,42)	1,03
Catégorie Revenu	(1,35)	1,11
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	113 491	126 211
Catégorie Revenu	92 269	96 367

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	4 111	3 977
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(286)	237
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	164	289
Montant versé au rachat de parts	(543)	(392)
	(379)	(103)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 446	4 111

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(286)	237
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(80)	(71)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	362	(87)
Produit de la vente de placements	606	356
Achat de placements	(122)	(161)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(101)	(199)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	379	75
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	164	292
Montant versé au rachat de parts	(542)	(392)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(378)	(100)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	(25)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	6	31
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	7	6
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	179 004	Fonds mondial de rendement global MFS Sun Life (série I)	3 045 237	3 446 612	100,03
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 045 237</b>	<b>3 446 612</b>	<b>100,03</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(900)	(0,03)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 445 712</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	48 674	Johnson & Johnson	8 491 633	11 650 288
	7 575 000	Gilt du Royaume-Uni, 1,25 %, 22 juillet 2027	10 898 244	11 138 691
	72 575	Merck & Co., Inc.	7 141 868	10 910 392
	24 598	Roche Holding AG	8 573 531	10 467 011
	9 671 000	Bon/obligation du Trésor américain, 2,375 %, 15 novembre 2049	12 113 828	9 566 544
	10 067 000	Bon/obligation du Trésor américain, 1,125 %, 15 août 2040	10 541 217	8 543 345
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		7 216 630
	92 895	BNP Paribas S.A.	6 923 735	7 145 498
	17 399	Aon PLC	2 737 050	7 075 777
	7 181 070 000	Gouvernement coréen, bon du Trésor, 1,875 %, 10 juin 2029	7 617 204	6 860 417
	614 550 000	Gouvernement du Japon, obligation de trente ans, 1,7 %, 20 juin 2044	6 891 761	6 720 149
	5 407 000	Bon/obligation du Trésor américain, 2,75 %, 15 août 2032	6 483 326	6 696 660
	7 357 000	Gouvernement du Canada, bon du Trésor, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	6 559 476	6 589 241
	35 229	JPMorgan Chase & Co.	3 458 247	6 401 107
	247 575	UBS Group AG	4 763 695	6 231 072
	53 909	The Charles Schwab Corp.	3 164 306	6 081 681
	27 109	Texas Instruments Inc.	4 427 160	6 068 790
	63 758	Rio Tinto PLC	5 436 917	6 050 032
	17 867	Microsoft Corp.	5 401 790	5 805 813
	121 813	Comcast Corp.	5 507 668	5 771 853
	12 828	Cigna Corp.	2 763 245	5 759 155
	140 500	KDDI Corp.	4 680 934	5 742 534
	35 481	ConocoPhillips Co.	2 375 765	5 672 883
	11 926	The Goldman Sachs Group Inc.	3 410 644	5 548 758
	3 804 000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,7 %, 15 août 2032	4 910 679	5 126 867

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds mondial de rendement global MFS Sun Life	709 640	3 447	0,5

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds mondial de rendement global MFS Sun Life	781 897	4 113	0,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	124 006	125 609	95 614	99 537
Parts émises contre trésorerie	5 613	9 249	3 723	6 716
Parts rachetées	(21 953)	(10 852)	(9 229)	(10 639)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	107 666	124 006	90 108	95 614

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
		Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>									
2022	17,17	1 849	107 666	6,25	2,82	0,31	3,13	11,26	
2021	18,49	2 292	124 006	8,77	2,82	0,31	3,13	11,19	
2020	17,46	2 194	125 609	15,91	2,82	0,30	3,12	10,84	
2019	16,80	2 132	126 879	7,62	2,82	0,30	3,12	11,03	
2018	14,94	2 022	135 302	8,85	2,82	0,30	3,12	10,84	
<b>Catégorie Revenu</b>									
2022	17,72	1 597	90 108	6,25	2,52	0,30	2,82	12,16	
2021	19,02	1 819	95 614	8,77	2,52	0,30	2,82	12,03	
2020	17,91	1 783	99 537	15,91	2,52	0,29	2,81	11,77	
2019	17,19	1 855	107 966	7,62	2,52	0,29	2,81	11,92	
2018	15,23	1 805	118 514	8,85	2,52	0,29	2,81	11,98	

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	685	775
Trésorerie	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	685	775
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>685</b>	<b>775</b>
*Placements au coût	502	515
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	25,59	27,32

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	33	9
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	16
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	19	30
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(77)	73
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(25)	128
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	14	16
Frais d'administration	2	2
Frais d'assurance	4	5
Taxe de vente harmonisée	3	3
	23	26
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(48)</b>	<b>102</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,78)	3,56
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	27 020	28 734

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	775	705
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(48)	102
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	44	95
Montant versé au rachat de parts	(86)	(127)
	(42)	(32)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	685	775

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(48)	102
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(19)	(30)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	77	(73)
Produit de la vente de placements	65	105
Achat de placements	-	(48)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(33)	(25)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	42	31
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	44	95
Montant versé au rachat de parts	(86)	(127)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(42)	(32)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	-	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	-	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	20 954	Fonds valeur mondial MFS Sun Life (série I)	502 209	684 799	99,94
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>502 209</b>	<b>684 799</b>	<b>99,94</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				383	0,06
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>685 182</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	28 639	Aon PLC	5 102 761	11 646 829
	46 263	Johnson & Johnson	6 882 570	11 073 207
	57 649	JPMorgan Chase & Co	6 237 227	10 474 819
	409 784	UBS Group AG	8 646 978	10 313 617
	88 218	The Charles Schwab Corp.	5 669 244	9 952 212
	200 545	Comcast Corp.	9 396 344	9 502 403
	20 761	Cigna Corp.	4 669 806	9 320 691
	58 018	ConocoPhillips Co.	4 255 281	9 276 214
	19 512	The Goldman Sachs Group Inc.	5 971 415	9 078 263
	21 026	Roche Holding AG	7 736 608	8 947 043
	42 314	Schneider Electric S.E.	4 965 013	8 027 628
	26 097	Chubb Ltd.	4 546 577	7 800 493
	161 603	Bank of America Corp.	6 148 129	7 252 133
	88 199	BNP Paribas S.A.	6 790 581	6 784 281
	77 134	Johnson Controls International PLC	4 463 291	6 688 855
	1 507 370	NatWest Group PLC	5 151 707	6 481 185
	33 478	Hess Corp.	3 310 339	6 433 140
	18 856	Willis Towers Watson PLC	5 151 773	6 248 798
	66 376	Henkel AG & Co. KGaA	8 174 385	6 215 171
	84 341	Ingersoll Rand Inc.	4 455 565	5 971 054
	34 790	PPG Industries Inc.	4 830 519	5 927 259
	31 155	T-Mobile US Inc.	4 872 195	5 909 922
	100 977	Truist Financial Corp.	6 813 350	5 887 349
	26 634	Eaton Corp. PLC	3 177 080	5 664 006
	620 300	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	4 258 451	5 612 349

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur mondial MFS Sun Life	464 422	685	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur mondial MFS Sun Life	458 143	775	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	28 364	29 684
Parts émises contre trésorerie	1 750	3 671
Parts rachetées	(3 343)	(4 991)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	26 771	28 364

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	8
2039	9
2040	-
2041	9
2042	-
<b>Total</b>	<b>26</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	25,59	685	26 771	4,89	3,17	0,38	3,55	12,10
2021	27,32	775	28 364	9,74	3,17	0,38	3,55	12,20
2020	23,74	705	29 684	11,16	3,17	0,37	3,54	11,76
2019	22,87	838	36 643	5,49	3,17	0,37	3,54	11,89
2018	19,24	773	40 161	9,39	3,17	0,37	3,54	11,81

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	794	1 211
Trésorerie	4	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	798	1 212
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>798</b>	<b>1 212</b>
*Placements au coût	646	720
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	33,88	47,29

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	42	129
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(343)	108
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(301)	237
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	19	26
Frais d'administration	3	4
Frais d'assurance	6	8
Taxe de vente harmonisée	4	4
	32	42
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(333)</b>	<b>195</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(13,75)	6,98
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	24 216	28 003

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 212	1 121
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(333)	195
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	87	243
Montant versé au rachat de parts	(168)	(347)
	(81)	(104)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	798	1 212

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(333)	195
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(42)	(129)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	343	(108)
Produit de la vente de placements	150	381
Achat de placements	(34)	(264)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	84	75
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	87	243
Montant versé au rachat de parts	(168)	(347)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(81)	(104)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	3	(29)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	30
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	4	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	14 596	Fonds croissance américain MFS Sun Life (série I)	646 099	794 097	99,51
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>646 099</b>	<b>794 097</b>	<b>99,51</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 907	0,49
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>798 004</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	784 286	Microsoft Corp.	172 355 121	254 850 709
	1 276 964	Amazon.com Inc.	204 863 708	145 339 588
	1 210 470	Alphabet Inc.	138 269 246	144 709 250
	792 789	Apple Inc.	121 977 903	139 570 308
	242 025	Mastercard Inc.	86 664 819	114 032 429
	331 278	Visa Inc.	76 621 585	93 256 802
	88 001	Thermo Fisher Scientific Inc.	43 597 838	65 663 009
	180 395	Danaher Corp.	43 358 483	64 876 009
	89 211	UnitedHealth Group Inc.	61 623 550	64 086 674
	120 708	Intuit Inc.	52 468 687	63 658 615
	137 929	Adobe Inc.	64 409 010	62 893 441
	92 060	MSCI Inc.	42 258 418	58 024 132
	891 688	Boston Scientific Corp.	47 118 643	55 903 424
	372 250	Abbott Laboratories Inc.	50 216 788	55 376 241
	276 469	NVIDIA Corp.	51 786 934	54 744 631
	221 467	Vulcan Materials Co.	44 268 897	52 546 761
	117 697	Aon PLC	37 413 296	47 864 691
	196 677	Verisk Analytics Inc.	39 634 030	47 014 019
	143 307	The Sherwin-Williams Co.	38 834 783	46 083 561
	379 589	Alphabet Inc.	42 494 518	45 636 264
	116 235	Vertex Pharmaceuticals Inc.	36 367 813	45 481 001
	373 699	The Charles Schwab Corp.	34 325 729	42 158 420
	122 469	The Estee Lauder Cos., Inc.	38 138 546	41 171 475
	95 924	Air Products and Chemicals Inc.	38 479 823	40 065 488
	193 998	AMETEK Inc.	27 603 576	36 726 692

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds croissance américain MFS Sun Life	2 767 704	794	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds croissance américain MFS Sun Life	3 362 362	1 211	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	25 629	28 075
Parts émises contre trésorerie	2 420	5 809
Parts rachetées	(4 494)	(8 255)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	23 555	25 629

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	5
2039	20
2040	-
2041	42
2042	24
Total	91

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	33,88	798	23 555	3,80	3,16	0,36	3,52	11,66
2021	47,29	1 212	25 629	19,68	3,16	0,35	3,51	11,30
2020	39,92	1 121	28 075	34,45	3,16	0,35	3,51	11,13
2019	31,88	708	22 210	7,96	3,16	0,34	3,50	10,96
2018	25,11	523	20 826	16,66	3,16	0,33	3,49	10,66

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	568	701
Trésorerie	2	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	570	703
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>570</b>	<b>703</b>
*Placements au coût	372	443
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	28,27	29,02

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	11	8
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	50	114
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(62)	46
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1)	168
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	13	16
Frais d'administration	2	3
Frais d'assurance	4	4
Taxe de vente harmonisée	2	3
	21	26
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(22)</b>	<b>142</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(0,98)	5,03
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	22 894	28 159

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	703	837
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(22)	142
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	45	72
Montant versé au rachat de parts	(156)	(348)
	(111)	(276)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	570	703

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(22)	142
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(50)	(114)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	62	(46)
Produit de la vente de placements	155	357
Achat de placements	(22)	(83)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(11)	(8)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	112	248
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	45	72
Montant versé au rachat de parts	(156)	(348)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(111)	(276)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	(28)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	29
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	2	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	14 676	Fonds valeur américain MFS Sun Life (série I)	372 189	567 681	99,59
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>372 189</b>	<b>567 681</b>	<b>99,59</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				2 331	0,41
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>570 012</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	253 204	JPMorgan Chase & Co.	40 222 611	46 007 149
	157 762	Johnson & Johnson	30 854 917	37 760 873
	81 572	Cigna Corp.	22 451 731	36 621 908
	43 407	Northrop Grumman Corp.	19 384 342	32 089 879
	452 579	Pfizer Inc.	24 438 711	31 421 687
	103 494	Honeywell International Inc.	24 294 411	30 051 304
	71 754	Aon PLC	19 348 808	29 180 718
	126 498	Texas Instruments Inc.	23 976 101	28 318 631
	158 705	The Progressive Corp.	19 461 070	27 892 668
	123 840	Marsh & McLennan Cos., Inc.	19 706 668	27 767 222
	91 577	Chubb Ltd.	18 228 300	27 372 717
	557 133	Comcast Corp.	32 099 870	26 398 576
	163 586	ConocoPhillips Co.	14 896 529	26 154 964
	178 227	Duke Energy Corp.	21 617 773	24 871 074
	31 902	Thermo Fisher Scientific Inc.	16 339 197	23 804 063
	158 184	Merck & Co., Inc.	15 507 833	23 780 219
	86 069	Lowe's Cos., Inc.	20 032 120	23 235 353
	230 158	The Southern Co.	17 746 829	22 269 532
	191 188	Morgan Stanley	19 839 045	22 024 584
	64 901	General Dynamics Corp.	19 967 972	21 818 337
	59 866	Accenture PLC	18 182 884	21 644 978
	75 269	Union Pacific Corp.	19 268 914	21 118 317
	242 441	Nasdaq Inc.	13 574 132	20 153 321
	63 861	Pioneer Natural Resources Co.	15 808 794	19 762 359
	37 266	McKesson Corp.	8 922 281	18 941 265

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur américain MFS Sun Life	1 220 961	568	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur américain MFS Sun Life	1 370 193	701	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	24 204	34 539
Parts émises contre trésorerie	1 652	2 741
Parts rachetées	(5 693)	(13 076)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>20 163</b>	<b>24 204</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	9
2039	15
2040	-
2041	18
2042	-
<b>Total</b>	<b>42</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>	
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	28,27	570	20 163	5,24	3,16	0,39	3,55	12,60
2021	29,02	703	24 204	8,47	3,16	0,39	3,55	12,73
2020	24,24	837	34 539	12,39	3,16	0,40	3,56	12,75
2019	24,61	933	37 923	4,30	3,16	0,39	3,55	12,47
2018	20,66	800	38 704	10,35	3,16	0,39	3,55	12,53

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	11 666	9 196
Trésorerie	101	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	15	16
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	-
	11 783	9 212
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	1
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	13	13
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	13	14
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>11 770</b>	<b>9 198</b>
*Placements au coût	11 702	8 237
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,95	17,78
Catégorie Revenu	16,61	18,44
Catégorie GPP	10,11	-

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	297	146
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	634
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	87	181
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(995)	546
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(611)	1 507
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	185	186
Frais d'administration	23	24
Frais d'assurance	22	21
Taxe de vente harmonisée	25	26
	255	257
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(866)</b>	<b>1 250</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,48)	2,27
Catégorie Revenu	(1,85)	2,40
Catégorie GPP	0,08	-
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	405 614	386 008
Catégorie Revenu	144 807	155 854
Catégorie GPP	23 540	-

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	9 198	9 188
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(866)	1 250
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	411	336
Montant versé au rachat de parts	(1 649)	(1 576)
Acquisition des actifs de fonds clôturés	4 676	-
	3 438	(1 240)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	11 770	9 198

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(866)	1 250
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(87)	(181)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	995	(546)
Produit de la vente de placements	1 906	1 580
Achat de placements	(315)	(84)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(297)	(780)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 336	1 239
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	410	336
Montant versé au rachat de parts	(1 649)	(1 576)
Acquisition des actifs de fonds dissous	5	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 234)	(1 240)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	102	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	(1)	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	101	(1)
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	1 192 076	Fonds équilibré canadien CI (série I)	11 702 325	11 666 137	99,11
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>11 702 325</b>	<b>11 666 137</b>	<b>99,11</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				104 325	0,89
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>11 770 462</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	3 472 602	Société Financière Manuvie	78 168 084	83 863 338
	3 306 347	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	80 339 640	70 805 421
	71 705	Fairfax Financial Holdings Ltd.	41 189 959	57 512 429
	740 429	Canadian Natural Resources Ltd.	34 701 235	55 672 857
	62 962 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	59 240 544	54 625 655
	1 873 612	Cenovus Energy Inc.	30 095 915	49 219 787
	892 721	Enbridge Inc.	43 320 220	47 242 795
	61 740 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	54 613 143	46 943 221
	687 567	Bank of Nova Scotia (La)	51 268 112	45 613 195
	46 875 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	49 065 880	45 302 043
	359 952	Banque de Montréal	42 151 422	44 151 712
	805 384	Ressources Teck Limitée, catégorie B	23 954 803	41 211 499
	954 289	Suncor Énergie Inc.	34 223 944	40 986 713
	706 824	Wheaton Precious Metals Corp.	31 286 915	37 390 990
	343 822	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	25 153 115	34 708 831
	99 020	Microsoft Corp.	26 441 565	32 153 406
	33 520 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	30 465 238	30 021 933
	1 109 246	TELUS Corp.	32 048 502	28 984 598
	474 738	Alimentation Couche-Tard Inc.	17 953 740	28 246 911
	37 123	UnitedHealth Group Inc.	18 863 702	26 649 255
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		25 009 973
	515 128	US Foods Holding Corp.	23 392 728	23 728 382
	499 887	Brookfield Corp.	27 569 065	21 285 188
	23 061 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	21 163 088	21 141 277
	134 243	WSP Global Inc.	16 012 518	21 088 233

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 466 550	11 666	0,5

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 367 222	9 196	0,4

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	362 752	419 042	148 962	166 519
Parts émises contre trésorerie	18 988	10 349	2 154	9 138
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	279 580	-	-	-
Parts rachetées	(88 013)	(66 639)	(11 080)	(26 695)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>573 307</b>	<b>362 752</b>	<b>140 036</b>	<b>148 962</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	-	-
Parts émises contre trésorerie	6 619	-
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	23 079	-
Parts rachetées	(111)	-
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>29 587</b>	-

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,95	9 145	573 307	6,65	2,60	0,29	2,89	11,56
2021	17,78	6 451	362 752	9,43	2,60	0,31	2,91	11,82
2020	15,55	6 514	419 042	3,19	2,60	0,30	2,90	11,70
2019	14,60	7 246	496 320	5,31	2,60	0,30	2,90	11,48
2018	12,98	7 879	607 063	10,53	2,60	0,30	2,90	11,60
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	16,61	2 326	140 036	6,65	2,27	0,23	2,50	10,35
2021	18,44	2 747	148 962	9,43	2,27	0,23	2,50	10,34
2020	16,06	2 674	166 519	3,19	2,27	0,23	2,50	10,33
2019	15,02	2 726	181 491	5,31	2,27	0,24	2,51	10,40
2018	13,30	2 688	202 136	10,53	2,27	0,24	2,51	10,45
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	10,11	299	29 587	6,65	0,15	0,02	0,17	13,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	28 698	35 989
Trésorerie	35	164
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	50	54
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	28 783	36 207
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	41	40
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	41	40
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	28 742	36 167
*Placements au coût	27 803	30 411
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	16,45	18,22
Catégorie Revenu	17,07	18,84
Catégorie GPP	21,75	23,44

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	706	967
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 163	2 024
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	308	805
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 683)	2 366
Autres revenus		
Intérêts	2	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(2 504)	6 162
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	552	626
Frais d'administration	68	77
Frais d'assurance	68	78
Taxe de vente harmonisée	75	84
	763	865
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(3 267)	5 297
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,84)	2,45
Catégorie Revenu	(1,81)	2,58
Catégorie GPP	(1,71)	3,67
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	1 219 237	1 375 467
Catégorie Revenu	359 209	396 545
Catégorie GPP	219 825	245 047

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	36 167	34 876
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 267)	5 297
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1 769	3 504
Montant versé au rachat de parts	(5 927)	(7 510)
	(4 158)	(4 006)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	28 742	36 167

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 267)	5 297
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(308)	(805)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 683	(2 366)
Produit de la vente de placements	5 208	5 814
Achat de placements	(420)	(960)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 869)	(2 991)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	4 027	3 989
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1 770	3 504
Montant versé au rachat de parts	(5 926)	(7 523)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(4 156)	(4 019)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(129)	(30)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	164	194
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	35	164
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	2	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	3 280 702	Fonds de croissance et de revenu canadien CI (série I)	27 803 155	28 698 267	99,85
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>27 803 155</b>	<b>28 698 267</b>	<b>99,85</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				43 842	0,15
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>28 742 109</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	4 519 801	Société Financière Manuvie	95 205 771	109 153 194
	4 299 471	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	105 696 964	92 073 171
	93 276	Fairfax Financial Holdings Ltd.	51 127 402	74 813 881
	963 816	Canadian Natural Resources Ltd.	37 537 357	72 469 325
	2 434 043	Cenovus Energy Inc.	34 260 864	63 942 310
	1 176 541	Enbridge Inc.	55 057 808	62 262 550
	894 703	Bank of Nova Scotia (La)	61 966 263	59 354 597
	482 613	Banque de Montréal	53 654 501	59 197 311
	1 141 238	Ressources Teck Limitée, catégorie B	31 131 178	58 397 148
	1 239 739	Suncor Énergie Inc.	42 285 445	53 246 790
	68 198 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	65 933 569	51 853 478
	964 964	Wheaton Precious Metals Corp.	37 512 653	51 046 596
	447 001	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	28 350 851	45 124 751
	133 831	Microsoft Corp.	32 256 022	43 457 104
	46 676 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	43 706 295	40 495 967
	1 443 862	TELUS Corp.	40 188 915	37 728 114
	613 322	Alimentation Couche-Tard Inc.	15 394 911	36 492 659
	48 140	UnitedHealth Group Inc.	21 801 205	34 557 959
	669 670	US Foods Holding Corp.	30 377 069	30 847 063
	31 555 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,25 %, 15 juin 2026	31 499 463	28 932 799
	319 770	Advanced Micro Devices Inc.	12 098 258	28 043 375
	649 935	Brookfield Corp.	35 873 294	27 674 232
	174 483	WSP Global Inc.	18 379 160	27 409 534
	26 612 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 <sup>er</sup> février 2024	25 689 868	25 600 232
	27 287 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	24 800 192	24 439 394

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	3 379 593	28 698	0,8

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	3 972 110	35 989	0,9

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 303 945	1 471 510	376 678	413 857
Parts émises contre trésorerie	59 162	137 909	36 125	23 191
Parts rachetées	(239 735)	(305 474)	(65 942)	(60 370)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 123 372</b>	<b>1 303 945</b>	<b>346 861</b>	<b>376 678</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	226 668	248 189
Parts émises contre trésorerie	5 382	33 675
Parts rachetées	(32 743)	(55 196)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>199 307</b>	<b>226 668</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	16,45	18 484	1 123 372	7,21	2,60	0,28	2,88	10,80
2021	18,22	23 758	1 303 945	10,87	2,60	0,28	2,88	10,76
2020	15,79	23 237	1 471 510	4,72	2,60	0,28	2,88	10,59
2019	15,15	26 739	1 764 947	4,47	2,60	0,28	2,88	10,66
2018	13,31	26 940	2 024 755	11,25	2,60	0,28	2,88	10,68
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	17,07	5 922	346 861	7,21	2,27	0,25	2,52	11,10
2021	18,84	7 095	376 678	10,87	2,27	0,25	2,52	10,99
2020	16,27	6 732	413 857	4,72	2,27	0,25	2,52	10,94
2019	15,55	6 682	429 689	4,47	2,27	0,24	2,51	10,51
2018	13,61	6 903	507 320	11,25	2,27	0,25	2,52	10,93
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	21,75	4 336	199 307	7,21	0,15	0,02	0,17	10,84
2021	23,44	5 314	226 668	10,87	0,15	0,02	0,17	10,59
2020	19,77	4 907	248 189	4,72	0,15	0,02	0,17	10,44
2019	18,46	5 270	285 543	4,47	0,15	0,02	0,17	10,95
2018	15,78	5 592	354 435	11,25	0,15	0,02	0,17	10,77

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	42 083	51 807
Trésorerie	156	157
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	92	82
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	1
	42 332	52 047
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	3
Montant à payer pour le rachat de parts	83	71
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	83	74
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>42 249</b>	<b>51 973</b>
*Placements au coût	38 317	41 148
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	19,41	22,37
Catégorie Revenu	20,25	23,25
Catégorie GPP	25,78	28,91

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	816	859
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	1 827
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	647	1 347
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(6 893)	3 561
Autres revenus		
Intérêts	2	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(5 428)	7 594
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	706	791
Frais d'administration	92	103
Frais d'assurance	79	90
Taxe de vente harmonisée	97	110
	974	1 094
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(6 402)</b>	<b>6 500</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,05)	2,56
Catégorie Revenu	(2,96)	2,76
Catégorie GPP	(3,08)	4,02
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	1 190 353	1 296 473
Catégorie Revenu	496 567	511 540
Catégorie GPP	420 990	439 533

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	51 973	46 120
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(6 402)	6 500
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	4 358	10 082
Montant versé au rachat de parts	(7 680)	(10 729)
	(3 322)	(647)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	42 249	51 973

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(6 402)	6 500
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(647)	(1 347)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	6 893	(3 561)
Produit de la vente de placements	7 161	7 525
Achat de placements	(2 880)	(5 727)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(816)	(2 686)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	3 309	704
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	4 358	10 104
Montant versé au rachat de parts	(7 668)	(10 773)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(3 310)	(669)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	35
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	157	122
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	156	157
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	2	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	4 309 875	Fonds mondial de croissance et de revenu CI (série I)	38 316 761	42 083 347	99,61
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>38 316 761</b>	<b>42 083 347</b>	<b>99,61</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				166 090	0,39
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>42 249 437</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	289 674 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 novembre 2032	408 464 250	401 778 924
	289 952 000	Obligation du Trésor américain, 0,38 %, 31 octobre 2023	363 115 582	378 608 681
	228 292 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 novembre 2052	338 987 688	312 391 634
	202 430 000	Obligation du Trésor américain, 1,13 %, 31 octobre 2026	253 584 594	245 514 174
	546 618	Microsoft Corp.	129 449 268	177 495 764
	931 277	Apple Inc.	129 729 294	163 835 111
	4 139 605	Shell PLC	99 946 782	157 614 300
	574 356	Johnson & Johnson	125 349 245	137 376 823
	1 518 666	East West Bancorp Inc.	133 282 485	135 508 441
	2 890 355	Bank of America Corp.	123 545 697	129 616 467
	179 020	UnitedHealth Group Inc.	85 897 129	128 511 963
	8 127 183	AIA Group Ltd.	105 383 002	122 371 556
	161 939	Thermo Fisher Scientific Inc.	101 979 754	120 747 266
	1 338 271	Advanced Micro Devices Inc.	88 559 998	117 364 466
	2 494 272	US Foods Holding Corp.	117 140 936	114 893 851
	221 527	Eli Lilly and Co.	73 557 777	109 732 815
	883 234	Alphabet Inc., catégorie C	113 389 082	106 112 104
	1 741 401	Diageo PLC	96 964 543	104 044 388
	603 420	Safran SA	89 468 834	102 257 120
	565 519	Nike Inc., catégorie B	84 873 481	89 596 046
	116 080 254	Lloyds Banking Group PLC	87 931 371	86 285 308
	123 117	Humana Inc.	73 353 575	85 382 287
	3 169 682	Cenovus Energy Inc.	56 252 924	83 267 546
	174 679	Mastercard Inc., catégorie A	77 867 964	82 243 488
	245 148	Stryker Corp.	72 237 616	81 153 662

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	8 651 189	42 083	0,5

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	9 410 859	51 807	0,6

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 254 136	1 312 136	492 620	481 841
Parts émises contre trésorerie	70 801	266 496	92 086	106 201
Parts rachetées	(231 415)	(324 496)	(73 421)	(95 422)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 093 522</b>	<b>1 254 136</b>	<b>511 285</b>	<b>492 620</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	431 291	412 459
Parts émises contre trésorerie	41 120	87 746
Parts rachetées	(58 382)	(68 914)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>414 029</b>	<b>431 291</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	138
<b>Total</b>	<b>138</b>

---

---

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	19,41	21 220	1 093 522	8,18	2,62	0,31	2,93	11,66
2021	22,37	28 054	1 254 136	14,97	2,62	0,30	2,92	11,49
2020	19,80	25 979	1 312 136	17,99	2,62	0,30	2,92	11,60
2019	17,70	24 653	1 392 542	11,45	2,62	0,30	2,92	11,55
2018	15,91	22 245	1 398 126	12,06	2,62	0,30	2,92	11,42
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	20,25	10 353	511 285	8,18	2,29	0,22	2,51	9,54
2021	23,25	11 451	492 620	14,97	2,29	0,23	2,52	10,20
2020	20,49	9 874	481 841	17,99	2,29	0,23	2,52	10,25
2019	18,25	9 446	517 602	11,45	2,29	0,22	2,51	9,77
2018	16,33	8 187	501 207	12,06	2,29	0,22	2,51	9,71
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	25,78	10 676	414 029	8,18	0,15	0,02	0,17	11,32
2021	28,91	12 468	431 291	14,97	0,15	0,02	0,17	11,37
2020	24,89	10 267	412 459	17,99	0,15	0,02	0,17	11,57
2019	21,65	9 371	432 738	11,45	0,15	0,02	0,17	11,92
2018	18,93	10 657	562 902	12,06	0,15	0,02	0,17	12,19

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	9 917	12 299
Trésorerie	43	23
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	22	23
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	9 982	12 345
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	19	17
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	19	17
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>9 963</b>	<b>12 328</b>
*Placements au coût	10 125	10 431
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,34	20,06
Catégorie Revenu	19,01	20,72
Catégorie GPP	24,36	25,92

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	169	30
Distribution de gains en capital provenant des placements	562	130
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	634	369
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 076)	933
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(711)	1 462
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	189	231
Frais d'administration	25	31
Frais d'assurance	20	25
Taxe de vente harmonisée	26	32
	260	319
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(971)</b>	<b>1 143</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,81)	1,64
Catégorie Revenu	(1,73)	1,72
Catégorie GPP	(1,59)	2,70
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	324 312	382 062
Catégorie Revenu	163 273	181 654
Catégorie GPP	62 344	74 870

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	12 328	13 109
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(971)	1 143
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	783	1 320
Montant versé au rachat de parts	(2 177)	(3 244)
	(1 394)	(1 924)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	9 963	12 328

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(971)	1 143
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(634)	(369)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 076	(933)
Produit de la vente de placements	13 164	2 655
Achat de placements	(11 492)	(445)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(731)	(160)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 412	1 891
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	783	1 321
Montant versé au rachat de parts	(2 175)	(3 246)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 392)	(1 925)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	20	(34)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	23	57
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	43	23
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	1 015 635	Fonds mondial de croissance et de revenu CI (série I)	10 124 669	9 917 066	99,54
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>10 124 669</b>	<b>9 917 066</b>	<b>99,54</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				45 904	0,46
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>9 962 970</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	289 674 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 novembre 2032	408 464 250	401 778 924
	289 952 000	Obligation du Trésor américain, 0,38 %, 31 octobre 2023	363 115 582	378 608 681
	228 292 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 novembre 2052	338 987 688	312 391 634
	202 430 000	Obligation du Trésor américain, 1,13 %, 31 octobre 2026	253 584 594	245 514 174
	546 618	Microsoft Corp.	129 449 268	177 495 764
	931 277	Apple Inc.	129 729 294	163 835 111
	4 139 605	Shell PLC	99 946 782	157 614 300
	574 356	Johnson & Johnson	125 349 245	137 376 823
	1 518 666	East West Bancorp Inc.	133 282 485	135 508 441
	2 890 355	Bank of America Corp.	123 545 697	129 616 467
	179 020	UnitedHealth Group Inc.	85 897 129	128 511 963
	8 127 183	AIA Group Ltd.	105 383 002	122 371 556
	161 939	Thermo Fisher Scientific Inc.	101 979 754	120 747 266
	1 338 271	Advanced Micro Devices Inc.	88 559 998	117 364 466
	2 494 272	US Foods Holding Corp.	117 140 936	114 893 851
	221 527	Eli Lilly and Co.	73 557 777	109 732 815
	883 234	Alphabet Inc., catégorie C	113 389 082	106 112 104
	1 741 401	Diageo PLC	96 964 543	104 044 388
	603 420	Safran SA	89 468 834	102 257 120
	565 519	Nike Inc., catégorie B	84 873 481	89 596 046
	116 080 254	Lloyds Banking Group PLC	87 931 371	86 285 308
	123 117	Humana Inc.	73 353 575	85 382 287
	3 169 682	Cenovus Energy Inc.	56 252 924	83 267 546
	174 679	Mastercard Inc., catégorie A	77 867 964	82 243 488
	245 148	Stryker Corp.	72 237 616	81 153 662

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	8 651 189	9 917	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société équilibrée mondiale CI Black Creek	423 057	12 299	2,9

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	354 267	412 734	170 754	192 053
Parts émises contre trésorerie	11 702	39 945	28 108	20 708
Parts rachetées	(69 746)	(98 412)	(30 278)	(42 007)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>296 223</b>	<b>354 267</b>	<b>168 584</b>	<b>170 754</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	64 988	77 131
Parts émises contre trésorerie	894	4 090
Parts rachetées	(11 443)	(16 233)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>54 439</b>	<b>64 988</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	128
2041	213
2042	-
<b>Total</b>	<b>341</b>

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,34	5 432	296 223	113,41	2,62	0,30	2,92	11,32
2021	20,06	7 105	354 267	4,59	2,62	0,30	2,92	11,29
2020	18,53	7 649	412 734	3,60	2,62	0,29	2,91	11,19
2019	18,27	9 419	515 436	5,59	2,62	0,29	2,91	11,23
2018	16,47	9 855	598 356	11,24	2,62	0,30	2,92	11,26
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	19,01	3 205	168 584	113,41	2,29	0,25	2,54	10,97
2021	20,72	3 538	170 754	4,59	2,29	0,25	2,54	11,06
2020	19,07	3 663	192 053	3,60	2,29	0,26	2,55	11,23
2019	18,74	3 804	203 035	5,59	2,29	0,26	2,55	11,22
2018	16,83	3 818	226 928	11,24	2,29	0,25	2,54	10,97
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	24,36	1 326	54 439	113,41	0,15	0,02	0,17	13,02
2021	25,92	1 685	64 988	4,59	0,15	0,02	0,17	13,58
2020	23,30	1 797	77 131	3,60	0,15	0,02	0,17	13,19
2019	22,35	1 924	86 060	5,59	0,15	0,02	0,17	13,37
2018	19,60	2 070	105 601	11,24	0,15	0,02	0,17	13,53

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	990	1 393
Trésorerie	3	6
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	2	2
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	995	1 401
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	2	2
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	2	2
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>993</b>	<b>1 399</b>
*Placements au coût	941	1 187
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,18	16,91
Catégorie Revenu	15,66	17,40

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	26	22
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	96
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	34	29
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(157)	76
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(97)	223
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	22	27
Frais d'administration	4	4
Frais d'assurance	2	2
Taxe de vente harmonisée	3	4
	31	37
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(128)</b>	<b>186</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,85)	2,14
Catégorie Revenu	(1,75)	2,26
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	44 522	57 943
Catégorie Revenu	25 912	27 267

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 399	1 317
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(128)	186
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	28	21
Montant versé au rachat de parts	(306)	(125)
	(278)	(104)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	993	1 399

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(128)	186
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(34)	(29)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	157	(76)
Produit de la vente de placements	323	167
Achat de placements	(17)	(22)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(26)	(118)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	275	108
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	28	21
Montant versé au rachat de parts	(306)	(125)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(278)	(104)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	4
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	6	2
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	3	6
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	101 169	Fonds équilibré canadien CI (série I)	941 300	990 078	99,66
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>941 300</b>	<b>990 078</b>	<b>99,66</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 343	0,34
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>993 421</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	3 472 602	Société Financière Manuvie	78 168 084	83 863 338
	3 306 347	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	80 339 640	70 805 421
	71 705	Fairfax Financial Holdings Ltd.	41 189 959	57 512 429
	740 429	Canadian Natural Resources Ltd.	34 701 235	55 672 857
	62 962 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	59 240 544	54 625 655
	1 873 612	Cenovus Energy Inc.	30 095 915	49 219 787
	892 721	Enbridge Inc.	43 320 220	47 242 795
	61 740 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	54 613 143	46 943 221
	687 567	Bank of Nova Scotia (La)	51 268 112	45 613 195
	46 875 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	49 065 880	45 302 043
	359 952	Banque de Montréal	42 151 422	44 151 712
	805 384	Ressources Teck Limitée, catégorie B	23 954 803	41 211 499
	954 289	Suncor Énergie Inc.	34 223 944	40 986 713
	706 824	Wheaton Precious Metals Corp.	31 286 915	37 390 990
	343 822	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	25 153 115	34 708 831
	99 020	Microsoft Corp.	26 441 565	32 153 406
	33 520 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	30 465 238	30 021 933
	1 109 246	TELUS Corp.	32 048 502	28 984 598
	474 738	Alimentation Couche-Tard Inc.	17 953 740	28 246 911
	37 123	UnitedHealth Group Inc.	18 863 702	26 649 255
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		25 009 973
	515 128	US Foods Holding Corp.	23 392 728	23 728 382
	499 887	Brookfield Corp.	27 569 065	21 285 188
	23 061 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	21 163 088	21 141 277
	134 243	WSP Global Inc.	16 012 518	21 088 233

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 466 550	990	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 367 222	1 393	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	55 847	59 270	26 130	29 100
Parts émises contre trésorerie	1 421	1 369	338	-
Parts rachetées	(18 184)	(4 792)	(901)	(2 970)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>39 084</b>	<b>55 847</b>	<b>25 567</b>	<b>26 130</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,18	593	39 084	3,86	2,60	0,25	2,85	9,62
2021	16,91	944	55 847	10,22	2,60	0,25	2,85	9,69
2020	14,78	876	59 270	104,13	2,60	0,24	2,84	9,27
2019	13,61	829	60 941	3,44	2,78	0,24	3,02	9,41
2018	11,98	799	66 729	8,27	2,78	0,26	3,04	9,93
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	15,66	400	25 567	3,86	2,30	0,27	2,57	11,62
2021	17,40	455	26 130	10,22	2,30	0,27	2,57	11,79
2020	15,16	441	29 100	104,13	2,30	0,27	2,57	11,81
2019	13,93	431	30 933	3,44	2,48	0,27	2,75	11,67
2018	12,22	385	31 527	8,27	2,48	0,27	2,75	11,72

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 262	4 054
Trésorerie	15	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	48
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 277	4 102
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	39
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	4	4
Frais de gestion à payer	7	4
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	11	47
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 266</b>	<b>4 055</b>
*Placements au coût	3 387	3 725
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,79	17,28
Catégorie Revenu	16,34	17,82

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	209	71
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	568
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	17	95
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(454)	(75)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	19	22
	(209)	681
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	99	108
Frais d'administration	11	12
Frais d'assurance	10	11
Taxe de vente harmonisée	11	12
	131	143
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(340)</b>	<b>538</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,53)	2,23
Catégorie Revenu	(1,56)	2,34
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	181 001	193 813
Catégorie Revenu	40 898	45 051

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	4 055	3 348
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(340)	538
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	137	1 188
Montant versé au rachat de parts	(586)	(1 019)
	(449)	169
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 266	4 055

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(340)	538
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(17)	(95)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	454	75
Produit de la vente de placements	643	510
Achat de placements	(31)	(619)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(209)	(639)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	1
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	503	(229)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	137	1 188
Montant versé au rachat de parts	(586)	(1 019)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(449)	169
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	54	(60)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	(39)	21
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	15	(39)
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	118 760	Fonds Fidelity Répartition d'actifs canadiens (série O)	3 387 478	3 261 893	99,88
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 387 478</b>	<b>3 261 893</b>	<b>99,88</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 895	0,12
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 265 788</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	1 158 487	Banque Royale du Canada	92 980 760	147 475 395
	1 334 852	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	122 075 912	134 753 309
	1 493 132	Banque Toronto-Dominion	98 262 583	130 902 882
	2 522 631	iShares Comex Gold Trust ETF	94 684 285	118 147 070
	791 233	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	124 488 333	106 661 563
	1 567 655	Rogers Communications Inc., catégorie B, sans droit de vote	97 217 396	99 342 297
	1 237 957	Canadian Natural Resources Ltd.	51 022 005	93 082 009
	801 205	Dollarama Inc.	45 653 814	63 447 424
	379 627	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	56 514 752	61 059 207
	525 188	Nutrien Ltd.	41 892 665	51 914 846
	1 878 230	Cenovus Energy Inc.	23 036 406	49 341 113
	416 368	CGI Inc., catégorie A, sous-vote	42 757 189	48 594 309
	22 325	Constellation Software Inc.	27 689 084	47 194 157
	1 889 916	Société aurifère Barrick	42 593 944	43 864 951
	622 371	Agnico Eagle Mines Ltd. (Canada)	40 581 292	43 790 035
	349 372	Banque de Montréal	33 811 052	42 853 970
	228 926	Waste Connections Inc.	34 349 805	41 087 638
	206 786	Franco-Nevada Corp. (Canada)	35 335 092	38 166 575
	884 287	Brookfield Asset Inc., catégorie A	39 828 105	37 652 940
	542 348	La Banque de Nouvelle-Écosse	32 085 057	35 979 366
	694 234	Teck Resources Ltd., sous-vote, catégorie B	32 491 091	35 523 937
	285 822	Loblaw Companies Ltd.	30 264 757	34 218 610
	536 008	Financière Sun Life inc.	29 775 846	33 688 103
	775 617	Suncor Énergie Inc.	22 994 633	33 312 750
	376 256	Restaurant Brands International Inc.	31 183 207	32 948 738

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Fidelity, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.fidelity.ca](http://www.fidelity.ca).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Répartition d'actifs canadiens	3 683 945	3 262	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Répartition d'actifs canadiens	4 280 232	4 054	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	190 492	174 752	42 831	46 070
Parts émises contre trésorerie	8 358	73 147	57	1 459
Parts rachetées	(31 799)	(57 407)	(4 395)	(4 698)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>167 051</b>	<b>190 492</b>	<b>38 493</b>	<b>42 831</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,79	2 637	167 051	6,65	2,86	0,31	3,17	10,74
2021	17,28	3 292	190 492	14,30	2,86	0,30	3,16	10,52
2020	15,07	2 634	174 752	5,85	2,86	0,30	3,16	10,51
2019	14,10	2 847	201 936	7,04	2,85	0,29	3,14	10,33
2018	12,49	2 839	227 225	14,49	2,86	0,31	3,17	10,89
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	16,34	629	38 493	6,65	2,51	0,34	2,85	13,65
2021	17,82	763	42 831	14,30	2,51	0,34	2,85	13,56
2020	15,50	714	46 070	5,85	2,51	0,32	2,83	12,91
2019	14,45	765	52 917	7,04	2,50	0,30	2,80	11,98
2018	12,76	762	59 666	14,49	2,51	0,30	2,81	12,11

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 414	2 937
Trésorerie	4	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 418	2 937
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>1 418</b>	<b>2 937</b>
*Placements au coût	1 639	2 973
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	10,09	11,56
Catégorie GPP	12,58	14,09

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	53	80
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(129)	(12)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(189)	(123)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(265)	(55)
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	28	40
Frais d'administration	4	5
Frais d'assurance	2	3
Taxe de vente harmonisée	4	5
	38	53
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(303)</b>	<b>(108)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,57)	(0,48)
Catégorie GPP	(3,93)	(0,24)
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	157 421	191 866
Catégorie GPP	14 072	66 901

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	2 937	3 274
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(303)	(108)
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	82	533
Montant versé au rachat de parts	(1 298)	(762)
	(1 216)	(229)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 418	2 937

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(303)	(108)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	129	12
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	189	123
Produit de la vente de placements	1 311	732
Achat de placements	(53)	(458)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(53)	(80)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 220	221
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	82	533
Montant versé au rachat de parts	(1 298)	(765)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 216)	(232)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4	(11)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	-	11
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	4	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	153 672	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	1 639 235	1 414 209	99,73
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 639 235</b>	<b>1 414 209</b>	<b>99,73</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 830	0,27
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 418 039</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
	62 064 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	57 944 301	56 741 864
	76 853 000	Province de l'Ontario, 2,55 %, 2 décembre 2052	59 896 213	54 860 658
	55 976 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	51 993 423	50 134 478
	50 000 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	49 929 000	49 410 518
	50 133 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	47 957 245	47 695 909
	37 218 543	Gouvernement du Canada, 4,25 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2026	43 854 175	41 070 694
	40 229 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2024	39 822 039	39 316 645
	45 426 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2031	39 202 951	39 113 053
	34 619 000	Province de l'Ontario, 4,6 %, 2 juin 2039	36 101 993	35 680 227
	48 257 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	35 044 634	34 008 731
	40 581 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 <sup>er</sup> juin 2050	41 905 734	32 892 036
	35 920 000	Province de l'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	31 441 516	31 554 161
	32 715 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 décembre 2053	31 881 704	30 022 381
	19 419 800	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 30 septembre 2024	25 964 147	26 173 208
	36 654 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 5 septembre 2052	33 683 342	22 612 224
	8 618 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 31 octobre 2082	11 831 304	12 164 695
	22 621 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	21 813 970	21 699 523
	22 897 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2025	21 969 497	21 644 085
	18 776 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1 <sup>er</sup> juin 2041	20 600 646	20 387 843
	32 618 000	Province de l'Ontario, 1,9 %, 2 décembre 2051	24 009 934	19 899 907

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	1 414	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 744 012	2 937	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	178 441	196 153	62 146	63 831
Parts émises contre trésorerie	7 867	18 258	-	23 414
Parts rachetées	(45 917)	(35 970)	(62 075)	(25 099)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	140 391	178 441	71	62 146

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	10,09	1 417	140 391	5,77	2,07	0,24	2,31	11,50
2021	11,56	2 062	178 441	17,12	2,07	0,24	2,31	11,40
2020	12,02	2 358	196 153	22,26	2,07	0,25	2,32	12,07
2019	11,12	3 864	347 609	11,08	2,07	0,24	2,31	11,78
2018	10,60	2 485	234 334	3,76	2,07	0,23	2,30	11,13
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	12,58	1	71	5,77	0,15	0,01	0,16	8,19
2021	14,09	875	62 146	17,12	0,15	0,01	0,16	7,86
2020	14,35	916	63 831	22,26	0,15	0,01	0,16	6,78
2019	12,98	693	53 422	11,08	0,15	0,01	0,16	6,79
2018	12,12	654	54 018	3,76	0,15	0,01	0,16	6,98

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	21 200	14 672
Trésorerie	81	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	39	22
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	21 320	14 694
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	1
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	38	17
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	38	18
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>21 282</b>	<b>14 676</b>
*Placements au coût	21 362	12 781
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	12,98	14,51
Catégorie Revenu	13,44	14,96
Catégorie GPP	16,72	18,19

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	370	497
Distribution de gains en capital provenant des placements	190	16
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	452	177
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 053)	1 708
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 040)	2 398
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	275	265
Frais d'administration	34	33
Frais d'assurance	30	30
Taxe de vente harmonisée	36	36
	375	364
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 415)</b>	<b>2 034</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,34)	1,74
Catégorie Revenu	(1,06)	1,86
Catégorie GPP	(1,23)	2,62
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	713 707	721 674
Catégorie Revenu	282 414	225 923
Catégorie GPP	127 972	136 631

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	14 676	15 926
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 415)	2 034
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	2 073	1 032
Montant versé au rachat de parts	(4 298)	(4 316)
Acquisition des actifs de fonds clôturés	10 246	-
	8 021	(3 284)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	21 282	14 676

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 415)	2 034
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(452)	(177)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 053	(1 708)
Produit de la vente de placements	14 509	3 957
Achat de placements	(11 836)	(311)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(560)	(513)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	2 299	3 282
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	2 073	1 032
Montant versé au rachat de parts	(4 290)	(4 317)
Acquisition des actifs de fonds dissous	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(2 217)	(3 285)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	82	(3)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	(1)	2
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	81	(1)
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>			
	695 984	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	6 509 360	6 404 999	
	458 914	Fonds de rendement diversifié CI (série I)	3 915 303	4 255 964	
	281 249	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	6 662 253	6 323 866	
	99 578	Fonds d'actions mondiales Sélect CI (série I)	4 274 896	4 215 393	
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>21 361 812</b>	<b>21 200 222</b>	<b>99,62</b>
		<b>Autres actifs (passifs) nets</b>		<b>81 827</b>	<b>0,38</b>
		<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>		<b>21 282 049</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
		<b>Fonds d'actions mondiales Sélect CI</b>		
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		24 234 166
	51 200	Microsoft Corp.	12 246 152	16 625 474
	86 803	Apple Inc.	12 336 500	15 270 837
	392 768	Shell PLC	10 956 295	14 954 531
	53 606	Johnson & Johnson	11 883 370	12 821 703
		<b>Fonds d'actions canadiennes sélect CI</b>		
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	120 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
		<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>		
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
		<b>Fonds de rendement diversifié CI</b>		
	2 331 107	Mandat privé d'infrastructures mondiales CI (série FNB en \$ CA)	56 840 694	54 536 248
	266 263	Cheniere Energy Inc.	18 805 554	54 063 595
	2 332 168	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	49 981 949	49 943 378
	930 262	American Homes 4 Rent, catégorie A	26 699 254	37 963 583
	2 418 145	Fonds d'immobilier mondial CI (série I)	43 312 136	37 863 556

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	504 863	4 215	0,8
Fonds de rendement diversifié CI	1 505 060	4 256	0,3
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	6 405	0,2
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	6 324	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds de rendement diversifié CI	1 795 123	14 672	0,8

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	653 014	824 757	206 766	243 093
Parts émises contre trésorerie	90 707	51 448	37 209	11 160
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	404 491	-	287 541	-
Parts rachetées	(199 275)	(223 191)	(53 602)	(47 487)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>948 937</b>	<b>653 014</b>	<b>477 914</b>	<b>206 766</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	115 858	142 023
Parts émises contre trésorerie	18 676	11 806
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	69 270	-
Parts rachetées	(51 439)	(37 971)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>152 365</b>	<b>115 858</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	12,98	12 314	948 937	79,39	2,58	0,29	2,87	11,32
2021	14,51	9 475	653 014	5,42	2,58	0,30	2,88	11,58
2020	12,76	10 527	824 757	6,34	2,58	0,29	2,87	11,42
2019	13,02	12 802	983 320	9,50	2,58	0,29	2,87	11,25
2018	11,35	12 606	1 110 919	7,26	2,58	0,29	2,87	11,23
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	13,44	6 421	477 914	79,39	2,27	0,21	2,48	9,47
2021	14,96	3 094	206 766	5,42	2,27	0,22	2,49	9,55
2020	13,11	3 187	243 093	6,34	2,27	0,23	2,50	9,93
2019	13,32	3 385	254 124	9,50	2,27	0,24	2,51	10,49
2018	11,57	2 995	258 909	7,26	2,27	0,23	2,50	10,10
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	16,72	2 547	152 365	79,39	0,15	0,02	0,17	10,26
2021	18,19	2 107	115 858	5,42	0,15	0,02	0,17	10,13
2020	15,57	2 212	142 023	6,34	0,15	0,02	0,17	10,91
2019	15,46	3 024	195 684	9,50	0,15	0,02	0,17	10,70
2018	13,11	2 585	197 163	7,26	0,15	0,02	0,17	11,28

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	9 206	8 369
Trésorerie	41	26
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	10	22
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	9 257	8 417
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	5
Montant à payer pour le rachat de parts	10	21
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	10	26
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>9 247</b>	<b>8 391</b>
*Placements au coût	9 206	8 369
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	9,87	9,80
Catégorie Revenu	9,99	9,92
Catégorie GPP	11,39	11,16

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	192	37
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	-	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	-	-
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	193	37
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	72	89
Frais d'administration	11	13
Frais d'assurance	4	5
Taxe de vente harmonisée	9	11
	96	118
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>97</b>	<b>(81)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	0,06	(0,10)
Catégorie Revenu	0,07	(0,09)
Catégorie GPP	0,27	0,04
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	416 517	546 114
Catégorie Revenu	317 700	348 815
Catégorie GPP	173 012	67 141

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	8 391	10 668
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	97	(81)
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	21 595	16 970
Montant versé au rachat de parts	(20 836)	(19 166)
	759	(2 196)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	9 247	8 391

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	97	(81)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	-	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	-	-
Produit de la vente de placements	17 444	16 868
Achat de placements	(18 082)	(14 552)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(192)	(37)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(733)	2 198
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	21 595	16 970
Montant versé au rachat de parts	(20 847)	(19 186)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	748	(2 216)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	15	(18)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	26	44
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	41	26
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	920 583	Fonds marché monétaire CI (série I)	9 205 833	9 205 833	99,55
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>9 205 833</b>	<b>9 205 833</b>	<b>99,55</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				41 574	0,45
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>9 247 407</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		105 812 843
	60 100 000	Enbridge Gas Inc., 3,57 %, 9 janvier 2023	60 042 421	60 042 421
	43 354 000	Fortified Trust, série A, 2,34 %, 23 janvier 2023	43 306 043	43 306 043
	39 000 000	Toronto Hydro Corp., 3,054 %, 6 janvier 2023	38 977 157	38 977 157
	31 164 000	Banque Royale du Canada, 3,57 %, 12 janvier 2023	31 124 378	31 124 378
	30 545 000	Province de l'Ontario, 3,702 %, 25 janvier 2023	30 464 446	30 464 446
	30 542 000	Banque Royale du Canada, 2,95 %, 1 <sup>er</sup> mai 2023	30 387 657	30 387 657
	30 000 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,293 %, 24 février 2023	29 802 398	29 802 398
	27 125 000	Banque HSBC Canada, 5,405 %, 29 juin 2023	27 128 726	27 128 726
	24 075 888	Province de l'Ontario, 4,182 %, 8 mars 2023	23 888 307	23 888 307
	24 075 888	Province de l'Alberta, 4,199 %, 15 mars 2023	23 868 143	23 868 143
	23 508 000	Banque de Montréal, taux flottant, 1 <sup>er</sup> février 2023	23 512 808	23 512 808
	22 206 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 4,655 %, 6 avril 2023	22 206 000	22 206 000
	21 381 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux flottant, 31 janvier 2025	21 336 276	21 336 276
	20 394 000	Province de l'Alberta, 2,834 %, 5 janvier 2023	20 384 823	20 384 823
	20 227 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,7 %, 25 janvier 2023	20 204 090	20 204 090
	19 547 000	Province de Québec, 3,933 %, 17 février 2023	19 443 780	19 443 780
	19 335 000	Banque Toronto Dominion (La), 4,655 %, 6 avril 2023	19 332 926	19 332 926
	19 383 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 4,518 %, 27 février 2023	19 241 436	19 241 436
	19 087 000	Banque HSBC Canada, 2,54 %, 31 janvier 2023	19 087 782	19 087 782
	19 126 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 4,037 %, 30 janvier 2023	19 060 426	19 060 426
	18 529 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 1,529 %, 8 mars 2023	18 476 220	18 476 220
	18 129 000	Banque de Montréal, 2,89 % 20 juin 2023	18 058 745	18 058 745
	16 158 000	Banque de Montréal, 4,825 %, 25 avril 2023	16 157 097	16 157 097
	15 403 000	Banque Manuvie du Canada, 2,84 %, 12 janvier 2023	15 408 695	15 408 695

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds marché monétaire CI	814 483	9 206	1,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds marché monétaire CI	675 126	8 369	1,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	443 347	598 632	334 789	347 555
Parts émises contre trésorerie	1 229 201	944 778	120 839	177 680
Parts rachetées	(1 290 688)	(1 100 063)	(154 551)	(190 446)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>381 860</b>	<b>443 347</b>	<b>301 077</b>	<b>334 789</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	65 024	113 864
Parts émises contre trésorerie	745 755	529 094
Parts rachetées	(593 647)	(577 934)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>217 132</b>	<b>65 024</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	9,87	3 767	381 860	190,89	1,25	0,13	1,38	10,52
2021	9,80	4 346	443 347	152,56	1,24	0,14	1,38	11,21
2020	9,90	5 927	598 632	207,79	1,24	0,14	1,38	11,45
2019	9,94	5 000	503 114	151,97	1,25	0,13	1,38	10,34
2018	9,87	4 867	492 935	255,06	1,25	0,13	1,38	10,46
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	9,99	3 008	301 077	190,89	1,15	0,11	1,26	9,64
2021	9,92	3 319	334 789	152,56	1,14	0,11	1,25	9,66
2020	10,00	3 476	347 555	207,79	1,14	0,11	1,25	9,51
2019	10,03	3 473	346 444	151,97	1,15	0,10	1,25	8,48
2018	9,95	3 543	356 166	255,06	1,15	0,10	1,25	8,84
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	11,39	2 472	217 132	190,89	0,01	-	0,01	-
2021	11,16	726	65 024	152,56	-	-	-	-
2020	11,11	1 265	113 864	207,79	-	-	-	-
2019	11,00	2 584	235 004	151,97	0,01	-	0,01	-
2018	10,78	1 037	96 187	255,06	0,01	-	0,01	11,41

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	279	331
Trésorerie	-	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	279	332
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>279</b>	<b>332</b>
*Placements au coût	305	333
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	9,14	10,50

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	8	9
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(20)	1
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(24)	(19)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(36)	(9)
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	5	6
Frais d'administration	1	1
Frais d'assurance	-	-
Taxe de vente harmonisée	1	1
	7	8
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(43)</b>	<b>(17)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,38)	(0,52)
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	30 999	33 366

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	332	410
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(43)	(17)
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	2	1
Montant versé au rachat de parts	(12)	(62)
	(10)	(61)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	279	332

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(43)	(17)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	20	(1)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	24	19
Produit de la vente de placements	330	74
Achat de placements	(314)	(4)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(8)	(9)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	9	62
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	2	1
Montant versé au rachat de parts	(12)	(62)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(10)	(61)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	-	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	30 292	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	305 412	278 776	99,92
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>305 412</b>	<b>278 776</b>	<b>99,92</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				215	0,08
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>278 991</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
	62 064 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	57 944 301	56 741 864
	76 853 000	Province de l'Ontario, 2,55 %, 2 décembre 2052	59 896 213	54 860 658
	55 976 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	51 993 423	50 134 478
	50 000 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	49 929 000	49 410 518
	50 133 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	47 957 245	47 695 909
	37 218 543	Gouvernement du Canada, 4,25 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2026	43 854 175	41 070 694
	40 229 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2024	39 822 039	39 316 645
	45 426 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2031	39 202 951	39 113 053
	34 619 000	Province de l'Ontario, 4,6 %, 2 juin 2039	36 101 993	35 680 227
	48 257 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	35 044 634	34 008 731
	40 581 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 <sup>er</sup> juin 2050	41 905 734	32 892 036
	35 920 000	Province de l'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	31 441 516	31 554 161
	32 715 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 décembre 2053	31 881 704	30 022 381
	19 419 800	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 30 septembre 2024	25 964 147	26 173 208
	36 654 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 5 septembre 2052	33 683 342	22 612 224
	8 618 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 31 octobre 2082	11 831 304	12 164 695
	22 621 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	21 813 970	21 699 523
	22 897 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2025	21 969 497	21 644 085
	18 776 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1 <sup>er</sup> juin 2041	20 600 646	20 387 843
	32 618 000	Province de l'Ontario, 1,9 %, 2 décembre 2051	24 009 934	19 899 907

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	279	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	331	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	31 618	37 304
Parts émises contre trésorerie	258	137
Parts rachetées	(1 340)	(5 823)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	30 536	31 618

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	9,14	279	30 536	110,15	2,12	0,26	2,38	12,40
2021	10,50	332	31 618	3,68	2,16	0,27	2,43	12,64
2020	11,00	410	37 304	23,46	2,16	0,23	2,39	10,89
2019	10,28	333	32 419	3,02	2,16	0,23	2,39	10,91
2018	9,89	351	35 514	3,44	2,16	0,24	2,40	11,35

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	24 255	35 722
Trésorerie	121	139
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	38	45
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	24 414	35 906
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	32	33
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	32	33
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>24 382</b>	<b>35 873</b>
*Placements au coût	24 830	31 564
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	11,22	12,61
Catégorie Revenu	11,41	12,80
Catégorie GPP	14,51	15,90

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	535	126
Distribution de gains en capital provenant des placements	841	168
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	498	712
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 733)	919
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(2 858)	1 925
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	374	493
Frais d'administration	39	52
Frais d'assurance	18	25
Taxe de vente harmonisée	50	66
	481	636
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(3 339)</b>	<b>1 289</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,49)	0,27
Catégorie Revenu	(1,42)	0,35
Catégorie GPP	(1,59)	0,79
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	987 947	1 271 543
Catégorie Revenu	539 221	609 576
Catégorie GPP	697 151	935 085

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	35 873	42 459
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 339)	1 289
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1 879	1 430
Montant versé au rachat de parts	(10 031)	(9 305)
	(8 152)	(7 875)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	24 382	35 873

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 339)	1 289
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(498)	(712)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 733	(919)
Produit de la vente de placements	37 549	9 026
Achat de placements	(28 934)	(475)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 376)	(294)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	8 135	7 915
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1 879	1 430
Montant versé au rachat de parts	(10 032)	(9 315)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(8 153)	(7 885)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(18)	30
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	139	109
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	121	139
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	1 181 685	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	11 144 764	10 874 808	
	1 411 180	Série Portefeuilles de revenu CI (série I)	13 685 468	13 380 526	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>24 830 232</b>	<b>24 255 334</b>	<b>99,48</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				126 583	0,52
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>24 381 917</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Série Portefeuilles de revenu CI</b>				
	24 285 718	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	252 484 078	223 496 609
	27 028 497	Fonds de revenu CI (série I)	221 973 491	193 799 732
	15 500 233	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	155 636 453	141 467 528
	18 245 181	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	162 204 986	140 973 216
	8 583 694	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	82 451 434	81 716 767

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles de revenu CI	1 799 045	13 381	0,7
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	10 874	0,3

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société gestion du revenu Sélect CI	2 760 812	35 722	1,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 135 572	1 532 581	570 830	634 470
Parts émises contre trésorerie	81 008	66 542	45 174	23 109
Parts rachetées	(349 331)	(463 551)	(89 826)	(86 749)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>867 249</b>	<b>1 135 572</b>	<b>526 178</b>	<b>570 830</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	895 733	1 042 076
Parts émises contre trésorerie	27 732	21 321
Parts rachetées	(327 501)	(167 664)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>595 964</b>	<b>895 733</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	39
2039	515
2040	-
2041	378
2042	-
<b>Total</b>	<b>932</b>

---

---

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	11,22	9 732	867 249	108,29	2,40	0,28	2,68	11,66
2021	12,61	14 321	1 135 572	1,99	2,40	0,28	2,68	11,54
2020	12,28	18 826	1 532 581	14,64	2,40	0,27	2,67	11,39
2019	11,87	19 487	1 642 169	4,29	2,40	0,27	2,67	11,42
2018	11,18	20 253	1 812 339	2,49	2,40	0,27	2,67	11,33
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	11,41	6 003	526 178	108,29	2,24	0,27	2,51	11,91
2021	12,80	7 307	570 830	1,99	2,24	0,26	2,50	11,69
2020	12,44	7 895	634 470	14,64	2,24	0,27	2,51	11,87
2019	12,00	8 795	732 871	4,29	2,24	0,27	2,51	12,21
2018	11,28	9 581	849 096	2,49	2,24	0,27	2,51	12,14
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	14,51	8 647	595 964	108,29	0,15	0,02	0,17	10,51
2021	15,90	14 245	895 733	1,99	0,15	0,01	0,16	9,97
2020	15,10	15 738	1 042 076	14,64	0,15	0,02	0,17	10,02
2019	14,23	16 597	1 166 717	4,29	0,15	0,02	0,17	10,12
2018	13,06	18 190	1 392 503	2,49	0,15	0,02	0,17	10,02

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	342	602
Trésorerie	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	5	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	347	602
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	3	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	3	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>344</b>	<b>602</b>
*Placements au coût	402	601
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	9,97	11,63

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	14	18
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(12)	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(61)	(27)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(59)	(9)
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	7	11
Frais d'administration	1	2
Frais d'assurance	1	1
Taxe de vente harmonisée	1	1
	10	15
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(69)</b>	<b>(24)</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,80)	(0,46)
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	38 318	51 547

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	602	619
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(69)	(24)
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1	86
Montant versé au rachat de parts	(190)	(79)
	(189)	7
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	344	602

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(69)	(24)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	12	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	61	27
Produit de la vente de placements	196	88
Achat de placements	-	(80)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(14)	(18)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	186	(7)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1	86
Montant versé au rachat de parts	(190)	(80)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(189)	6
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	-	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	(3)	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	29 191	Fonds d'obligations canadiennes MFS Sun Life (série I)	401 514	342 329	99,55
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>401 514</b>	<b>342 329</b>	<b>99,55</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				1 558	0,45
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>343 887</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	9 420 000	Obligation du gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	8 440 772	8 436 951
	7 035 000	Obligation du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2027	6 782 795	6 835 230
	4 650 000	Province de l'Alberta, 3,45 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2043	4 853 077	4 080 541
	3 975 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2028	4 000 651	3 755 845
	3 430 000	Province de Québec, 5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2038	4 775 482	3 702 019
	4 715 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 2 décembre 2050	5 235 962	3 471 677
	3 110 000	Obligation du gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> avril 2025	2 991 105	2 949 162
	2 965 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	3 154 315	2 930 044
	3 135 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 décembre 2053	3 086 524	2 876 973
	2 910 000	Banque Nationale du Canada, 2,983 %, 4 mars 2024	2 990 611	2 835 195
	3 275 000	Hydro One Inc., 3,63 %, 25 juin 2049	2 751 885	2 677 556
	2 660 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	2 681 213	2 530 691
	3 205 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2049	3 682 988	2 497 483
	2 610 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 20 septembre 2029	2 665 896	2 453 444
	2 510 000	Province du Manitoba, 4,1 %, 5 mars 2041	2 972 502	2 399 441
	2 910 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 juin 2050	3 459 757	2 298 905
	2 019 000	Banque Royale du Canada, OTV, 24 novembre 2080	2 100 529	1 864 258
	2 010 000	Ontario Power Generation Inc., 3,215 %, 8 avril 2030	2 159 644	1 822 241
	2 540 000	Obligation du gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	1 904 304	1 790 045
	1 990 000	Société Financière Manuvie, OTV, 13 mai 2035	1 990 000	1 677 022
	1 915 000	CU Inc., 3,964 %, 27 juillet 2045	2 044 631	1 651 805
	1 735 000	Cenovus Energy Inc., 3,5 %, 7 février 2028	1 741 026	1 639 917
	1 775 000	Banque Royale du Canada, 2,328 %, 28 janvier 2027	1 679 224	1 603 289
	2 020 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,8 %, 18 juin 2048	2 011 035	1 556 484
	1 610 000	TELUS Corp., 2,35 %, 27 janvier 2027	1 642 989	1 424 934

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes MFS Sun Life	140 181	342	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes MFS Sun Life	156 282	602	0,4

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	51 762	51 142
Parts émises contre trésorerie	116	7 461
Parts rachetées	(17 399)	(6 841)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>34 479</b>	<b>51 762</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	9,97	344	34 479	3,45	2,15	0,24	2,39	11,12
2021	11,63	602	51 762	14,64	2,15	0,24	2,39	11,23
2020	12,11	619	51 142	12,68	2,15	0,24	2,39	11,11
2019	11,30	588	52 025	5,88	2,15	0,24	2,39	11,10
2018	10,69	641	59 988	4,67	2,15	0,22	2,37	10,16

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 028	1 412
Trésorerie	2	2
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	3	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 033	1 414
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	1	1
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	1	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 032	1 413
*Placements au coût	1 210	1 419
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	9,47	11,05

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	35	42
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	3
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(27)	1
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(175)	(92)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	4	5
	(163)	(41)
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	25	34
Frais d'administration	3	4
Frais d'assurance	2	2
Taxe de vente harmonisée	3	4
	33	44
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(196)	(85)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,66)	(0,60)
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	117 667	142 384

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 413	1 833
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(196)	(85)
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	17	266
Montant versé au rachat de parts	(202)	(601)
	(185)	(335)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 032	1 413

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(196)	(85)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	27	(1)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	175	92
Produit de la vente de placements	214	496
Achat de placements	-	(126)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(35)	(45)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	185	331
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	17	266
Montant versé au rachat de parts	(202)	(601)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(185)	(335)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(4)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	2	6
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	2	2
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	109 735	Fonds d'obligations canadiennes TD (série O)	1 209 676	1 028 213	99,65
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 209 676</b>	<b>1 028 213</b>	<b>99,65</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 621	0,35
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 031 834</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	707 000 000	Gouvernement du Canada, 2,000 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	697 078	537 558
	600 000 000	Gouvernement du Canada, 2,000 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	546 323	537 385
	565 900 000	Gouvernement du Canada, 1,750 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	401 122	398 814
	250 000 000	Gouvernement du Canada, 2,750 %, 1 <sup>er</sup> août 2024	245 707	244 645
	118 000 000	Banque Toronto-Dominion, taux variable, rachetable, 4,859 %, 4 mars 2031	126 424	115 873
	130 000 000	Province de l'Ontario, 3,450 %, 2 juin 2045	146 277	113 486
	105 000 000	Province de l'Ontario, 4,700 %, 2 juin 2037	140 378	109 531
	105 000 000	Banque Royale du Canada, 2,328 %, 28 janvier 2027	105 348	94 842
	120 000 000	Province de l'Alberta, 2,950 %, 1 <sup>er</sup> juin 2052	123 454	93 944
	95 000 000	Industries Toromont Limitée, rachetable, 3,842 %, 27 octobre 2027	96 446	91 388
	93 000 000	Province du Manitoba, 4,250 %, 5 mars 2039	93 584	91 059
	93 000 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 2,160 %, 3 février 2025	94 576	87 633
	93 600 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,000 %, 17 avril 2025	94 177	87 506
	68 000 000	Bon du Trésor américain, 2,750 %, 15 août 2032	82 688	84 160
	95 000 000	Province de l'Alberta, 3,300 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2046	97 983	80 425
	81 900 000	Banque Royale du Canada, 1,936 %, 1 <sup>er</sup> mai 2025	81 930	76 425
	75 100 000	Banque Toronto-Dominion (La), 2,667 %, 9 septembre 2025	74 756	70 712
	73 000 000	Rogers Communications Inc., rachetable, 3,650 %, 31 mars 2027	74 621	68 914
	70 000 000	Province du Manitoba, 4,100 %, 5 mars 2041	81 321	66 917
	72 000 000	Banque de Montréal, taux variable, rachetable, 2,077 %, 17 juin 2030	72 185	66 252
	69 400 000	AIMCo Realty Investors Limited Partnership, rachetable, 3,367 %, 1 <sup>er</sup> juin 2027	69 765	65 728
	70 000 000	TransCanada PipeLines Limited, rachetable, 3,390 %, 15 mars 2028	71 627	64 863
	61 300 000	Province du Manitoba, 4,050 %, 5 septembre 2045	67 584	57 780
	62 000 000	Enbridge Inc., rachetable, 3,200 %, 8 juin 2027	62 888	57 595
	60 000 000	Banque de Montréal, rachetable, 2,370 %, 3 février 2025	61 395	56 798

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de Gestion de Placements TD Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.tdassetmanagement.com](http://www.tdassetmanagement.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes TD	8 244 263	1 028	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations canadiennes TD	14 351 198	1 412	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	127 935	158 207
Parts émises contre trésorerie	1 741	23 887
Parts rachetées	(20 695)	(54 159)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	108 981	127 935

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	-

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	9,47	1 032	108 981	3,05	2,22	0,26	2,48	11,84
2021	11,05	1 413	127 935	10,84	2,22	0,28	2,50	12,72
2020	11,59	1 833	158 207	18,53	2,22	0,28	2,50	12,67
2019	10,76	2 011	186 940	10,23	2,22	0,28	2,50	12,75
2018	10,24	2 043	199 544	5,87	2,22	0,28	2,50	12,83

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	13 455	18 324
Trésorerie	35	24
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	21	21
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	13 511	18 369
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	1	-
Montant à payer pour le rachat de parts	22	21
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	23	21
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>13 488</b>	<b>18 348</b>
*Placements au coût	14 642	16 298
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	14,18	16,14
Catégorie Revenu	14,72	16,69
Catégorie GPP	18,78	20,79

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	373	149
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	106
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 147	261
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 213)	1 334
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 692)	1 850
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	244	302
Frais d'administration	30	37
Frais d'assurance	29	36
Taxe de vente harmonisée	35	43
	338	418
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(2 030)</b>	<b>1 432</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,04)	1,06
Catégorie Revenu	(2,04)	1,15
Catégorie GPP	(2,17)	1,88
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	589 123	704 532
Catégorie Revenu	209 363	223 319
Catégorie GPP	184 720	228 363

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	18 348	19 891
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 030)	1 432
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	920	1 269
Montant versé au rachat de parts	(3 750)	(4 244)
	(2 830)	(2 975)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	13 488	18 348

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 030)	1 432
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 147)	(261)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 213	(1 334)
Produit de la vente de placements	23 964	4 016
Achat de placements	(20 787)	(610)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(373)	(255)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	2 840	2 988
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	920	1 269
Montant versé au rachat de parts	(3 749)	(4 274)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(2 829)	(3 005)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	11	(17)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	24	41
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	35	24
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	1 168 093	Fonds équilibré canadien CI (série I)	12 432 632	11 431 427	
	219 905	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	2 209 340	2 023 738	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>14 641 972</b>	<b>13 455 165</b>	<b>99,75</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				<b>33 306</b>	<b>0,25</b>
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>13 488 471</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds équilibré canadien CI</b>				
	3 472 602	Société Financière Manuvie	78 168 084	83 863 338
	3 306 347	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	80 339 640	70 805 421
	71 705	Fairfax Financial Holdings Ltd.	41 189 959	57 512 429
	740 429	Canadian Natural Resources Ltd.	34 701 235	55 672 857
	62 962 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	59 240 544	54 625 655
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 466 550	11 431	0,5
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	2 024	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société obligations canadiennes CI	162 576	2 700	1,7
Catégorie de société de répartition de l'actif canadien CI	2 269 492	15 624	0,7

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	645 405	775 822	215 440	231 616
Parts émises contre trésorerie	42 997	33 144	18 005	22 323
Parts rachetées	(157 427)	(163 561)	(34 947)	(38 499)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>530 975</b>	<b>645 405</b>	<b>198 498</b>	<b>215 440</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	208 669	243 738
Parts émises contre trésorerie	-	21 104
Parts rachetées	(47 002)	(56 173)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>161 667</b>	<b>208 669</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	123
2042	-
<b>Total</b>	<b>123</b>

---

---

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	14,18	7 530	530 975	137,92	2,60	0,30	2,90	11,56
2021	16,14	10 414	645 405	4,40	2,60	0,30	2,90	11,52
2020	15,07	11 690	775 822	11,26	2,60	0,30	2,90	11,42
2019	14,66	14 356	979 020	107,34	2,60	0,30	2,90	11,50
2018	13,29	15 330	1 153 275	7,98	2,60	0,30	2,90	11,63
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	14,72	2 922	198 498	137,92	2,27	0,27	2,54	11,70
2021	16,69	3 596	215 440	4,40	2,27	0,27	2,54	11,74
2020	15,53	3 597	231 616	11,26	2,27	0,27	2,54	11,71
2019	15,06	3 533	234 601	107,34	2,27	0,26	2,53	11,56
2018	13,60	3 760	276 429	7,98	2,27	0,25	2,52	11,11
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	18,78	3 036	161 667	137,92	0,15	0,02	0,17	10,42
2021	20,79	4 338	208 669	4,40	0,15	0,02	0,17	10,55
2020	18,89	4 604	243 738	11,26	0,15	0,02	0,17	10,53
2019	17,89	5 032	281 231	107,34	0,15	0,02	0,17	10,38
2018	15,79	5 045	319 553	7,98	0,15	0,02	0,17	11,01

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	59 577	21 885
Trésorerie	221	35
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	162	47
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	59 960	21 967
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	161	42
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	161	42
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>59 799</b>	<b>21 925</b>
*Placements au coût	61 382	18 524
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,66	21,67
Catégorie Revenu	19,51	22,57
Catégorie GPP	24,78	27,99

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	1 249	306
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 799	242
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	326	707
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(5 166)	2 877
Autres revenus		
Intérêts	2	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 790)	4 132
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	543	390
Frais d'administration	67	48
Frais d'assurance	57	42
Taxe de vente harmonisée	71	52
	738	532
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(2 528)</b>	<b>3 600</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,67)	3,17
Catégorie Revenu	(1,82)	3,40
Catégorie GPP	(1,01)	4,64
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	773 281	542 676
Catégorie Revenu	585 350	376 318
Catégorie GPP	171 821	129 703

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	21 925	21 784
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 528)	3 600
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	5 064	1 355
Montant versé au rachat de parts	(8 629)	(4 814)
Acquisition des actifs de fonds clôturés	43 967	-
	40 402	(3 459)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	59 799	21 925

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 528)	3 600
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(326)	(707)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	5 166	(2 877)
Produit de la vente de placements	27 867	7 178
Achat de placements	(23 650)	(3 122)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(3 048)	(548)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	3 481	3 524
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	5 064	1 355
Montant versé au rachat de parts	(8 510)	(4 817)
Acquisition des actifs de fonds dissous	151	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(3 295)	(3 462)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	186	62
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	35	(27)
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	221	35
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	2	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	1 912 827	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	17 845 446	17 603 361	
	1 866 765	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	43 536 871	41 974 013	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>61 382 317</b>	<b>59 577 374</b>	<b>99,63</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				222 037	0,37
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>59 799 411</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'actions canadiennes sélect CI</b>				
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	120 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	41 974	1,5
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	17 603	0,5

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société obligations de sociétés CI	843 128	6 723	0,8
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 441 360	15 162	0,6

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	487 052	595 347	348 328	408 502
Parts émises contre trésorerie	45 320	30 520	35 806	7 603
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	1 153 996	-	1 050 293	-
Parts rachetées	(154 941)	(138 815)	(269 298)	(67 777)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 531 427</b>	<b>487 052</b>	<b>1 165 129</b>	<b>348 328</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	125 332	123 457
Parts émises contre trésorerie	147 048	23 563
Parts émises à l'acquisition des actifs de fonds dissous	89 808	-
Parts rachetées	(19 543)	(21 688)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>342 645</b>	<b>125 332</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,66	28 572	1 531 427	86,21	2,65	0,31	2,96	11,55
2021	21,67	10 556	487 052	16,42	2,65	0,31	2,96	11,54
2020	18,56	11 049	595 347	37,49	2,65	0,30	2,95	11,14
2019	18,39	13 495	733 823	124,08	2,65	0,30	2,95	11,19
2018	16,04	14 136	881 208	29,08	2,65	0,30	2,95	11,23
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	19,51	22 735	1 165 129	86,21	2,27	0,21	2,48	9,81
2021	22,57	7 861	348 328	16,42	2,27	0,22	2,49	9,57
2020	19,23	7 857	408 502	37,49	2,27	0,22	2,49	9,61
2019	18,97	8 475	446 663	124,08	2,27	0,22	2,49	9,58
2018	16,48	8 382	508 735	29,08	2,27	0,21	2,48	9,44
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	24,78	8 492	342 645	86,21	0,15	0,01	0,16	9,38
2021	27,99	3 508	125 332	16,42	0,15	0,01	0,16	8,97
2020	23,31	2 878	123 457	37,49	0,15	0,01	0,16	9,79
2019	22,46	4 027	179 265	124,08	0,15	0,01	0,16	9,17
2018	19,06	3 672	192 691	29,08	0,15	0,01	0,16	8,87

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	11 352	14 626
Trésorerie	56	33
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	41	39
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	11 449	14 698
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	40	39
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	40	39
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>11 409</b>	<b>14 659</b>
*Placements au coût	12 488	12 320
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,40	21,38
Catégorie Revenu	19,19	22,22
Catégorie GPP	24,45	27,63

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	165	125
Distribution de gains en capital provenant des placements	193	183
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 413	547
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 442)	1 460
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 670)	2 315
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	214	260
Frais d'administration	28	34
Frais d'assurance	13	18
Taxe de vente harmonisée	26	32
	281	344
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 951)</b>	<b>1 971</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,26)	2,54
Catégorie Revenu	(3,08)	2,67
Catégorie GPP	(3,24)	3,89
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	174 332	229 052
Catégorie Revenu	361 763	383 258
Catégorie GPP	83 416	93 627

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	14 659	15 266
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 951)	1 971
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	903	986
Montant versé au rachat de parts	(2 202)	(3 564)
	(1 299)	(2 578)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	11 409	14 659

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 951)	1 971
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 413)	(547)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 442	(1 460)
Produit de la vente de placements	18 021	4 926
Achat de placements	(16 420)	(2 027)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(358)	(308)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 321	2 555
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	903	986
Montant versé au rachat de parts	(2 201)	(3 566)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 298)	(2 580)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	23	(25)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	33	58
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	56	33
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	355 552	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	3 543 509	3 272 072	
	309 718	Fonds d'actions mondiales CI (série I)	4 444 223	4 043 651	
	179 522	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	4 500 357	4 036 529	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>12 488 089</b>	<b>11 352 252</b>	<b>99,50</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				<b>56 495</b>	<b>0,50</b>
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>11 408 747</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'actions canadiennes sélect CI</b>				
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	120 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Fonds d'actions mondiales CI</b>				
	127 471	Microsoft Corp.	36 529 886	41 391 909
	53 135	Elevance Health Inc.	19 180 971	36 905 519
	302 740	Alphabet Inc., catégorie A	19 430 882	36 166 356
	203 500	Apple Inc.	37 022 173	35 800 782
	895 500	Shell PLC	34 919 086	34 095 911

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions mondiales CI	159 245	4 044	2,5
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	3 272	0,1
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	4 036	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société obligations canadiennes CI	162 576	4 014	2,5
Catégorie de société d'actions mondiales CI	1 178 404	5 258	0,4
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 441 360	5 354	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	198 926	260 997	363 015	405 817
Parts émises contre trésorerie	6 342	14 729	40 008	24 826
Parts rachetées	(46 267)	(76 800)	(64 798)	(67 628)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	159 001	198 926	338 225	363 015

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	84 700	100 826
Parts émises contre trésorerie	-	6 557
Parts rachetées	(3 210)	(22 683)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	81 490	84 700

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	78
2042	-
<b>Total</b>	<b>78</b>

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,40	2 926	159 001	134,50	2,67	0,27	2,94	10,20
2021	21,38	4 253	198 926	15,51	2,67	0,27	2,94	10,28
2020	18,90	4 933	260 997	35,74	2,67	0,27	2,94	10,28
2019	18,14	5 931	326 997	124,30	2,67	0,27	2,94	10,18
2018	15,80	6 905	437 036	32,74	2,67	0,28	2,95	10,65
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	19,19	6 491	338 225	134,50	2,29	0,23	2,52	10,10
2021	22,22	8 066	363 015	15,51	2,29	0,23	2,52	10,19
2020	19,56	7 937	405 817	35,74	2,29	0,23	2,52	9,93
2019	18,69	8 339	446 070	124,30	2,29	0,22	2,51	9,65
2018	16,21	7 795	480 779	32,74	2,29	0,22	2,51	9,56
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	24,45	1 992	81 490	134,50	0,15	0,02	0,17	11,89
2021	27,63	2 340	84 700	15,51	0,15	0,02	0,17	11,45
2020	23,76	2 396	100 826	35,74	0,15	0,02	0,17	11,78
2019	22,18	2 565	115 616	124,30	0,15	0,02	0,17	10,23
2018	18,79	3 305	175 859	32,74	0,15	0,02	0,17	11,16

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	18 385	21 650
Trésorerie	80	55
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	52	60
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	18 517	21 765
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	52	46
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	52	46
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>18 465</b>	<b>21 719</b>
*Placements au coût	19 283	18 115
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	23,67	26,08
Catégorie Revenu	24,74	27,14
Catégorie GPP	31,55	33,79

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	244	92
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 779	78
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	984	784
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 433)	1 712
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 425)	2 666
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	298	359
Frais d'administration	39	47
Frais d'assurance	27	34
Taxe de vente harmonisée	42	51
	406	491
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 831)</b>	<b>2 175</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,56)	2,32
Catégorie Revenu	(2,43)	2,47
Catégorie GPP	(2,28)	3,70
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	292 878	348 324
Catégorie Revenu	300 073	321 750
Catégorie GPP	155 016	154 632

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	21 719	21 005
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 831)	2 175
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1 920	2 644
Montant versé au rachat de parts	(3 343)	(4 105)
	(1 423)	(1 461)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	18 465	21 719

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 831)	2 175
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(984)	(784)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 433	(1 712)
Produit de la vente de placements	23 909	5 783
Achat de placements	(22 062)	(3 815)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(2 023)	(170)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 442	1 477
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1 920	2 644
Montant versé au rachat de parts	(3 337)	(4 148)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 417)	(1 504)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	25	(27)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	55	82
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	80	55
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	776 026	Fonds chefs de file mondiaux CI (série I)	13 662 293	12 906 318	
	595 376	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	5 620 999	5 479 126	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>19 283 292</b>	<b>18 385 444</b>	<b>99,57</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				79 965	0,43
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>18 465 409</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Fonds chefs de file mondiaux CI</b>				
	4 366 765	Interpublic Group of Cos. Inc. (The)	136 594 692	196 948 700
	2 215 173	HeidelbergCement AG	223 660 202	171 063 328
	5 244 533	Makita Corp.	243 213 549	166 651 790
	2 369 893	Murata Manufacturing Co., Ltd.	209 755 243	161 077 459
	4 567 219	DBS Group Holdings Ltd.	96 861 471	156 608 760

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds chefs de file mondiaux CI	3 577 796	12 906	0,4
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	5 479	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société chefs de file mondiaux CI	1 145 445	15 282	1,3
Catégorie de société obligations de sociétés CI	843 128	6 368	0,8

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	313 342	371 604	306 476	332 593
Parts émises contre trésorerie	30 153	35 566	27 850	29 396
Parts rachetées	(69 545)	(93 828)	(39 606)	(55 513)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>273 950</b>	<b>313 342</b>	<b>294 720</b>	<b>306 476</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	154 741	130 324
Parts émises contre trésorerie	15 817	31 763
Parts rachetées	(21 894)	(7 346)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>148 664</b>	<b>154 741</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	162
2042	-
<b>Total</b>	<b>162</b>

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	23,67	6 484	273 950	124,45	2,67	0,32	2,99	12,09
2021	26,08	8 172	313 342	17,78	2,67	0,32	2,99	11,91
2020	23,86	8 867	371 604	18,78	2,67	0,32	2,99	11,81
2019	21,63	9 327	431 152	121,42	2,67	0,32	2,99	11,81
2018	19,05	9 991	524 314	21,17	2,67	0,31	2,98	11,72
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	24,74	7 291	294 720	124,45	2,29	0,26	2,55	11,18
2021	27,14	8 318	306 476	17,78	2,29	0,26	2,55	11,32
2020	24,72	8 221	332 593	18,78	2,29	0,26	2,55	11,35
2019	22,31	8 298	371 944	121,42	2,29	0,26	2,55	11,35
2018	19,57	7 651	391 053	21,17	2,29	0,26	2,55	11,44
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	31,55	4 690	148 664	124,45	0,15	0,01	0,16	9,53
2021	33,79	5 229	154 741	17,78	0,15	0,01	0,16	8,89
2020	30,05	3 917	130 324	18,78	0,15	0,01	0,16	9,50
2019	26,49	3 841	145 008	121,42	0,15	0,01	0,16	8,80
2018	22,69	4 002	176 426	21,17	0,15	0,01	0,16	8,75

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 706	4 643
Trésorerie	9	15
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	9	10
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 724	4 668
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	10	9
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	10	9
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 714</b>	<b>4 659</b>
*Placements au coût	3 807	3 722
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	12,78	14,28
Catégorie Revenu	13,30	14,80
Catégorie GPP	16,90	18,37

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	141	68
Distribution de gains en capital provenant des placements	150	3
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	371	142
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 022)	474
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(360)	687
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	72	85
Frais d'administration	9	11
Frais d'assurance	7	8
Taxe de vente harmonisée	10	12
	98	116
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(458)</b>	<b>571</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,57)	1,62
Catégorie Revenu	(1,53)	1,73
Catégorie GPP	(1,51)	2,32
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	156 430	181 613
Catégorie Revenu	106 178	120 100
Catégorie GPP	33 302	30 027

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	4 659	4 480
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(458)	571
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	130	632
Montant versé au rachat de parts	(617)	(1 024)
	(487)	(392)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 714	4 659

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(458)	571
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(371)	(142)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 022	(474)
Produit de la vente de placements	5 391	944
Achat de placements	(4 813)	(426)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(291)	(71)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	480	402
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	130	632
Montant versé au rachat de parts	(616)	(1 024)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(486)	(392)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(6)	10
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	15	5
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	9	15
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	321 694	Fonds équilibré canadien CI (série I)	3 234 895	3 148 224	
	60 561	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	571 679	557 333	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 806 574</b>	<b>3 705 557</b>	<b>99,77</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				8 589	0,23
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 714 146</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds équilibré canadien CI</b>				
	3 472 602	Société Financière Manuvie	78 168 084	83 863 338
	3 306 347	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	80 339 640	70 805 421
	71 705	Fairfax Financial Holdings Ltd.	41 189 959	57 512 429
	740 429	Canadian Natural Resources Ltd.	34 701 235	55 672 857
	62 962 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	59 240 544	54 625 655
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 466 550	3 149	0,1
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	557	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société équilibrée canadienne CI	77 006	3 953	5,1
Catégorie de société gestion du revenu Sélect CI	2 760 812	690	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	168 524	194 535	109 547	133 223
Parts émises contre trésorerie	2 854	22 024	6 955	611
Parts rachetées	(29 614)	(48 035)	(14 036)	(24 287)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	141 764	168 524	102 466	109 547

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	34 351	17 082
Parts émises contre trésorerie	-	19 302
Parts rachetées	(2 405)	(2 033)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	31 946	34 351

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	2
2041	19
2042	-
<b>Total</b>	<b>21</b>

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	12,78	1 811	141 764	124,88	2,60	0,30	2,90	11,73
2021	14,28	2 406	168 524	10,69	2,60	0,31	2,91	11,82
2020	12,68	2 466	194 535	7,95	2,60	0,30	2,90	11,52
2019	11,97	2 708	226 287	108,29	2,60	0,30	2,90	11,43
2018	10,95	2 736	249 864	10,27	2,60	0,31	2,91	11,83
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	13,30	1 363	102 466	124,88	2,27	0,26	2,53	11,27
2021	14,80	1 622	109 547	10,69	2,27	0,24	2,51	10,71
2020	13,09	1 743	133 223	7,95	2,27	0,24	2,51	10,61
2019	12,30	1 706	138 644	108,29	2,27	0,24	2,51	10,64
2018	11,22	1 783	158 948	10,27	2,27	0,24	2,51	10,59
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	16,90	540	31 946	124,88	0,15	0,01	0,16	8,00
2021	18,37	631	34 351	10,69	0,15	0,02	0,17	11,52
2020	15,87	271	17 082	7,95	0,15	0,02	0,17	11,53
2019	14,57	274	18 815	108,29	0,15	0,02	0,17	12,19
2018	12,98	486	37 444	10,27	0,15	0,01	0,16	8,33

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	11 751	13 562
Trésorerie	47	21
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	35	26
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	11 833	13 609
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	34	25
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	34	25
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>11 799</b>	<b>13 584</b>
*Placements au coût	12 072	11 369
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,03	16,38
Catégorie Revenu	15,71	17,04
Catégorie GPP	20,01	21,22

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	505	219
Distribution de gains en capital provenant des placements	304	56
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	963	511
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 514)	1 528
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(741)	2 314
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	224	255
Frais d'administration	28	32
Frais d'assurance	21	27
Taxe de vente harmonisée	29	33
	302	347
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 043)</b>	<b>1 967</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,39)	2,12
Catégorie Revenu	(1,34)	2,25
Catégorie GPP	(1,19)	3,16
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	375 715	460 177
Catégorie Revenu	321 051	338 946
Catégorie GPP	77 708	73 548

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	13 584	14 223
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 043)	1 967
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	991	1 232
Montant versé au rachat de parts	(1 733)	(3 838)
	(742)	(2 606)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	11 799	13 584

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 043)	1 967
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(963)	(511)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 514	(1 528)
Produit de la vente de placements	17 122	4 938
Achat de placements	(16 062)	(1 970)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(809)	(275)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	759	2 621
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	991	1 234
Montant versé au rachat de parts	(1 724)	(3 841)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(733)	(2 607)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	26	14
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	21	7
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	47	21
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	1 020 175	Fonds équilibré canadien CI (série I)	10 258 933	9 983 841	
	192 057	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	1 812 709	1 767 461	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>12 071 642</b>	<b>11 751 302</b>	<b>99,60</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				<b>47 729</b>	<b>0,40</b>
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>11 799 031</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds équilibré canadien CI</b>				
	3 472 602	Société Financière Manuvie	78 168 084	83 863 338
	3 306 347	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	80 339 640	70 805 421
	71 705	Fairfax Financial Holdings Ltd.	41 189 959	57 512 429
	740 429	Canadian Natural Resources Ltd.	34 701 235	55 672 857
	62 962 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	59 240 544	54 625 655
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds équilibré canadien CI	2 466 550	9 984	0,4
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	1 767	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI	531 074	8 037	1,5
Catégorie de société gestion du revenu Sélect CI	2 760 812	5 525	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	404 425	526 525	320 530	364 217
Parts émises contre trésorerie	20 059	20 637	29 422	14 122
Parts rachetées	(75 926)	(142 737)	(31 686)	(57 809)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>348 558</b>	<b>404 425</b>	<b>318 266</b>	<b>320 530</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	70 519	72 948
Parts émises contre trésorerie	9 491	36 960
Parts rachetées	(2 098)	(39 389)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>77 912</b>	<b>70 519</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,03	5 241	348 558	134,41	2,64	0,28	2,92	10,65
2021	16,38	6 625	404 425	16,11	2,65	0,29	2,94	10,92
2020	14,28	7 521	526 525	24,04	2,65	0,29	2,94	10,81
2019	14,05	8 463	602 326	127,66	2,65	0,29	2,94	10,90
2018	12,79	9 064	708 530	18,37	2,65	0,29	2,94	11,11
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	15,71	4 999	318 266	134,41	2,27	0,23	2,50	10,25
2021	17,04	5 463	320 530	16,11	2,27	0,23	2,50	10,21
2020	14,80	5 390	364 217	24,04	2,27	0,23	2,50	10,20
2019	14,49	5 735	395 780	127,66	2,27	0,23	2,50	10,19
2018	13,14	5 712	434 818	18,37	2,27	0,22	2,49	9,90
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	20,01	1 559	77 912	134,41	0,15	0,02	0,17	10,29
2021	21,22	1 496	70 519	16,11	0,15	0,02	0,17	10,90
2020	17,99	1 312	72 948	24,04	0,15	0,01	0,16	9,90
2019	17,21	1 553	90 231	127,66	0,15	0,02	0,17	10,08
2018	15,24	1 493	97 950	18,37	0,15	0,01	0,16	9,68

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	6 715	9 648
Trésorerie	30	28
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	20	21
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	6 765	9 697
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	20	20
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	20	20
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>6 745</b>	<b>9 677</b>
*Placements au coût	7 323	7 716
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	20,84	24,50
Catégorie Revenu	21,74	25,47
Catégorie GPP	27,79	31,79

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	55	24
Distribution de gains en capital provenant des placements	48	57
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 275	348
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 540)	1 206
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 162)	1 635
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	148	182
Frais d'administration	19	24
Frais d'assurance	15	19
Taxe de vente harmonisée	17	21
	199	246
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 361)</b>	<b>1 389</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,88)	3,23
Catégorie Revenu	(3,89)	3,44
Catégorie GPP	(4,04)	4,96
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	176 684	216 499
Catégorie Revenu	153 971	169 768
Catégorie GPP	19 120	21 439

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	9 677	9 580
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 361)	1 389
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	414	711
Montant versé au rachat de parts	(1 985)	(2 003)
	(1 571)	(1 292)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	6 745	9 677

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 361)	1 389
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 275)	(348)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 540	(1 206)
Produit de la vente de placements	12 027	2 541
Achat de placements	(10 255)	(978)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(103)	(81)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 573	1 317
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	414	711
Montant versé au rachat de parts	(1 985)	(2 004)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 571)	(1 293)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2	24
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	28	4
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	30	28
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	89 545	Fonds d'actions américaines sélectionnées CI (catégorie I)	5 267 242	4 819 709	
	205 981	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	2 056 056	1 895 598	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>7 323 298</b>	<b>6 715 307</b>	<b>99,56</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				29 813	0,44
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>6 745 120</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Fonds d'actions américaines sélectionnées CI</b>				
	56 972	Humana Inc.	31 201 463	39 510 382
	341 159	NextEra Energy Inc.	32 200 451	38 617 288
	112 401	Microsoft Corp.	12 814 650	36 498 435
	256 200	Alphabet Inc., catégorie C	23 293 409	30 779 976
	67 835	Air Products and Chemicals Inc.	23 454 461	28 313 246

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	620 950	4 820	0,8
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	1 895	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions américaines CI	323 926	6 880	2,1
Catégorie de société obligations canadiennes CI	162 576	2 768	1,7

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	202 251	233 320	161 199	184 380
Parts émises contre trésorerie	10 051	23 813	8 920	5 516
Parts rachetées	(66 887)	(54 882)	(23 234)	(28 697)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	145 415	202 251	146 885	161 199

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	19 378	20 720
Parts émises contre trésorerie	-	1 438
Parts rachetées	(658)	(2 780)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	18 720	19 378

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	185
2042	-
<b>Total</b>	<b>185</b>

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	20,84	3 031	145 415	132,39	2,66	0,22	2,88	8,12
2021	24,50	4 955	202 251	11,04	2,66	0,22	2,88	8,40
2020	21,27	4 962	233 320	32,41	2,66	0,24	2,90	9,16
2019	19,98	4 498	225 066	122,75	2,66	0,24	2,90	9,13
2018	17,11	4 588	268 081	52,41	2,66	0,25	2,91	9,28
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	21,74	3 194	146 885	132,39	2,28	0,25	2,53	10,91
2021	25,47	4 106	161 199	11,04	2,28	0,25	2,53	10,99
2020	22,03	4 062	184 380	32,41	2,28	0,25	2,53	11,09
2019	20,62	4 272	207 158	122,75	2,28	0,25	2,53	10,93
2018	17,59	4 007	227 798	52,41	2,28	0,25	2,53	11,15
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	27,79	520	18 720	132,39	0,15	0,01	0,16	7,70
2021	31,79	616	19 378	11,04	0,15	0,01	0,16	7,05
2020	26,85	556	20 720	32,41	0,15	0,01	0,16	8,40
2019	24,55	653	26 611	122,75	0,15	0,02	0,17	11,52
2018	20,45	546	26 700	52,41	0,15	0,02	0,17	12,31

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	11 726	15 053
Trésorerie	-	16
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	37	36
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	11 763	15 105
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	1	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	37	36
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	38	36
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>11 725</b>	<b>15 069</b>
*Placements au coût	12 324	11 948
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,67	19,79
Catégorie Revenu	18,43	20,56
Catégorie GPP	23,39	25,49

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	446	157
Distribution de gains en capital provenant des placements	598	120
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1 488	757
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 703)	1 906
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 170)	2 940
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	200	244
Frais d'administration	24	30
Frais d'assurance	14	18
Taxe de vente harmonisée	25	30
	263	322
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 433)</b>	<b>2 618</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,20)	3,02
Catégorie Revenu	(2,22)	3,19
Catégorie GPP	(2,13)	4,50
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	206 297	254 612
Catégorie Revenu	307 319	363 572
Catégorie GPP	138 670	152 733

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	15 069	14 883
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 433)	2 618
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	206	755
Montant versé au rachat de parts	(2 117)	(3 187)
	(1 911)	(2 432)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	11 725	15 069

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 433)	2 618
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1 488)	(757)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 703	(1 906)
Produit de la vente de placements	17 640	4 640
Achat de placements	(15 485)	(1 878)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 044)	(277)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 893	2 440
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	206	755
Montant versé au rachat de parts	(2 116)	(3 188)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(1 910)	(2 433)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(17)	7
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	16	9
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	(1)	16
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	376 504	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	3 545 697	3 464 895	
	367 402	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	8 778 000	8 260 997	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>12 323 697</b>	<b>11 725 892</b>	<b>100,01</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(810)	(0,01)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>11 725 082</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'actions canadiennes sélect CI</b>				
	5 856 936	Société Financière Manuvie	134 346 995	141 445 004
	5 497 635	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	132 163 428	117 731 854
	120 501	Fairfax Financial Holdings Ltd.	71 253 351	96 650 237
	1 243 204	Canadian Natural Resources Ltd.	62 368 832	93 476 509
	3 119 593	Cenovus Energy Inc.	54 521 462	81 951 708
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 752 556	8 261	0,3
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	3 465	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions canadiennes sélect CI	830 105	10 499	1,3
Catégorie de société obligations de sociétés CI	843 128	4 554	0,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	239 487	278 873	326 831	384 239
Parts émises contre trésorerie	2 860	26 443	8 237	11 630
Parts rachetées	(54 727)	(65 829)	(49 664)	(69 038)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>187 620</b>	<b>239 487</b>	<b>285 404</b>	<b>326 831</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	141 604	165 466
Parts émises contre trésorerie	-	2 344
Parts rachetées	(6 915)	(26 206)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>134 689</b>	<b>141 604</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,67	3 315	187 620	127,91	2,65	0,28	2,93	10,44
2021	19,79	4 740	239 487	13,96	2,65	0,28	2,93	10,55
2020	16,84	4 697	278 873	21,88	2,65	0,27	2,92	10,35
2019	16,00	5 485	342 807	125,32	2,65	0,27	2,92	10,19
2018	13,82	5 107	369 648	22,99	2,65	0,27	2,92	10,29
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	18,43	5 260	285 404	127,91	2,27	0,24	2,51	10,36
2021	20,56	6 720	326 831	13,96	2,27	0,23	2,50	9,96
2020	17,42	6 695	384 239	21,88	2,27	0,22	2,49	9,61
2019	16,48	6 811	413 298	125,32	2,27	0,22	2,49	9,53
2018	14,17	6 184	436 391	22,99	2,27	0,22	2,49	9,52
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	23,39	3 150	134 689	127,91	0,15	0,01	0,16	7,73
2021	25,49	3 609	141 604	13,96	0,15	0,01	0,16	7,38
2020	21,10	3 491	165 466	21,88	0,15	0,01	0,16	7,52
2019	19,49	3 630	186 248	125,32	0,15	0,01	0,16	7,74
2018	16,38	3 710	226 517	22,99	0,15	0,01	0,16	8,35

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	2 977	3 739
Trésorerie	12	8
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	9	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 998	3 747
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	8	8
Frais de gestion à payer	-	4
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	8	12
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>2 990</b>	<b>3 735</b>
*Placements au coût	3 089	3 352
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,54	21,63
Catégorie Revenu	19,22	22,35

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	52	72
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	206
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	26	158
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(499)	(162)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	7	21
	(414)	295
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	76	106
Frais d'administration	10	13
Frais d'assurance	6	8
Taxe de vente harmonisée	9	11
	101	138
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(515)</b>	<b>157</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,17)	0,84
Catégorie Revenu	(3,15)	0,92
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	83 720	96 019
Catégorie Revenu	79 186	82 424

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	3 735	3 979
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(515)	157
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	124	146
Montant versé au rachat de parts	(354)	(547)
	(230)	(401)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	2 990	3 735

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(515)	157
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(26)	(158)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	499	162
Produit de la vente de placements	3 877	1 158
Achat de placements	(3 545)	(639)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(52)	(278)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(4)	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	234	402
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	124	146
Montant versé au rachat de parts	(354)	(548)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(230)	(402)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4	-
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	8	8
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	12	8
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	85 410	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	809 305	786 012	
	51 761	Fonds d'actions mondiales Sélect CI (série I)	2 279 439	2 191 185	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>3 088 744</b>	<b>2 977 197</b>	<b>99,58</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				<b>12 596</b>	<b>0,42</b>
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>2 989 793</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'actions mondiales Sélect CI</b>				
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		24 234 166
	51 200	Microsoft Corp.	12 246 152	16 625 474
	86 803	Apple Inc.	12 336 500	15 270 837
	392 768	Shell PLC	10 956 295	14 954 531
	53 606	Johnson & Johnson	11 883 370	12 821 703
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	504 863	2 191	0,4
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	786	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup>	4 476 464	2 808	0,1
Fonds Fidelity Obligations canadiennes	10 243 327	931	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	89 932	105 127	80 098	83 597
Parts émises contre trésorerie	25	2 898	6 032	3 816
Parts rachetées	(9 575)	(18 093)	(8 115)	(7 315)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>80 382</b>	<b>89 932</b>	<b>78 015</b>	<b>80 098</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	34
<b>Total</b>	<b>34</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,54	1 490	80 382	112,64	2,86	0,25	3,11	8,86
2021	21,63	1 945	89 932	23,61	2,92	0,26	3,18	8,81
2020	20,81	2 187	105 127	29,85	2,92	0,24	3,16	8,19
2019	17,96	2 610	145 332	49,12	2,93	0,26	3,19	8,82
2018	17,20	3 143	182 782	51,06	2,92	0,26	3,18	8,81
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	19,22	1 500	78 015	112,64	2,46	0,31	2,77	12,44
2021	22,35	1 790	80 098	23,61	2,52	0,31	2,83	12,27
2020	21,43	1 792	83 597	29,85	2,52	0,31	2,83	12,47
2019	18,43	1 635	88 707	49,12	2,53	0,31	2,84	12,46
2018	17,59	1 685	95 791	51,06	2,52	0,32	2,84	12,61

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	7 367	9 306
Trésorerie	28	29
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	19	18
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	7 414	9 353
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	19	17
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	19	17
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>7 395</b>	<b>9 336</b>
*Placements au coût	7 372	7 297
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	21,92	26,39
Catégorie Revenu	22,87	27,41
Catégorie GPP	29,26	34,25

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	57	16
Distribution de gains en capital provenant des placements	365	113
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	251	421
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 014)	1 445
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 340)	1 995
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	122	146
Frais d'administration	16	19
Frais d'assurance	14	17
Taxe de vente harmonisée	17	20
	169	202
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 509)</b>	<b>1 793</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(4,61)	4,49
Catégorie Revenu	(4,56)	4,78
Catégorie GPP	(5,11)	6,58
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	159 241	183 107
Catégorie Revenu	97 265	104 655
Catégorie GPP	64 802	71 568

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	9 336	8 850
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 509)	1 793
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	1 022	1 599
Montant versé au rachat de parts	(1 454)	(2 906)
	(432)	(1 307)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	7 395	9 336

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 509)	1 793
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(251)	(421)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 014	(1 445)
Produit de la vente de placements	9 712	2 673
Achat de placements	(9 115)	(1 171)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(422)	(129)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	429	1 300
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	1 022	1 599
Montant versé au rachat de parts	(1 452)	(2 907)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(430)	(1 308)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	(8)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	29	37
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	28	29
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	98 247	Fonds d'actions américaines sélectionnées CI (catégorie I)	5 238 858	5 288 115	
	225 867	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	2 133 189	2 078 609	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>7 372 047</b>	<b>7 366 724</b>	<b>99,62</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				<b>27 832</b>	<b>0,38</b>
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>7 394 556</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Fonds d'actions américaines sélectionnées CI</b>				
	56 972	Humana Inc.	31 201 463	39 510 382
	341 159	NextEra Energy Inc.	32 200 451	38 617 288
	112 401	Microsoft Corp.	12 814 650	36 498 435
	256 200	Alphabet Inc., catégorie C	23 293 409	30 779 976
	67 835	Air Products and Chemicals Inc.	23 454 461	28 313 246

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	620 950	5 288	0,9
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	2 079	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	611 927	6 435	1,1
Catégorie de société obligations de sociétés CI	843 128	2 871	0,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	164 476	197 020	98 110	113 952
Parts émises contre trésorerie	26 700	51 952	17 413	4 750
Parts rachetées	(38 057)	(84 496)	(19 225)	(20 592)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	153 119	164 476	96 298	98 110

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	67 328	70 711
Parts émises contre trésorerie	-	9 505
Parts rachetées	(4 598)	(12 888)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	62 730	67 328

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	62
2042	-
<b>Total</b>	<b>62</b>

---

---

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	21,92	3 357	153 119	121,40	2,66	0,29	2,95	10,89
2021	26,39	4 341	164 476	14,05	2,66	0,29	2,95	11,01
2020	21,90	4 314	197 020	25,63	2,66	0,29	2,95	10,83
2019	20,81	4 484	215 439	127,85	2,66	0,28	2,94	10,38
2018	17,70	4 143	234 042	21,47	2,66	0,29	2,95	10,73
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	22,87	2 202	96 298	121,40	2,28	0,27	2,55	11,88
2021	27,41	2 689	98 110	14,05	2,28	0,26	2,54	11,53
2020	22,65	2 581	113 952	25,63	2,28	0,26	2,54	11,42
2019	21,44	2 404	112 113	127,85	2,28	0,25	2,53	11,17
2018	18,17	2 153	118 523	21,47	2,28	0,23	2,51	10,27
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	29,26	1 836	62 730	121,40	0,15	0,02	0,17	10,83
2021	34,25	2 306	67 328	14,05	0,15	0,02	0,17	10,38
2020	27,64	1 955	70 711	25,63	0,15	0,02	0,17	11,09
2019	25,54	1 927	75 433	127,85	0,15	0,02	0,17	11,39
2018	21,14	1 607	76 009	21,47	0,15	0,02	0,17	12,02

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 653	1 934
Trésorerie	5	11
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 659	1 946
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	4	4
Frais de gestion à payer	3	2
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	7	6
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 652	1 940
*Placements au coût	1 542	1 609
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,36	18,94
Catégorie Revenu	18,18	19,74

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	89	33
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	68
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	21	76
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(214)	127
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	8	9
	(96)	313
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	47	51
Frais d'administration	6	6
Frais d'assurance	3	3
Taxe de vente harmonisée	5	5
	61	65
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(157)	248
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,62)	2,30
Catégorie Revenu	(1,63)	2,48
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	41 770	43 460
Catégorie Revenu	54 707	59 551

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 940	1 771
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(157)	248
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	67	232
Montant versé au rachat de parts	(198)	(311)
	(131)	(79)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 652	1 940

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(157)	248
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(21)	(76)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	214	(127)
Produit de la vente de placements	370	433
Achat de placements	(194)	(295)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(89)	(101)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	124	82
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	67	232
Montant versé au rachat de parts	(197)	(311)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(130)	(79)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(6)	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	11	8
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	5	11
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	30 314	Fonds Fidelity Obligations canadiennes (série O)	439 876	384 371	
	21 619	Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> (série O)	1 102 199	1 269 041	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 542 075</b>	<b>1 653 412</b>	<b>100,11</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(1 804)	(0,11)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 651 608</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds Fidelity Obligations canadiennes</b>				
	351 335 000	Fiducie du Canada pour l'habitation, 3,55 %, 9/32 144A	353 756 836	345 309 605
	224 380 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2031	204 498 922	193 289 907
	220 800 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	175 716 302	155 555 808
	153 560 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	148 960 133	148 325 140
	155 670 000	Province de l'Ontario, 2,7 %, 2 juin 2029	161 524 702	145 224 543
<b>Fonds Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup></b>				
	2 655 000	Banque Royale du Canada	264 052 182	337 981 500
	2 885 000	Banque Toronto-Dominion	176 459 753	252 927 950
	2 440 000	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	203 737 054	246 318 000
	3 580 000	Rogers Communications Inc., catégorie B, sans droit de vote	218 687 513	226 864 600
	2 490 000	Canadian Natural Resources Ltd.	98 090 902	187 223 100

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Fidelity, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.fidelity.ca](http://www.fidelity.ca).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Obligations canadiennes	11 233 390	384	-
Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup>	5 275 683	1 269	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds Fidelity Obligations canadiennes	10 243 327	543	-
Fonds Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup>	6 073 694	1 391	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	43 852	44 387	56 173	59 863
Parts émises contre trésorerie	528	9 408	3 095	3 650
Parts rachetées	(4 471)	(9 943)	(6 529)	(7 340)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>39 909</b>	<b>43 852</b>	<b>52 739</b>	<b>56 173</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,36	693	39 909	16,21	2,90	0,32	3,22	10,94
2021	18,94	831	43 852	21,04	2,90	0,31	3,21	10,80
2020	16,63	738	44 387	33,27	2,91	0,30	3,21	10,38
2019	15,24	767	50 345	26,83	2,90	0,30	3,20	10,36
2018	13,42	720	53 599	22,46	2,90	0,30	3,20	10,35
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	18,18	959	52 739	16,21	2,50	0,26	2,76	10,57
2021	19,74	1 109	56 173	21,04	2,50	0,26	2,76	10,49
2020	17,25	1 033	59 863	33,27	2,51	0,26	2,77	10,23
2019	15,74	873	55 445	26,83	2,50	0,25	2,75	10,19
2018	13,80	773	56 051	22,46	2,50	0,23	2,73	9,09

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord<sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	410	568
Trésorerie	2	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	412	569
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	2	1
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	2	1
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	410	568
*Placements au coût	377	445
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,02	17,19
Catégorie Revenu	15,53	17,73

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	18	11
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	3
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	20	19
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(90)	47
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(52)	80
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	9	11
Frais d'administration	2	2
Frais d'assurance	-	1
Taxe de vente harmonisée	1	2
	12	16
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(64)	64
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,33)	1,85
Catégorie Revenu	(2,25)	1,96
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	6 193	9 447
Catégorie Revenu	22 072	23 833

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	568	532
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(64)	64
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	16	11
Montant versé au rachat de parts	(110)	(39)
	(94)	(28)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	410	568

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(64)	64
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(20)	(19)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	90	(47)
Produit de la vente de placements	143	86
Achat de placements	(37)	(43)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(18)	(14)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	94	27
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	16	11
Montant versé au rachat de parts	(109)	(40)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(93)	(29)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	3
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	2	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	18 616	Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life (série I)	239 904	290 141	
	13 856	Fonds d'obligations multistratégie Sun Life (série I)	137 183	120 092	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>377 087</b>	<b>410 233</b>	<b>99,97</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				132	0,03
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>410 365</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life</b>				
	11 587 655	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	121 867 559	144 182 879
	375 245	iShares Global Tech ETF	14 606 042	22 793 428
	166 925	iShares Global Healthcare ETF	11 693 984	19 197 856
	282 030	iShares S&P Global Consumer Discretionary Index ETF	9 137 547	11 224 794
	84 202	iShares Global Consumer Staples ETF	4 276 049	6 804 340
<b>Fonds d'obligations multistratégie Sun Life</b>				
	13 155 625	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	135 667 388	118 987 370
	11 107 203	PHN Bond Fund, série O	116 332 984	100 263 611
	7 204 000	Obligation du gouvernement du Canada, 3,0 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	7 051 822	7 071 277
	883 643	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	8 499 910	6 940 221
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		3 730 084

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life	221 675	290	0,1
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	278 401	120	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'actions canadiennes BlackRock Sun Life	250 483	401	0,2
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	167	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	9 371	9 501	22 951	24 489
Parts émises contre trésorerie	948	671	-	-
Parts rachetées	(4 683)	(801)	(1 979)	(1 538)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>5 636</b>	<b>9 371</b>	<b>20 972</b>	<b>22 951</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,02	84	5 636	11,97	2,79	0,24	3,03	9,07
2021	17,19	161	9 371	10,36	2,79	0,25	3,04	9,26
2020	15,35	146	9 501	18,42	2,79	0,26	3,05	9,87
2019	14,21	192	13 530	10,53	2,79	0,26	3,05	9,71
2018	12,35	178	14 439	11,50	2,80	0,26	3,06	9,98
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	15,53	326	20 972	11,97	2,44	0,30	2,74	13,04
2021	17,73	407	22 951	10,36	2,44	0,30	2,74	13,03
2020	15,77	386	24 489	18,42	2,44	0,29	2,73	12,53
2019	14,56	419	28 738	10,53	2,44	0,28	2,72	12,20
2018	12,62	393	31 094	11,50	2,45	0,28	2,73	12,22

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 225	4 079
Trésorerie	3	14
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 229	4 094
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	9	9
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	9	9
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	3 220	4 085
*Placements au coût	2 834	3 064
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	20,79	24,39
Catégorie Revenu	21,69	25,34

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	63	30
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	55
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	73	207
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(624)	143
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(488)	435
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	71	81
Frais d'administration	11	13
Frais d'assurance	5	6
Taxe de vente harmonisée	9	11
	96	111
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(584)	324
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(3,77)	1,85
Catégorie Revenu	(3,69)	2,09
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	70 608	75 504
Catégorie Revenu	85 916	88 119

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	4 085	3 756
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(584)	324
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	35	562
Montant versé au rachat de parts	(316)	(557)
	(281)	5
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 220	4 085

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(584)	324
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(73)	(207)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	624	(143)
Produit de la vente de placements	645	895
Achat de placements	(279)	(801)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(63)	(85)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	270	(17)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	35	562
Montant versé au rachat de parts	(316)	(556)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(281)	6
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(11)	(11)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	14	25
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	3	14
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	73 398	Fonds croissance mondial MFS Sun Life (série I)	1 785 408	2 311 295	
	105 472	Fonds d'obligations multistratégie Sun Life (série I)	1 048 964	914 130	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 834 372</b>	<b>3 225 425</b>	<b>100,17</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(5 633)	(0,17)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 219 792</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds croissance mondial MFS Sun Life</b>				
	137 833	Microsoft Corp.	32 690 626	44 788 301
	359 763	Alphabet Inc.	38 734 739	43 008 942
	99 832	Visa Inc.	23 890 998	28 103 324
	261 673	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	22 384 695	26 446 336
	63 642	Accenture PLC	17 716 178	23 010 218
<b>Fonds d'obligations multistratégie Sun Life</b>				
	13 155 625	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	135 667 388	118 987 370
	11 107 203	PHN Bond Fund, série O	116 332 984	100 263 611
	7 204 000	Obligation du gouvernement du Canada, 3,0 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	7 051 822	7 071 277
	883 643	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	8 499 910	6 940 221
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		3 730 084

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	278 401	914	0,3
Fonds croissance mondial MFS Sun Life	968 417	2 311	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds croissance mondial MFS Sun Life	958 599	2 919	0,3
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	1 160	0,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	75 727	80 693	88 322	83 535
Parts émises contre trésorerie	528	10 677	1 052	13 263
Parts rachetées	(8 566)	(15 643)	(5 805)	(8 476)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>67 689</b>	<b>75 727</b>	<b>83 569</b>	<b>88 322</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	33
2040	-
2041	54
2042	36
<b>Total</b>	<b>123</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	20,79	1 407	67 689	10,07	2,82	0,29	3,11	10,52
2021	24,39	1 847	75 727	22,87	2,82	0,30	3,12	10,77
2020	22,47	1 813	80 693	33,58	2,82	0,30	3,12	10,75
2019	19,79	1 522	76 886	20,85	2,82	0,31	3,13	11,09
2018	16,59	1 221	73 602	22,57	2,82	0,31	3,13	11,28
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	21,69	1 813	83 569	10,07	2,47	0,26	2,73	10,57
2021	25,34	2 238	88 322	22,87	2,47	0,25	2,72	10,46
2020	23,26	1 943	83 535	33,58	2,47	0,24	2,71	9,96
2019	20,41	1 656	81 134	20,85	2,47	0,25	2,72	10,18
2018	17,03	1 254	73 635	22,57	2,47	0,25	2,72	10,45

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	3 382	3 917
Trésorerie	8	8
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	3 390	3 925
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	12	9
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	12	9
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>3 378</b>	<b>3 916</b>
*Placements au coût	2 832	2 892
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	19,46	21,20
Catégorie Revenu	20,23	21,94

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	146	57
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	57
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	114	213
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(475)	126
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(215)	453
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	72	81
Frais d'administration	11	13
Frais d'assurance	4	4
Taxe de vente harmonisée	11	12
	98	110
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(313)</b>	<b>343</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,91)	1,75
Catégorie Revenu	(1,75)	1,88
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	50 525	55 763
Catégorie Revenu	124 046	130 325

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	3 916	3 966
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(313)	343
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	133	252
Montant versé au rachat de parts	(358)	(645)
	(225)	(393)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	3 378	3 916

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(313)	343
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(114)	(213)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	475	(126)
Produit de la vente de placements	671	845
Achat de placements	(351)	(318)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(146)	(114)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	222	417
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	133	252
Montant versé au rachat de parts	(355)	(673)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(222)	(421)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(4)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	8	12
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	8	8
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	74 064	Fonds valeur mondial MFS Sun Life (série I)	1 738 351	2 420 498	
	110 887	Fonds d'obligations multistratégie Sun Life (série I)	1 093 550	961 055	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 831 901</b>	<b>3 381 553</b>	<b>100,11</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(3 550)	(0,11)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>3 378 003</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds valeur mondial MFS Sun Life</b>				
	28 639	Aon PLC	5 102 761	11 646 829
	46 263	Johnson & Johnson	6 882 570	11 073 207
	57 649	JPMorgan Chase & Co	6 237 227	10 474 819
	409 784	UBS Group AG	8 646 978	10 313 617
	88 218	The Charles Schwab Corp.	5 669 244	9 952 212
<b>Fonds d'obligations multistratégie Sun Life</b>				
	13 155 625	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	135 667 388	118 987 370
	11 107 203	Fonds d'obligations PH&N, série O	116 332 984	100 263 611
	7 204 000	Obligation du gouvernement du Canada, 3,0 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	7 051 822	7 071 277
	883 643	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	8 499 910	6 940 221
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		3 730 084

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur mondial MFS Sun Life	464 422	2 421	0,5
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	278 401	961	0,3

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds valeur mondial MFS Sun Life	458 143	2 793	0,6
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	1 124	0,3

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	54 680	59 270	125 636	140 375
Parts émises contre trésorerie	3 440	5 329	3 285	7 047
Parts rachetées	(9 900)	(9 919)	(8 309)	(21 786)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	48 220	54 680	120 612	125 636

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	6
2040	-
2041	23
2042	-
Total	29

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	19,46	939	48 220	14,43	2,82	0,35	3,17	12,50
2021	21,20	1 159	54 680	11,25	2,82	0,32	3,14	11,70
2020	19,43	1 152	59 270	18,42	2,82	0,32	3,14	11,51
2019	18,42	1 403	76 171	17,74	2,82	0,33	3,15	11,78
2018	16,10	1 325	82 259	13,20	2,82	0,32	3,14	11,62
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	20,23	2 439	120 612	14,43	2,47	0,31	2,78	12,70
2021	21,94	2 757	125 636	11,25	2,47	0,31	2,78	12,70
2020	20,04	2 814	140 375	18,42	2,47	0,30	2,77	12,53
2019	18,94	2 904	153 359	17,74	2,47	0,30	2,77	12,44
2018	16,48	2 556	155 099	13,20	2,47	0,30	2,77	12,32

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	5 188	7 406
Trésorerie	12	22
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	5 200	7 428
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	10
Montant à payer pour le rachat de parts	17	17
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	17	27
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>5 183</b>	<b>7 401</b>
*Placements au coût	4 571	5 012
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	24,22	31,87
Catégorie Revenu	25,07	32,87

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	50	51
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	159	473
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 777)	464
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(1 567)	988
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	122	144
Frais d'administration	19	22
Frais d'assurance	7	8
Taxe de vente harmonisée	16	19
	164	193
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(1 731)</b>	<b>795</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(7,87)	3,42
Catégorie Revenu	(7,89)	3,57
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	76 128	79 404
Catégorie Revenu	143 412	146 504

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	7 401	6 430
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 731)	795
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	558	1 025
Montant versé au rachat de parts	(1 045)	(849)
	(487)	176
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	5 183	7 401

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(1 731)	795
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(159)	(473)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 777	(464)
Produit de la vente de placements	1 789	1 564
Achat de placements	(1 149)	(1 542)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(50)	(51)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	477	(171)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	558	1 025
Montant versé au rachat de parts	(1 045)	(847)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(487)	178
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(10)	7
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	22	15
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	12	22
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	69 699	Fonds croissance américain MFS Sun Life (série I)	2 977 100	3 792 086	
	161 117	Fonds d'obligations multistratégie Sun Life (série I)	1 593 402	1 396 399	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>4 570 502</b>	<b>5 188 485</b>	<b>100,10</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(5 159)	(0,10)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>5 183 326</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds croissance américain MFS Sun Life</b>				
	784 286	Microsoft Corp.	172 355 121	254 850 709
	1 276 964	Amazon.com Inc.	204 863 708	145 339 588
	1 210 470	Alphabet Inc.	138 269 246	144 709 250
	792 789	Apple Inc.	121 977 903	139 570 308
	242 025	Mastercard Inc.	86 664 819	114 032 429
<b>Fonds d'obligations multistratégie Sun Life</b>				
	13 155 625	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	135 667 388	118 987 370
	11 107 203	PHN Bond Fund, série O	116 332 984	100 263 611
	7 204 000	Obligation du gouvernement du Canada, 3,0 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	7 051 822	7 071 277
	883 643	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	8 499 910	6 940 221
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		3 730 084

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	278 401	1 396	0,5
Fonds croissance américain MFS Sun Life	2 767 704	3 792	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	2 170	0,6
Fonds croissance américain MFS Sun Life	3 362 362	5 236	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	81 451	79 667	146 210	142 065
Parts émises contre trésorerie	7 748	16 807	13 435	17 903
Parts rachetées	(17 602)	(15 023)	(22 048)	(13 758)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>71 597</b>	<b>81 451</b>	<b>137 597</b>	<b>146 210</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	107
2040	-
2041	142
2042	66
<b>Total</b>	<b>315</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	24,22	1 734	71 597	20,41	2,81	0,29	3,10	10,63
2021	31,87	2 596	81 451	22,82	2,81	0,29	3,10	10,61
2020	28,49	2 270	79 667	39,13	2,81	0,30	3,11	10,96
2019	23,59	2 035	86 247	20,15	2,81	0,31	3,12	11,15
2018	19,65	1 883	95 847	27,08	2,81	0,26	3,07	9,55
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	25,07	3 449	137 597	20,41	2,46	0,26	2,72	10,82
2021	32,87	4 805	146 210	22,82	2,46	0,26	2,72	10,92
2020	29,28	4 160	142 065	39,13	2,46	0,27	2,73	11,06
2019	24,16	3 755	155 458	20,15	2,46	0,28	2,74	11,81
2018	20,04	2 966	148 029	27,08	2,46	0,30	2,76	12,37

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 957	2 365
Trésorerie	-	3
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 957	2 368
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	6	6
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	6	6
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 951	2 362
*Placements au coût	1 537	1 697
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	21,19	22,43
Catégorie Revenu	21,95	23,16

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	46	36
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	132	141
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(248)	165
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(70)	342
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	44	48
Frais d'administration	7	7
Frais d'assurance	3	3
Taxe de vente harmonisée	6	7
	60	65
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(130)	277
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,52)	2,50
Catégorie Revenu	(1,22)	2,65
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	30 959	35 314
Catégorie Revenu	68 259	71 177

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	2 362	2 367
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(130)	277
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	150	186
Montant versé au rachat de parts	(431)	(468)
	(281)	(282)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 951	2 362

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(130)	277
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(132)	(141)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	248	(165)
Produit de la vente de placements	648	576
Achat de placements	(310)	(207)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(46)	(36)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	278	304
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	150	186
Montant versé au rachat de parts	(431)	(492)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(281)	(306)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	3	5
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	-	3
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	36 349	Fonds valeur américain MFS Sun Life (série I)	913 780	1 406 003	
	63 618	Fonds d'obligations multistratégie Sun Life (série I)	622 969	551 374	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 536 749</b>	<b>1 957 377</b>	<b>100,33</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(6 457)	(0,33)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 950 920</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds valeur américain MFS Sun Life</b>				
	253 204	JPMorgan Chase & Co.	40 222 611	46 007 149
	157 762	Johnson & Johnson	30 854 917	37 760 873
	81 572	Cigna Corp.	22 451 731	36 621 908
	43 407	Northrop Grumman Corp.	19 384 342	32 089 879
	452 579	Pfizer Inc.	24 438 711	31 421 687
<b>Fonds d'obligations multistratégie Sun Life</b>				
	13 155 625	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	135 667 388	118 987 370
	11 107 203	PHN Bond Fund, série O	116 332 984	100 263 611
	7 204 000	Obligation du gouvernement du Canada, 3,0 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	7 051 822	7 071 277
	883 643	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	8 499 910	6 940 221
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		3 730 084

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	278 401	551	0,2
Fonds valeur américain MFS Sun Life	1 220 961	1 406	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Fonds d'obligations multistratégie Sun Life	334 155	684	0,2
Fonds valeur américain MFS Sun Life	1 370 193	1 681	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	33 710	42 706	69 328	73 944
Parts émises contre trésorerie	2 682	1 585	4 344	7 198
Parts rachetées	(9 390)	(10 581)	(10 851)	(11 814)
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	27 002	33 710	62 821	69 328

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	19
2040	-
2041	29
2042	-
Total	48

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	21,19	572	27 002	16,97	2,81	0,31	3,12	11,25
2021	22,43	756	33 710	10,59	2,81	0,31	3,12	11,16
2020	19,93	851	42 706	20,93	2,81	0,28	3,09	10,25
2019	19,53	1 008	51 590	20,20	2,81	0,28	3,09	10,32
2018	17,01	902	53 017	13,35	2,81	0,26	3,07	9,49
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	21,95	1 379	62 821	16,97	2,46	0,29	2,75	12,01
2021	23,16	1 606	69 328	10,59	2,46	0,29	2,75	11,88
2020	20,50	1 516	73 944	20,93	2,46	0,28	2,74	11,50
2019	20,02	1 630	81 425	20,20	2,46	0,28	2,74	11,64
2018	17,38	1 492	85 833	13,35	2,46	0,28	2,74	11,73

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

## États financiers

### États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	19 906	24 637
Trésorerie	24	37
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	58	58
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	19 988	24 732
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	52	47
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	52	47
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>19 936</b>	<b>24 685</b>
*Placements au coût	21 521	22 184
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	17,21	19,44
Catégorie Revenu	17,87	20,11
Catégorie GPP	22,82	25,09

### États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	181	263
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 673	2 110
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	41	511
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 068)	435
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(2 172)	3 319
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	345	405
Frais d'administration	45	53
Frais d'assurance	27	33
Taxe de vente harmonisée	43	52
	460	543
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(2 632)</b>	<b>2 776</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,33)	2,00
Catégorie Revenu	(2,28)	2,10
Catégorie GPP	(2,37)	3,15
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	501 977	569 227
Catégorie Revenu	434 716	467 377
Catégorie GPP	198 021	209 577

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	24 685	23 975
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 632)	2 776
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	743	2 678
Montant versé au rachat de parts	(2 860)	(4 744)
	(2 117)	(2 066)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	19 936	24 685

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(2 632)	2 776
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(41)	(511)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 068	(435)
Produit de la vente de placements	2 918	3 487
Achat de placements	(360)	(914)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 854)	(2 373)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	2 099	2 030
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	743	2 678
Montant versé au rachat de parts	(2 855)	(4 742)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(2 112)	(2 064)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(13)	(34)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	37	71
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	24	37
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	1 664 621	Série Portefeuilles croissance équilibrée CI (série I)	21 521 268	19 906 036	99,85
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>21 521 268</b>	<b>19 906 036</b>	<b>99,85</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				29 734	0,15
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>19 935 770</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
20 624 205	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	211 437 297	189 800 434	
7 712 890	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	87 846 677	96 356 364	
4 674 994	Fonds d'actions internationales CI (série I)	93 183 610	87 531 306	
5 434 891	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	91 584 823	87 043 582	
4 028 787	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	76 165 823	84 702 024	
3 512 106	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	84 723 136	82 192 053	
8 321 149	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	79 175 507	75 945 462	
9 731 629	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	83 370 004	75 192 408	
3 935 890	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	65 821 649	69 235 849	
2 469 630	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	60 741 811	58 653 713	
2 275 972	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	50 716 261	54 646 088	
5 095 150	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	48 941 877	48 505 828	
2 139 496	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	45 093 213	48 106 356	
1 346 938	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	48 251 994	47 063 348	
3 995 567	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	43 497 006	40 880 242	
1 641 728	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	42 856 640	40 443 969	
998 786	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	37 573 487	37 041 294	
860 941	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	33 162 815	36 697 590	
1 090 462	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	36 508 558	36 639 523	
1 674 825	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	36 926 291	36 276 720	
3 143 810	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	32 233 458	31 123 719	
	Trésorerie et équivalents de trésorerie		29 615 838	
764 698	iShares China Large-Cap ETF	26 688 722	29 301 851	
1 367 017	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	29 578 346	27 244 649	
97 435	FNB VanEck Semiconductor	32 940 139	26 773 263	

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	1 678 721	19 906	1,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	2 027 888	24 637	1,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	532 715	629 936	452 510	466 901
Parts émises contre trésorerie	21 923	68 489	20 267	55 010
Parts rachetées	(94 188)	(165 710)	(44 499)	(69 401)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>460 450</b>	<b>532 715</b>	<b>428 278</b>	<b>452 510</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	208 400	207 269
Parts émises contre trésorerie	41	15 234
Parts rachetées	(17 375)	(14 103)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>191 066</b>	<b>208 400</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	120
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>120</b>

---

---

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	17,21	7 923	460 450	10,43	2,60	0,29	2,89	11,04
2021	19,44	10 355	532 715	13,38	2,60	0,29	2,89	11,23
2020	17,48	11 011	629 936	1,99	2,60	0,29	2,89	11,34
2019	16,45	12 518	761 178	7,93	2,60	0,29	2,89	11,21
2018	14,48	12 553	866 911	16,20	2,60	0,29	2,89	11,21
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	17,87	7 654	428 278	10,43	2,29	0,21	2,50	9,33
2021	20,11	9 102	452 510	13,38	2,29	0,22	2,51	9,46
2020	18,02	8 414	466 901	1,99	2,29	0,21	2,50	9,34
2019	16,89	8 378	496 157	7,93	2,29	0,22	2,51	9,66
2018	14,81	7 731	522 185	16,20	2,29	0,23	2,52	9,86
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	22,82	4 359	191 066	10,43	0,15	0,02	0,17	12,70
2021	25,09	5 228	208 400	13,38	0,15	0,02	0,17	12,90
2020	21,95	4 550	207 269	1,99	0,15	0,02	0,17	12,90
2019	20,09	4 216	209 814	7,93	0,15	0,02	0,17	12,26
2018	17,21	4 392	255 144	16,20	0,15	0,02	0,17	12,30

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	49 203	66 565
Trésorerie	48	225
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	115	134
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	49 366	66 924
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	103	101
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	103	101
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>49 263</b>	<b>66 823</b>
*Placements au coût	52 656	60 622
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	16,01	18,00
Catégorie Revenu	16,61	18,61
Catégorie GPP	21,23	23,24

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	591	806
Distribution de gains en capital provenant des placements	3 117	4 936
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	319	1 255
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(9 396)	877
Autres revenus		
Intérêts	2	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(5 367)	7 874
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	889	1 107
Frais d'administration	108	135
Frais d'assurance	85	107
Taxe de vente harmonisée	124	154
	1 206	1 503
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(6 573)</b>	<b>6 371</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,10)	1,54
Catégorie Revenu	(2,09)	1,64
Catégorie GPP	(2,16)	2,53
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	1 673 995	1 978 286
Catégorie Revenu	932 662	1 080 445
Catégorie GPP	515 668	612 633

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	66 823	65 544
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(6 573)	6 371
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	2 829	5 806
Montant versé au rachat de parts	(13 816)	(10 898)
	(10 987)	(5 092)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	49 263	66 823

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(6 573)	6 371
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(319)	(1 255)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	9 396	(877)
Produit de la vente de placements	12 591	9 570
Achat de placements	(579)	(2 890)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(3 708)	(5 742)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	10 808	5 177
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	2 829	5 807
Montant versé au rachat de parts	(13 814)	(10 896)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(10 985)	(5 089)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(177)	88
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	225	137
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	48	225
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	2	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	1 779 733	Série Portefeuilles équilibrée CI (série I)	52 655 511	49 202 509	99,88
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>52 655 511</b>	<b>49 202 509</b>	<b>99,88</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				60 946	0,12
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>49 263 455</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
51 157 407	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	515 632 730	470 791 383	
24 104 918	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	214 332 579	186 249 059	
20 366 925	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	205 965 808	185 884 852	
12 391 651	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	135 108 353	155 707 290	
7 422 036	Fonds d'actions internationales CI (série I)	145 652 129	138 965 016	
8 612 225	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	145 683 815	137 930 812	
6 368 754	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	120 401 965	133 897 949	
5 565 355	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	115 181 771	130 243 222	
12 639 457	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	121 409 349	120 327 631	
6 167 791	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	103 608 992	108 496 995	
3 865 495	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	93 984 678	91 805 506	
3 606 515	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	81 262 101	86 592 425	
7 978 144	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	83 829 218	78 983 626	
3 390 040	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	72 424 468	76 224 707	
2 134 749	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	74 888 557	74 590 259	
465 327	iShares TIPS Bond ETF	74 738 016	67 062 816	
6 331 001	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	68 914 191	64 775 000	
2 601 420	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	67 827 086	64 085 982	
1 582 697	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	59 782 266	58 696 383	
1 364 126	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	50 543 227	58 145 889	
1 727 938	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	58 645 117	58 058 717	
2 653 963	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	57 495 477	57 484 845	
4 280 495	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	56 503 032	54 111 816	
	Trésorerie et équivalents de trésorerie		54 071 017	
1 212 104	iShares China Large-Cap ETF	42 722 953	46 445 643	

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles équilibrée CI	3 119 099	49 203	1,6

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles équilibrée CI	4 169 872	66 565	1,6

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 861 671	2 048 924	1 035 277	1 085 396
Parts émises contre trésorerie	89 657	175 805	70 511	75 881
Parts rachetées	(424 273)	(363 058)	(215 322)	(126 000)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 527 055</b>	<b>1 861 671</b>	<b>890 466</b>	<b>1 035 277</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	603 909	644 255
Parts émises contre trésorerie	7 212	65 819
Parts rachetées	(139 114)	(106 165)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>472 007</b>	<b>603 909</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	128
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>128</b>

---

---

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	16,01	24 447	1 527 055	7,91	2,58	0,30	2,88	11,73
2021	18,00	33 519	1 861 671	12,84	2,58	0,30	2,88	11,77
2020	16,48	33 775	2 048 924	3,64	2,58	0,30	2,88	11,78
2019	15,69	37 283	2 376 635	8,61	2,58	0,31	2,89	11,83
2018	13,99	35 957	2 569 833	12,28	2,58	0,30	2,88	11,80
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	16,61	14 794	890 466	7,91	2,27	0,25	2,52	10,89
2021	18,61	19 271	1 035 277	12,84	2,27	0,24	2,51	10,74
2020	16,98	18 430	1 085 396	3,64	2,27	0,25	2,52	10,97
2019	16,10	18 771	1 165 962	8,61	2,27	0,26	2,53	11,37
2018	14,31	17 473	1 221 292	12,28	2,27	0,26	2,53	11,57
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	21,23	10 022	472 007	7,91	0,15	0,01	0,16	9,30
2021	23,24	14 033	603 909	12,84	0,15	0,01	0,16	9,33
2020	20,71	13 339	644 255	3,64	0,15	0,01	0,16	9,25
2019	19,17	12 975	676 805	8,61	0,15	0,02	0,17	10,29
2018	16,64	14 114	848 176	12,28	0,15	0,02	0,17	10,35

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	28 322	33 651
Trésorerie	7	48
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	94	61
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	28 423	33 760
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	52	45
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	52	45
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>28 371</b>	<b>33 715</b>
*Placements au coût	31 743	32 128
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,17	16,94
Catégorie Revenu	15,72	17,49
Catégorie GPP	20,07	21,81

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	758	421
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 657	2 484
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(158)	886
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 944)	(375)
Autres revenus		
Intérêts	2	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(2 685)	3 416
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	460	545
Frais d'administration	60	71
Frais d'assurance	42	53
Taxe de vente harmonisée	62	75
	624	744
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(3 309)</b>	<b>2 672</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,87)	1,12
Catégorie Revenu	(1,75)	1,20
Catégorie GPP	(1,77)	1,97
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	872 472	1 043 790
Catégorie Revenu	538 810	538 062
Catégorie GPP	415 368	437 961

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	33 715	36 144
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 309)	2 672
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	4 499	5 267
Montant versé au rachat de parts	(6 534)	(10 368)
	(2 035)	(5 101)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	28 371	33 715

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 309)	2 672
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	158	(886)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 944	375
Produit de la vente de placements	4 904	9 068
Achat de placements	(2 295)	(3 301)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(2 415)	(2 905)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	1 987	5 023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	4 499	5 296
Montant versé au rachat de parts	(6 527)	(10 372)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(2 028)	(5 076)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(41)	(53)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	48	101
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	7	48
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	2	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	2 559 157	Série Portefeuilles équilibrée prudente CI (série I)	31 743 093	28 321 932	99,83
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>31 743 093</b>	<b>28 321 932</b>	<b>99,83</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				48 660	0,17
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>28 370 592</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
18 859 348	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	189 874 496	173 558 804	
7 508 614	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	75 089 235	68 529 618	
8 867 353	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	79 228 636	68 514 492	
4 659 035	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	44 752 749	44 354 013	
3 017 889	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	33 972 512	37 921 287	
1 809 912	Fonds d'actions internationales CI (série I)	35 047 855	33 887 525	
2 097 086	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	34 853 326	33 586 294	
1 542 245	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	29 206 254	32 424 469	
1 360 925	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	27 579 074	31 849 038	
2 934 731	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	30 605 757	29 053 837	
1 502 085	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	23 505 995	26 423 035	
172 742	iShares TIPS Bond ETF	27 378 249	24 895 536	
939 286	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	22 877 187	22 308 043	
878 369	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	19 688 366	21 089 640	
1 590 110	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	20 724 018	20 101 358	
825 652	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	17 698 267	18 564 708	
519 908	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	17 889 241	18 166 090	
	Trésorerie et équivalents de trésorerie		16 948 267	
1 541 923	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	16 778 364	15 776 033	
633 556	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 473 936	15 607 652	
1 482 973	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	14 975 539	14 884 748	
1 962 850	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	16 008 915	14 666 218	
385 439	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	14 553 712	14 294 520	
332 226	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	14 275 413	14 161 126	
420 836	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	14 165 701	14 140 090	

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	918 691	28 322	3,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	1 038 170	33 651	3,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	952 381	1 093 284	485 966	596 554
Parts émises contre trésorerie	114 852	178 081	136 409	16 359
Parts rachetées	(286 445)	(318 984)	(85 884)	(126 947)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>780 788</b>	<b>952 381</b>	<b>536 491</b>	<b>485 966</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	416 584	459 013
Parts émises contre trésorerie	22 352	98 024
Parts rachetées	(35 552)	(140 453)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>403 384</b>	<b>416 584</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,17	11 842	780 788	15,44	2,60	0,29	2,89	11,03
2021	16,94	16 128	952 381	17,48	2,60	0,29	2,89	11,06
2020	15,83	17 311	1 093 284	7,70	2,60	0,28	2,88	10,90
2019	15,05	19 275	1 280 801	7,39	2,60	0,29	2,89	11,02
2018	13,58	19 658	1 447 099	8,33	2,60	0,29	2,89	10,97
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	15,72	8 432	536 491	15,44	2,29	0,26	2,55	11,46
2021	17,49	8 500	485 966	17,48	2,29	0,27	2,56	11,62
2020	16,30	9 724	596 554	7,70	2,29	0,27	2,56	11,64
2019	15,44	9 926	642 812	7,39	2,29	0,27	2,56	11,67
2018	13,89	9 883	711 403	8,33	2,29	0,27	2,56	11,93
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	20,07	8 097	403 384	15,44	0,15	0,01	0,16	8,54
2021	21,81	9 087	416 584	17,48	0,15	0,01	0,16	9,32
2020	19,84	9 109	459 013	7,70	0,15	0,01	0,16	9,21
2019	18,36	10 309	561 540	7,39	0,15	0,01	0,16	9,75
2018	16,13	11 431	708 854	8,33	0,15	0,01	0,16	9,66

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	23 922	33 104
Trésorerie	115	107
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	38	34
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	101
	24 076	33 346
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	92
Montant à payer pour le rachat de parts	33	30
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	33	122
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>24 043</b>	<b>33 224</b>
*Placements au coût	27 288	32 136
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	14,02	15,77
Catégorie Revenu	14,46	16,21
Catégorie GPP	18,35	20,10

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	708	566
Distribution de gains en capital provenant des placements	1 221	1 707
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(384)	373
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 334)	100
Autres revenus		
Intérêts	1	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(2 788)	2 746
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	388	502
Frais d'administration	47	60
Frais d'assurance	41	53
Taxe de vente harmonisée	49	63
	525	678
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(3 313)</b>	<b>2 068</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,84)	0,80
Catégorie Revenu	(1,86)	0,87
Catégorie GPP	(1,97)	1,49
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	1 079 534	1 325 471
Catégorie Revenu	205 059	231 100
Catégorie GPP	476 399	544 622

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	33 224	35 262
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 313)	2 068
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	2 422	3 880
Montant versé au rachat de parts	(8 290)	(7 986)
	(5 868)	(4 106)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	24 043	33 224

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(3 313)	2 068
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	384	(373)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 334	(100)
Produit de la vente de placements	6 975	6 099
Achat de placements	(678)	(1 202)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 929)	(2 273)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	5 773	4 219
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	2 522	3 779
Montant versé au rachat de parts	(8 287)	(7 987)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(5 765)	(4 208)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8	11
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	107	96
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	115	107
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	1	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	1 875 808	Série Portefeuilles prudente CI (série I)	27 287 608	23 921 994	99,50
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>27 287 608</b>	<b>23 921 994</b>	<b>99,50</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				121 028	0,50
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>24 043 022</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
25 641 401	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	259 048 682	235 972 687	
10 208 782	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	101 954 435	93 173 508	
12 041 983	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	108 849 190	93 043 587	
6 334 567	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	60 847 214	60 305 078	
3 985 465	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	42 665 814	39 456 104	
240 693	iShares TIPS Bond ETF	38 025 956	34 688 617	
2 703 784	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	30 115 360	33 974 394	
1 622 392	Fonds d'actions internationales CI (série I)	31 227 305	30 376 538	
1 878 626	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	31 901 150	30 087 507	
1 392 662	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	26 487 050	29 279 598	
1 214 311	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	24 596 836	28 417 915	
2 135 247	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	28 044 511	26 992 696	
1 345 763	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	22 530 398	23 673 175	
2 054 082	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	20 742 781	20 617 025	
2 691 425	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	22 074 874	20 110 059	
843 784	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	20 965 156	20 039 870	
786 936	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	17 193 242	18 894 333	
	Trésorerie et équivalents de trésorerie		16 773 836	
739 733	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	15 988 445	16 632 812	
465 789	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	15 736 777	16 275 126	
1 381 471	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 090 342	14 134 386	
567 642	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	14 764 293	13 983 861	
345 302	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	13 055 228	12 805 974	
297 596	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	12 788 109	12 685 035	
377 045	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	12 856 905	12 668 712	

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles prudente CI	1 037 948	23 922	2,3

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles prudente CI	1 310 875	33 104	2,5

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 197 114	1 413 681	219 775	264 486
Parts émises contre trésorerie	122 116	162 695	20 611	11 596
Parts rachetées	(337 652)	(379 262)	(60 343)	(56 307)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>981 578</b>	<b>1 197 114</b>	<b>180 043</b>	<b>219 775</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	536 470	539 307
Parts émises contre trésorerie	17 776	60 966
Parts rachetées	(136 088)	(63 803)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>418 158</b>	<b>536 470</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

---

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

---

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

---

---

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	14,02	13 764	981 578	9,18	2,53	0,27	2,80	10,59
2021	15,77	18 877	1 197 114	10,34	2,53	0,26	2,79	10,44
2020	14,98	21 171	1 413 681	6,93	2,53	0,27	2,80	10,49
2019	14,23	23 483	1 649 791	11,87	2,53	0,27	2,80	10,52
2018	12,99	23 377	1 799 914	15,67	2,53	0,26	2,79	10,23
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	14,46	2 604	180 043	9,18	2,27	0,21	2,48	9,26
2021	16,21	3 562	219 775	10,34	2,27	0,22	2,49	9,73
2020	15,35	4 059	264 486	6,93	2,27	0,20	2,47	8,96
2019	14,54	3 824	262 967	11,87	2,27	0,21	2,48	9,37
2018	13,23	3 370	254 779	15,67	2,27	0,21	2,48	9,35
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	18,35	7 675	418 158	9,18	0,15	0,01	0,16	9,57
2021	20,10	10 785	536 470	10,34	0,15	0,01	0,16	9,74
2020	18,60	10 032	539 307	6,93	0,15	0,01	0,16	9,37
2019	17,22	9 868	573 100	11,87	0,15	0,01	0,16	9,05
2018	15,30	9 896	646 638	15,67	0,15	0,01	0,16	8,82

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 511	2 103
Trésorerie	8	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	-
	1 520	2 104
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	1	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	1	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>1 519</b>	<b>2 104</b>
*Placements au coût	1 637	1 869
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,50	20,83
Catégorie GPP	24,78	27,12

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	27	15
Distribution de gains en capital provenant des placements	162	171
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1)	46
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(360)	43
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(172)	275
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	32	32
Frais d'administration	4	4
Frais d'assurance	7	7
Taxe de vente harmonisée	4	5
	47	48
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(219)</b>	<b>227</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,38)	2,32
Catégorie GPP	(2,79)	3,73
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	82 875	78 077
Catégorie GPP	7 932	12 323

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	2 104	1 728
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(219)	227
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	35	440
Montant versé au rachat de parts	(401)	(291)
	(366)	149
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 519	2 104

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(219)	227
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1	(46)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	360	(43)
Produit de la vente de placements	439	297
Achat de placements	(18)	(403)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(189)	(186)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	374	(154)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	34	440
Montant versé au rachat de parts	(401)	(291)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(367)	149
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	7	(5)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	6
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	8	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	82 254	Série Portefeuilles croissance CI (série I)	1 636 888	1 511 047	99,47
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 636 888</b>	<b>1 511 047</b>	<b>99,47</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				8 001	0,53
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 519 048</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	8 018 124	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	81 550 353	73 789 194
	5 087 570	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	59 852 433	63 558 506
	3 078 832	Fonds d'actions internationales CI (série I)	60 677 965	57 645 896
	3 584 907	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	60 537 726	57 414 796
	2 658 391	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	50 343 591	55 890 546
	2 316 742	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	55 879 588	54 217 547
	2 567 708	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	43 389 098	45 168 296
	1 675 158	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	40 912 567	39 785 003
	1 501 317	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	31 962 502	36 046 621
	1 411 297	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	29 783 022	31 732 870
	888 453	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	31 862 306	31 043 453
	3 213 976	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	30 548 354	29 333 319
	3 730 741	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	31 819 107	28 825 941
	2 635 631	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	28 691 822	26 966 196
	1 082 733	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	27 979 572	26 673 127
	658 898	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	24 784 578	24 436 078
	568 022	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	20 930 648	24 211 917
	719 316	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	24 014 348	24 169 018
	1 104 811	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	24 346 834	23 930 208
	504 429	iShares China Large-Cap ETF	17 848 870	19 328 811
	1 999 303	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	19 204 465	19 033 365
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		18 900 365
	901 738	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	19 145 204	17 971 638
	64 283	FNB VanEck Semiconductor	19 934 332	17 663 732
	1 955 827	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	11 423 732	15 431 475

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance CI	967 252	1 511	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance CI	1 120 583	2 103	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	85 122	83 335	12 206	8 087
Parts émises contre trésorerie	1 850	16 408	-	4 394
Parts rachetées	(4 882)	(14 621)	(12 181)	(275)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>82 090</b>	<b>85 122</b>	<b>25</b>	<b>12 206</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	14
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>14</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,50	1 518	82 090	11,87	2,70	0,27	2,97	9,94
2021	20,83	1 773	85 122	15,89	2,70	0,28	2,98	10,25
2020	18,47	1 539	83 335	3,13	2,70	0,27	2,97	10,08
2019	17,26	1 990	115 313	7,45	2,70	0,26	2,96	9,81
2018	14,97	1 788	119 530	13,33	2,70	0,27	2,97	10,05
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	24,78	1	25	11,87	0,15	0,01	0,16	5,63
2021	27,12	331	12 206	15,89	0,15	0,01	0,16	5,95
2020	23,38	189	8 087	3,13	0,15	0,01	0,16	5,93
2019	21,24	176	8 281	7,45	0,15	0,01	0,16	5,92
2018	17,91	152	8 462	13,33	0,15	0,01	0,16	8,99

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	51 036	61 378
Trésorerie	258	279
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	63	64
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	51 357	61 721
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	55	51
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	55	51
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>51 302</b>	<b>61 670</b>
*Placements au coût	52 510	56 672
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	12,95	14,50
Catégorie Revenu	13,29	14,85
Catégorie GPP	16,80	18,34

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	1 175	1 637
Distribution de gains en capital provenant des placements	789	892
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(712)	594
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(6 180)	1 245
Autres revenus		
Intérêts	3	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(4 925)	4 368
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	552	677
Frais d'administration	56	69
Frais d'assurance	34	46
Taxe de vente harmonisée	69	85
	711	877
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(5 636)</b>	<b>3 491</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,62)	0,60
Catégorie Revenu	(1,55)	0,64
Catégorie GPP	(1,55)	1,20
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	1 307 317	1 552 549
Catégorie Revenu	568 214	638 847
Catégorie GPP	1 695 637	1 795 637

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	61 670	66 870
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(5 636)	3 491
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	4 339	4 568
Montant versé au rachat de parts	(9 071)	(13 259)
	(4 732)	(8 691)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	51 302	61 670

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(5 636)	3 491
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	712	(594)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	6 180	(1 245)
Produit de la vente de placements	32 932	11 789
Achat de placements	(27 517)	(2 088)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(1 964)	(2 529)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	4 707	8 824
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	4 339	4 568
Montant versé au rachat de parts	(9 067)	(13 265)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(4 728)	(8 697)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(21)	127
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	279	152
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	258	279
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	3	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS SOUS-JACENT(S)</b>					
	2 486 302	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	23 455 034	22 880 941	
	2 969 394	Série Portefeuilles de revenu CI (série I)	29 055 182	28 155 197	
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>52 510 216</b>	<b>51 036 138</b>	<b>99,48</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				265 989	0,52
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>51 302 127</b>	<b>100,00</b>

## Les 5 principaux titres de chaque fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
<b>Fonds d'obligations canadiennes CI</b>				
	313 805 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	312 256 991	306 699 112
	202 162 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	186 204 206	185 332 933
	178 260 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	153 642 708	135 537 715
	71 906 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	80 954 148	74 617 866
	74 570 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	73 373 036	73 196 159
<b>Série Portefeuilles de revenu CI</b>				
	24 285 718	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	252 484 078	223 496 609
	27 028 497	Fonds de revenu CI (série I)	221 973 491	193 799 732
	15 500 233	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	155 636 453	141 467 528
	18 245 181	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	162 204 986	140 973 216
	8 583 694	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	82 451 434	81 716 767

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles de revenu CI	1 799 045	28 155	1,6
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 478 738	22 881	0,7

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles de revenu CI	2 238 723	61 378	2,7

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 453 049	1 707 028	594 647	683 564
Parts émises contre trésorerie	139 098	209 789	75 899	24 999
Parts rachetées	(389 959)	(463 768)	(94 589)	(113 916)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 202 188</b>	<b>1 453 049</b>	<b>575 957</b>	<b>594 647</b>

	Catégorie GPP	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	1 732 186	1 952 853
Parts émises contre trésorerie	85 515	70 715
Parts rachetées	(146 591)	(291 382)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>1 671 110</b>	<b>1 732 186</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

Notes des états financiers propres au Fonds

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	12,95	15 573	1 202 188	54,68	2,44	0,28	2,72	11,38
2021	14,50	21 075	1 453 049	7,36	2,45	0,28	2,73	11,26
2020	13,90	23 724	1 707 028	8,96	2,45	0,28	2,73	11,37
2019	13,52	26 132	1 932 785	6,37	2,45	0,28	2,73	11,27
2018	12,57	27 165	2 161 044	7,53	2,45	0,28	2,73	11,24
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	13,29	7 656	575 957	54,68	2,24	0,23	2,47	10,36
2021	14,85	8 831	594 647	7,36	2,24	0,23	2,47	10,20
2020	14,19	9 701	683 564	8,96	2,24	0,23	2,47	10,05
2019	13,77	10 245	744 028	6,37	2,24	0,22	2,46	9,81
2018	12,77	9 498	743 842	7,53	2,24	0,22	2,46	9,73
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	16,80	28 073	1 671 110	54,68	0,15	0,01	0,16	7,19
2021	18,34	31 764	1 732 186	7,36	0,15	0,01	0,16	7,51
2020	17,13	33 445	1 952 853	8,96	0,15	0,01	0,16	7,53
2019	16,24	34 387	2 117 520	6,37	0,15	0,01	0,16	7,46
2018	14,72	35 184	2 390 810	7,53	0,15	0,01	0,16	7,45

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2

(auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	888	1 102
Trésorerie	3	4
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	891	1 106
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>891</b>	<b>1 106</b>
*Placements au coût	885	937
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	19,99	22,53
Catégorie GPP	28,57	31,27

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	2	12
Distribution de gains en capital provenant des placements	57	93
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	14	59
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(162)	34
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(89)	198
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	19	24
Frais d'administration	3	4
Frais d'assurance	5	7
Taxe de vente harmonisée	2	3
	29	38
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(118)</b>	<b>160</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,59)	2,86
Catégorie GPP	(2,72)	4,69
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	45 636	55 820
Catégorie GPP	58	59

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 106	1 111
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(118)	160
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	22	71
Montant versé au rachat de parts	(119)	(236)
	(97)	(165)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	891	1 106

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(118)	160
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(14)	(59)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	162	(34)
Produit de la vente de placements	140	263
Achat de placements	(15)	(59)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(59)	(105)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	96	166
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	22	71
Montant versé au rachat de parts	(119)	(236)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(97)	(165)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	4	3
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	3	4
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	57 740	Série Portefeuilles croissance maximale CI (série I)	884 813	887 712	99,61
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>884 813</b>	<b>887 712</b>	<b>99,61</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 434	0,39
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>891 146</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	2 740 248	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	32 034 075	34 233 649
	1 653 982	Fonds d'actions internationales CI (série I)	33 086 664	30 967 993
	1 930 620	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	32 197 815	30 920 223
	1 417 009	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	27 638 721	29 791 480
	1 247 784	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	30 094 953	29 201 267
	1 382 904	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	23 098 025	24 326 528
	859 628	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	20 797 225	20 416 165
	808 639	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	17 271 275	19 415 422
	760 159	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	15 927 944	17 092 090
	478 641	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	17 801 915	16 724 198
	1 419 831	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 466 958	14 526 862
	583 367	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	14 840 311	14 371 246
	354 881	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	13 358 583	13 161 233
	305 878	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	11 563 051	13 038 034
	387 457	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	13 088 334	13 018 555
	592 646	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	13 080 143	12 836 714
	271 631	iShares China Large-Cap ETF	9 695 915	10 408 411
	485 718	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	10 479 199	9 680 360
	34 605	FNB VanEck Semiconductor Trésorerie et équivalents de trésorerie	10 829 427	9 508 788 8 659 051
	1 053 588	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	6 311 097	8 312 809
	476 405	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	7 793 667	7 455 738
	319 101	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	8 249 942	6 833 548
	28 074	iShares Russell 1000 Value ETF	5 703 194	5 764 550
	125 857	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	5 121 911	4 901 294

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) de CI Investments Inc., y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance maximale CI	415 498	888	0,2

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Série Portefeuilles croissance maximale CI	481 126	1 102	0,2

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie GPP	
	2022	2021	2022	2021
Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice	49 019	56 349	59	59
Parts émises contre trésorerie	1 048	3 384	-	-
Parts rachetées	(5 568)	(10 714)	(1)	-
Nombre de parts à la clôture de l'exercice	44 499	49 019	58	59

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	13
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>13</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	19,99	889	44 499	8,00	2,85	0,28	3,13	9,71
2021	22,53	1 104	49 019	13,69	2,85	0,28	3,13	9,86
2020	19,70	1 109	56 349	11,59	2,85	0,30	3,15	10,46
2019	18,38	961	52 279	8,49	2,85	0,31	3,16	10,75
2018	15,70	872	55 522	8,91	2,85	0,31	3,16	10,93
<b>Catégorie GPP</b>								
2022	28,57	2	58	8,00	0,15	0,02	0,17	13,00
2021	31,27	2	59	13,69	0,15	0,02	0,17	13,00
2020	26,54	2	59	11,59	0,15	0,01	0,16	5,00
2019	22,86	863	37 750	8,49	0,15	0,01	0,16	5,00
2018	18,95	748	39 490	8,91	0,15	0,01	0,16	5,00

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	2 052	2 447
Trésorerie	9	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	1	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 062	2 449
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	6	6
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	6	6
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>2 056</b>	<b>2 443</b>
*Placements au coût	2 029	2 046
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	16,98	19,60
Catégorie Revenu	17,46	20,11

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	105	48
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	94
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	10	101
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(378)	42
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(263)	285
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	46	54
Frais d'administration	7	8
Frais d'assurance	2	2
Taxe de vente harmonisée	5	6
	60	70
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(323)</b>	<b>215</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,58)	1,63
Catégorie Revenu	(2,67)	1,66
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	39 441	40 880
Catégorie Revenu	82 576	89 106

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	2 443	2 636
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(323)	215
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	73	136
Montant versé au rachat de parts	(137)	(544)
	(64)	(408)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	2 056	2 443

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(323)	215
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(10)	(101)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	378	(42)
Produit de la vente de placements	149	585
Achat de placements	(17)	(112)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(105)	(142)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	72	403
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	73	136
Montant versé au rachat de parts	(137)	(544)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(64)	(408)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8	(5)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	6
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	9	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	145 312	Portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life (série I)	2 028 984	2 052 189	99,83
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 028 984</b>	<b>2 052 189</b>	<b>99,83</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				3 518	0,17
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>2 055 707</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	18 502 547	Fonds Complément tactique Granite Sun Life, série I	179 799 562	147 852 007
	14 586 457	PHN Bond Fund, série O	152 671 450	131 670 485
	246 592	iShares Core S&P 500 ETF	116 001 443	128 372 983
	11 164 926	Fonds d'actions internationales JPMorgan Sun Life, série I	115 346 253	120 822 365
	11 421 738	Mandat privé d'actifs réels Sun Life, série I	106 640 784	112 288 247
	9 322 492	Fonds mondial d'actions à moyenne capitalisation Schroder Sun Life, série I	111 648 877	111 139 958
	8 919 910	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	101 039 461	110 988 658
	2 771 289	Fonds valeur américain MFS Sun Life, série I	89 508 680	107 195 400
	1 884 722	Fonds croissance américain MFS Sun Life, série I	101 425 779	102 541 113
	1 939 639	Catégorie Actions Canadiennes IG Beutel Goodman, série I	78 016 317	83 828 475
	1 149 512	Fonds d'actions canadiennes MFS Sun Life, série I	60 771 517	74 062 012
	6 272 251	Fonds marchés émergents Schroder Sun Life, série I	78 284 894	67 505 729
	8 052 822	Fonds de titres à revenus fixes américains de base Sun Life, série I	80 606 274	63 715 542
	2 208 865	Fonds valeur international MFS Sun Life, série I	52 163 429	58 653 311
	2 969 310	Fonds occasions internationales MFS Sun Life, série I	52 566 800	57 063 607
	5 924 255	Fonds d'obligations de marchés Émergents RBC (couvert en \$ CA), série O	53 510 515	40 169 412
	4 048 279	Fonds d'obligations à rendement élevé RBC, série O	41 102 702	37 272 500
	4 528 271	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	44 240 607	35 565 494
	3 558 604	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	32 239 501	32 186 151
	3 133 217	Fonds du marché monétaire Sun Life, série I	31 332 168	31 332 168
	3 833 249	Fonds de revenu flexible NWQ Sun Life, série I	36 307 536	30 106 721
	82 099	ABSL Umbrella UCITS Fund, catégorie E	13 599 655	21 984 151
	1 291 866	Mandat privé de titres de créance spécialisés Crescent Sun Life, série I	12 914 332	12 675 397
	1 311 928	Mandat privé de titres de créance de base Advantage Sun Life, série I	12 937 564	11 097 338
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		5 112 312

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life	1 746 493	2 052	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life	2 050 545	2 447	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	38 639	47 172	83 854	97 192
Parts émises contre trésorerie	1 099	145	3 124	6 705
Parts rachetées	(103)	(8 678)	(7 799)	(20 043)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>39 635</b>	<b>38 639</b>	<b>79 179</b>	<b>83 854</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	4
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>4</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	16,98	673	39 635	5,67	2,84	0,17	3,01	6,22
2021	19,60	757	38 639	10,20	2,84	0,20	3,04	7,27
2020	17,98	848	47 172	7,71	2,84	0,18	3,02	6,62
2019	16,92	1 036	61 229	9,38	2,83	0,26	3,09	9,58
2018	14,93	2 044	136 981	13,66	2,83	0,18	3,01	6,51
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	17,46	1 383	79 179	5,67	2,54	0,26	2,80	10,54
2021	20,11	1 686	83 854	10,20	2,54	0,26	2,80	10,67
2020	18,40	1 788	97 192	7,71	2,54	0,26	2,80	10,52
2019	17,28	1 754	101 450	9,38	2,53	0,26	2,79	10,61
2018	15,19	1 597	105 077	13,66	2,53	0,26	2,79	10,71

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	4 931	6 376
Trésorerie	8	4
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	4 939	6 380
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	13	12
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	13	12
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>4 926</b>	<b>6 368</b>
*Placements au coût	5 045	5 527
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15,48	17,91
Catégorie Revenu	15,97	18,42

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	243	133
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	238
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	31	181
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(963)	88
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(689)	640
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	114	139
Frais d'administration	17	21
Frais d'assurance	7	10
Taxe de vente harmonisée	15	19
	153	189
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(842)</b>	<b>451</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,55)	1,18
Catégorie Revenu	(2,54)	1,27
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	156 623	191 201
Catégorie Revenu	173 905	177 443

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	6 368	6 582
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(842)	451
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	263	836
Montant versé au rachat de parts	(863)	(1 501)
	(600)	(665)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	4 926	6 368

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(842)	451
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(31)	(181)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	963	(88)
Produit de la vente de placements	791	1 125
Achat de placements	(35)	(294)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(243)	(371)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	603	642
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	263	837
Montant versé au rachat de parts	(862)	(1 501)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(599)	(664)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4	(22)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	4	26
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	8	4
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	380 553	Portefeuille équilibré Granite Sun Life (série I)	5 044 868	4 930 899	100,09
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>5 044 868</b>	<b>4 930 899</b>	<b>100,09</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				(4 525)	(0,09)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>4 926 374</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	49 930 372	PHN Bond Fund, série O	522 652 732	450 716 478
	46 506 835	Fonds Complément tactique Granite Sun Life, série I	449 565 640	371 631 467
	36 201 136	Fonds de titres à revenus fixes américains de base Sun Life, série I	361 371 968	286 430 626
	535 937	iShares Core S&P 500 ETF	259 445 213	279 002 689
	22 638 397	Fonds d'actions internationales JPMorgan Sun Life, série I	234 707 006	244 983 681
	24 321 512	Mandat privé d'actifs réels Sun Life, série I	227 531 758	239 107 219
	19 664 888	Fonds mondial d'actions à moyenne capitalisation Schroder Sun Life, série I	239 414 183	234 438 900
	18 263 783	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	207 759 548	227 252 604
	5 715 402	Fonds valeur américain MFS Sun Life, série I	183 367 433	221 075 752
	3 922 286	Fonds croissance américain MFS Sun Life, série I	213 594 992	213 397 842
	4 175 366	Catégorie Actions Canadiennes IG Beutel Goodman, série I	168 477 514	180 453 484
	19 761 682	Fonds d'obligations canadiennes Universal BlackRock Sun Life, série I	196 244 202	178 736 507
	2 418 185	Fonds d'actions canadiennes MFS Sun Life, série I	128 304 716	155 801 481
	12 986 623	Fonds marchés émergents Schroder Sun Life, série I	161 077 814	139 769 833
	4 570 772	Fonds valeur international MFS Sun Life, série I	108 821 336	121 370 457
	6 067 664	Fonds occasions internationales MFS Sun Life, série I	109 166 774	116 607 152
	13 811 006	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	134 214 446	108 473 025
	15 932 553	Fonds d'obligations de marchés Émergents RBC (couvert en \$ CA), série O	144 127 526	108 030 676
	12 360 953	Fonds de revenu flexible NWQ Sun Life, série I	118 462 557	97 084 164
	9 945 157	Fonds d'obligations à rendement élevé RBC, série O	102 380 045	91 565 062
	8 193 971	Fonds du marché monétaire Sun Life, série I	81 939 709	81 939 709
	187 423	ABSL Umbrella UCITS Fund, catégorie E	31 522 468	50 187 562
	4 026 236	Mandat privé de titres de créance de base Avantage Sun Life, série I	39 859 543	34 057 126
	3 237 414	Mandat privé de titres de créance spécialisés Crescent Sun Life, série I	32 363 307	31 764 537
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		13 592 557

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille équilibré Granite Sun Life	4 307 162	4 931	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille équilibré Granite Sun Life	5 127 173	6 376	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	167 323	207 601	183 011	181 361
Parts émises contre trésorerie	3 652	16 208	12 476	30 352
Parts rachetées	(23 847)	(56 486)	(29 694)	(28 702)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>147 128</b>	<b>167 323</b>	<b>165 793</b>	<b>183 011</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	15,48	2 278	147 128	5,21	2,84	0,28	3,12	10,28
2021	17,91	2 996	167 323	10,28	2,84	0,30	3,14	10,87
2020	16,72	3 472	207 601	9,98	2,84	0,30	3,14	10,89
2019	15,81	3 792	239 845	7,15	2,83	0,30	3,13	10,94
2018	14,13	3 722	263 374	8,19	2,83	0,30	3,13	11,00
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	15,97	2 648	165 793	5,21	2,54	0,28	2,82	11,37
2021	18,42	3 372	183 011	10,28	2,54	0,28	2,82	11,41
2020	17,15	3 110	181 361	9,98	2,54	0,30	2,84	12,05
2019	16,16	2 648	163 850	7,15	2,53	0,29	2,82	11,99
2018	14,40	2 322	161 256	8,19	2,53	0,29	2,82	11,85

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	2 231	3 051
Trésorerie	10	7
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 241	3 058
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	4	4
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	4	4
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	<b>2 237</b>	<b>3 054</b>
*Placements au coût	2 456	2 903
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	11,90	13,73
Catégorie Revenu	12,13	13,98

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	80	77
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	86
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(26)	70
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(373)	(91)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(319)	142
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	54	72
Frais d'administration	8	11
Frais d'assurance	3	4
Taxe de vente harmonisée	6	8
	71	95
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	<b>(390)</b>	<b>47</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(1,89)	0,17
Catégorie Revenu	(1,91)	0,23
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	139 886	161 629
Catégorie Revenu	65 399	83 366

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	3 054	3 515
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(390)	47
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	206	211
Montant versé au rachat de parts	(633)	(719)
	(427)	(508)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	2 237	3 054

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(390)	47
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	26	(70)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	373	91
Produit de la vente de placements	673	957
Achat de placements	(172)	(352)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(80)	(163)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	430	510
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	206	211
Montant versé au rachat de parts	(633)	(719)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	(427)	(508)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	3	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	7	5
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	10	7
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	212 004	Portefeuille prudent Granite Sun Life (série I)	2 456 424	2 231 452	99,77
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 456 424</b>	<b>2 231 452</b>	<b>99,77</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				5 109	0,23
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>2 236 561</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	31 828 420	PHN Bond Fund, série O	334 629 782	287 311 964
	28 422 004	Fonds de titres à revenus fixes américains de base Sun Life, série I	285 109 414	224 880 578
	21 619 947	Fonds d'obligations canadiennes Universal BlackRock Sun Life, série I	222 522 145	195 543 777
	18 024 655	Fonds Complément tactique Granite Sun Life, série I	175 012 977	144 033 214
	7 446 720	Fonds du marché monétaire Sun Life, série I	74 467 197	74 467 197
	7 556 609	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	73 358 801	59 350 364
	7 152 604	Fonds de revenu flexible NWQ Sun Life, série I	68 107 755	56 177 268
	1 414 519	Fonds valeur américain MFS Sun Life, série I	46 238 806	54 714 594
	980 173	Fonds croissance américain MFS Sun Life, série I	58 611 134	53 327 793
	6 656 714	Fonds d'obligations de marchés Émergents RBC (couvert en \$ CA), série O	60 602 438	45 135 852
	4 114 110	Fonds d'actions internationales JPMorgan Sun Life, série I	43 680 130	44 521 253
	4 666 139	Fonds d'obligations à rendement élevé RBC, série O	48 482 360	42 961 144
	3 256 400	Fonds mondial d'actions à moyenne capitalisation Schroder Sun Life, série I	40 722 738	38 821 825
	3 920 376	Mandat privé d'actifs réels Sun Life, série I	37 965 514	38 541 610
	839 198	Catégorie Actions Canadiennes IG Beutel Goodman, série I	34 734 159	36 268 959
	2 468 313	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	29 328 531	30 712 725
	439 448	Fonds d'actions canadiennes MFS Sun Life, série I	24 803 711	28 313 241
	2 512 558	Fonds marchés émergents Schroder Sun Life, série I	32 295 606	27 041 659
	3 011 497	Mandat privé de titres de créance de base Advantage Sun Life, série I	29 956 270	25 473 649
	43 076	iShares Core S&P 500 ETF	22 711 674	22 424 874
	724 363	Fonds valeur international MFS Sun Life, série I	18 178 614	19 234 439
	861 070	Fonds occasions internationales MFS Sun Life, série I	15 881 114	16 547 866
	1 269 393	Mandat privé de titres de créance spécialisés Crescent Sun Life, série I	12 689 684	12 454 905
	30 414	ABSL Umbrella UCITS Fund, catégorie E	5 381 586	8 144 132
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		5 004 248

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille prudent Granite Sun Life	1 603 145	2 231	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille prudent Granite Sun Life	2 038 685	3 051	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	142 650	170 736	78 335	87 452
Parts émises contre trésorerie	11 454	14 409	5 412	1 040
Parts rachetées	(30 716)	(42 495)	(20 447)	(10 157)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>123 388</b>	<b>142 650</b>	<b>63 300</b>	<b>78 335</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	11,90	1 469	123 388	9,96	2,74	0,20	2,94	7,63
2021	13,73	1 959	142 650	15,43	2,74	0,21	2,95	7,97
2020	13,54	2 312	170 736	8,52	2,73	0,22	2,95	8,28
2019	13,02	2 479	190 399	3,13	2,72	0,22	2,94	8,31
2018	12,11	2 490	205 564	13,44	2,73	0,25	2,98	9,41
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	12,13	768	63 300	9,96	2,54	0,25	2,79	10,30
2021	13,98	1 095	78 335	15,43	2,54	0,26	2,80	10,63
2020	13,76	1 203	87 452	8,52	2,53	0,26	2,79	10,45
2019	13,21	1 148	86 948	3,13	2,52	0,26	2,78	10,55
2018	12,27	1 200	97 802	13,44	2,53	0,26	2,79	10,58

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	282	321
Trésorerie	-	1
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	282	322
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	282	322
*Placements au coût	254	244
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	18,44	21,29

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	13	6
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	11
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	1	135
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(49)	(60)
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(35)	92
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	6	13
Frais d'administration	1	2
Frais d'assurance	1	3
Taxe de vente harmonisée	-	1
	8	19
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(43)	73
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,84)	2,47
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	15 229	29 556

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	322	708
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(43)	73
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	3	11
Montant versé au rachat de parts	-	(470)
	3	(459)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	282	322

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(43)	73
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(1)	(135)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	49	60
Produit de la vente de placements	7	485
Achat de placements	(3)	(9)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(13)	(17)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(4)	457
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	3	11
Montant versé au rachat de parts	-	(470)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	3	(459)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	1	3
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	-	1
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	18 768	Portefeuille croissance Granite Sun Life (série I)	253 668	281 801	99,79
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>253 668</b>	<b>281 801</b>	<b>99,79</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				588	0,21
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>282 389</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	251 961	iShares Core S&P 500 ETF	116 958 715	131 168 023
	16 218 574	Fonds Complément tactique Granite Sun Life, série I	155 264 085	129 600 999
	11 326 024	Fonds d'actions internationales JPMorgan Sun Life, série I	119 309 614	122 565 706
	11 910 186	Mandat privé d'actifs réels Sun Life, série I	112 374 130	117 090 228
	9 367 409	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	108 219 675	116 556 795
	9 526 430	Fonds mondial d'actions à moyenne capitalisation Schroder Sun Life, série I	117 870 486	113 571 235
	2 846 114	Fonds valeur américain MFS Sun Life, série I	93 467 670	110 089 679
	1 930 549	Fonds croissance américain MFS Sun Life, série I	106 046 649	105 034 390
	2 013 410	Catégorie Actions Canadiennes IG Beutel Goodman, série I	82 087 774	87 016 750
	1 163 485	Fonds d'actions canadiennes MFS Sun Life, série I	63 181 989	74 962 273
	6 483 583	Fonds marchés émergents Schroder Sun Life, série I	81 406 780	69 780 215
	3 110 364	Fonds occasions internationales MFS Sun Life, série I	56 658 082	59 774 357
	2 225 115	Fonds valeur international MFS Sun Life, série I	53 904 679	59 084 810
	4 514 979	PHN Bond Fund, série O	47 581 316	40 756 263
	4 514 478	Fonds d'obligations de marchés Émergents RBC (couvert en \$ CA), série O	40 625 199	30 610 415
	3 153 564	Fonds d'obligations à rendement élevé RBC, série O	32 075 664	29 034 868
	2 951 977	Fonds d'obligations canadiennes Universal BlackRock Sun Life, série I	26 754 044	26 699 451
	2 660 344	Fonds du marché monétaire Sun Life, série I	26 603 437	26 603 437
	2 981 574	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	29 163 279	23 417 583
	79 357	ABSL Umbrella UCITS Fund, catégorie E	13 126 706	21 249 951
	2 399 620	Fonds de revenu flexible NWQ Sun Life, série I	22 248 495	18 846 856
	1 912 298	Fonds de titres à revenus fixes américains de base Sun Life, série I	18 958 968	15 130 485
	1 118 105	Mandat privé de titres de créance spécialisés Crescent Sun Life, série I	11 177 311	10 970 514
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		4 898 585
	576 785	Mandat privé de titres de créance de base Avantage Sun Life, série I	5 569 823	4 878 908

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille croissance Granite Sun Life	1 558 806	282	-

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille croissance Granite Sun Life	1 755 388	321	-

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession	
	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	15 139	36 803
Parts émises contre trésorerie	174	559
Parts rachetées	-	(22 223)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	15 313	15 139

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	5
2042	-
<b>Total</b>	<b>5</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Le tableau suivant, qui présente les principales données financières relatives au Fonds, a pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

Valeur liquidative du Fonds par part	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion				
	Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	18,44	282	15 313	2,54	2,94	0,15	3,09	5,35
2021	21,29	322	15 139	4,41	2,94	0,15	3,09	5,31
2020	19,23	708	36 803	4,83	2,94	0,15	3,09	5,36
2019	18,04	678	37 572	3,23	2,93	0,15	3,08	5,30
2018	15,69	577	36 746	8,86	2,94	0,18	3,12	6,14

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de la situation financière

aux 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements*	1 677	1 920
Trésorerie	3	2
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	4
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 680	1 926
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	3	2
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Frais d'assurance à payer	-	-
	3	2
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>	1 677	1 924
*Placements au coût	1 729	1 671
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	14,14	16,34
Catégorie Revenu	14,72	16,94

## États du résultat global

pour les exercices clos les 31 décembre

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

	2022	2021
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements		
Distributions de revenu provenant des placements	77	43
Distribution de gains en capital provenant des placements	-	60
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	5	30
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(301)	23
Autres revenus		
Intérêts	-	-
Rabais sur frais (note 6)	-	-
	(219)	156
<b>Charges (note 6)</b>		
Frais de gestion	38	42
Frais d'administration	6	6
Frais d'assurance	3	4
Taxe de vente harmonisée	4	5
	51	57
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités</b>	(270)	99
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part :</b>		
Catégorie Placement / Succession	(2,26)	0,80
Catégorie Revenu	(2,21)	0,88
<b>Nombre moyen pondéré de parts :</b>		
Catégorie Placement / Succession	76 430	82 596
Catégorie Revenu	44 155	37 411

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

États financiers

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à l'ouverture de l'exercice</b>	1 924	1 856
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(270)	99
<b>Transactions sur parts</b>		
Produit de l'émission de parts	179	107
Montant versé au rachat de parts	(156)	(138)
	23	(31)
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat à la clôture de l'exercice</b>	1 677	1 924

## Tableaux des flux de trésorerie pour les exercices clos les 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022	2021
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités	(270)	99
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements	(5)	(30)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	301	(23)
Produit de la vente de placements	206	195
Achat de placements	(178)	(105)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(77)	(103)
(Augmentation) diminution des rabais sur frais à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'assurance à payer	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(23)	33
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	179	107
Montant versé au rachat de parts	(155)	(139)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	24	(32)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de l'exercice	2	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de l'exercice</b>	3	2
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus*	-	-
Intérêts payés*	-	-

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

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

## Inventaire du portefeuille

au 31 décembre 2022

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
	134 433	Portefeuille modéré Granite Sun Life (série I)	1 728 537	1 676 995	99,99
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 728 537</b>	<b>1 676 995</b>	<b>99,99</b>
<b>Autres actifs (passifs) nets</b>				216	0,01
<b>Actif net attribuable aux titulaires de contrat</b>				<b>1 677 211</b>	<b>100,00</b>

## Les 25 principaux titres du fonds sous-jacent

au 31 décembre 2022 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
	23 858 155	PHN Bond Fund, série O	249 827 415	215 365 181
	18 081 827	Fonds Complément tactique Granite Sun Life, série I	175 713 217	144 490 071
	16 357 578	Fonds de titres à revenus fixes américains de base Sun Life, série I	163 423 765	129 424 430
	12 361 734	Fonds d'obligations canadiennes Universel BlackRock Sun Life, série I	123 446 856	111 806 944
	168 619	iShares Core S&P 500 ETF	83 397 930	87 781 128
	7 347 706	Fonds d'actions internationales JPMorgan Sun Life, série I	76 190 070	79 513 940
	7 484 505	Mandat privé d'actifs réels Sun Life, série I	70 735 949	73 580 917
	7 134 344	Fonds du marché monétaire Sun Life, série I	71 343 440	71 343 440
	1 825 511	Fonds valeur américain MFS Sun Life, série I	58 093 526	70 612 047
	5 893 462	Fonds mondial d'actions à moyenne capitalisation Schroder Sun Life, série I	71 546 511	70 260 081
	1 262 959	Fonds croissance américain MFS Sun Life, série I	69 347 941	68 713 163
	5 520 594	Fonds d'actions canadiennes Composé BlackRock Sun Life, série I	63 217 838	68 691 652
	1 320 119	Catégorie Actions Canadiennes IG Beutel Goodman, série I	53 358 336	57 053 711
	6 310 788	Mandat privé de titres à revenu fixe opportuniste Wellington Sun Life, série I	61 313 345	49 565 557
	765 586	Fonds d'actions canadiennes MFS Sun Life, série I	40 976 236	49 326 032
	4 217 450	Fonds marchés émergents Schroder Sun Life, série I	53 599 060	45 390 727
	5 362 897	Fonds de revenu flexible NWQ Sun Life, série I	51 440 318	42 120 726
	6 130 826	Fonds d'obligations de marchés Émergents RBC (couvert en \$ CA), série O	55 639 114	41 570 064
	4 487 611	Fonds d'obligations à rendement élevé RBC, série O	45 916 926	41 317 438
	1 471 097	Fonds valeur international MFS Sun Life, série I	35 504 439	39 062 923
	1 879 801	Fonds occasions internationales MFS Sun Life, série I	33 682 689	36 125 639
	2 101 651	Mandat privé de titres de créance de base Advantage Sun Life, série I	20 883 775	17 777 443
	57 870	ABSL Umbrella UCITS Fund, catégorie E	9 684 850	15 496 208
	1 284 815	Mandat privé de titres de créance spécialisés Crescent Sun Life, série I	12 843 855	12 606 224
		Trésorerie et équivalents de trésorerie		5 977 566

Les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s) Sun Life, y compris l'information sur les titres en portefeuille de ce(s) même(s) fonds, sont disponibles en format électronique sur le site Web du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) à l'adresse [www.placementsmondiauxsunlife.com](http://www.placementsmondiauxsunlife.com).

Les pourcentages dans l'inventaire du portefeuille indiquent la proportion des placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux titulaires de contrat du Fonds.

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

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Notes des états financiers propres au Fonds

## Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s).

au 31 décembre 2022

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille modéré Granite Sun Life	1 656 209	1 677	0,1

au 31 décembre 2021

Fonds sous-jacent(s)	Juste valeur du (des) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) (%)
Portefeuille modéré Granite Sun Life	2 033 353	1 920	0,1

## Transactions sur parts (note 5)

pour les exercices clos les 31 décembre

	Catégorie Placement / Succession		Catégorie Revenu	
	2022	2021	2022	2021
<b>Nombre de parts à l'ouverture de l'exercice</b>	79 924	79 463	36 466	38 659
Parts émises contre trésorerie	983	6 868	10 037	-
Parts rachetées	(7 123)	(6 407)	(3 446)	(2 193)
<b>Nombre de parts à la clôture de l'exercice</b>	<b>73 784</b>	<b>79 924</b>	<b>43 057</b>	<b>36 466</b>

## Pertes reportées en avant (note 4)

au 31 décembre (en milliers de dollars)

	2022
<b>Pertes autres qu'en capital expirant en :</b>	
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
<b>Total</b>	<b>-</b>

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

Information financière (pour les exercices clos les 31 décembre) (non audité)

## Faits saillants financiers

Les tableaux suivants, qui présentent les principales données financières relatives au Fonds, ont pour but de vous aider à comprendre les résultats financiers du Fonds pour les cinq derniers exercices.

	Valeur liquidative du Fonds par part Actif net attribuable aux titulaires de contrat, par part, à la clôture de l'exercice indiqué (en \$) <sup>(1)</sup>	Ratios et données supplémentaires			Ratio des frais de gestion			
		Actif net (en milliers de dollars) <sup>(1)</sup>	Nombre de parts en circulation <sup>(1)</sup>	Taux de rotation du portefeuille (en %) <sup>(2)</sup>	Ratio des frais de gestion avant taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taxe de vente harmonisée (en %) <sup>(3)</sup>	Ratio des frais de gestion après taxes (en %) <sup>(3)</sup>	Taux effectif de la TVH pour l'exercice (en %) <sup>(3)</sup>
<b>Catégorie Placement / Succession</b>								
2022	14,14	1 043	73 784	11,38	2,84	0,27	3,11	9,67
2021	16,34	1 306	79 924	10,28	2,84	0,26	3,10	9,31
2020	15,54	1 235	79 463	5,45	2,83	0,26	3,09	9,50
2019	14,84	1 355	91 348	5,00	2,83	0,29	3,12	10,57
2018	13,46	1 568	116 491	11,37	2,83	0,28	3,11	9,99
<b>Catégorie Revenu</b>								
2022	14,72	634	43 057	11,38	2,54	0,22	2,76	8,94
2021	16,94	618	36 466	10,28	2,54	0,22	2,76	8,87
2020	16,06	621	38 659	5,45	2,53	0,22	2,75	8,84
2019	15,28	643	42 092	5,00	2,53	0,22	2,75	8,85
2018	13,81	663	47 991	11,37	2,53	0,22	2,75	8,81

1) Ces données sont au 31 décembre des exercices indiqués.

2) Le taux de rotation du portefeuille du Fonds indique dans quelle mesure le conseiller en valeurs du Fonds gère activement les placements de celui-ci. Un taux de rotation du portefeuille de 100 % signifie que le Fonds achète et vend tous les titres de son portefeuille une fois au cours de l'exercice. Plus le taux de rotation du portefeuille au cours d'un exercice est élevé, plus les coûts de transaction payables par le Fonds sont élevés au cours de cet exercice, et plus il est probable qu'un titulaire de contrat réalise des gains en capital imposables au cours de l'exercice. Il n'y a pas nécessairement de lien entre un taux de rotation élevé et le rendement d'un Fonds.

3) Le ratio des frais de gestion est établi d'après le total des charges imputées directement au Fonds plus, le cas échéant, les frais du ou des fonds sous-jacent(s), calculés selon une moyenne pondérée en fonction de la pondération du ou des fonds sous-jacent(s) dans le portefeuille, et est exprimé en pourcentage annualisé de l'actif net moyen des exercices indiqués. Le taux effectif de la TVH est calculé en utilisant le taux applicable à chaque province selon la résidence du titulaire de contrat et peut être différent de 13 %.

Pour connaître la date de création du Fonds, veuillez consulter la note 1 des notes des états financiers.

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

# Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2

*Notes des états financiers propres au Fonds*

---

## **Risques liés aux instruments financiers du (des) fonds sous-jacent(s)**

---

Le Fonds est indirectement exposé au risque de crédit, au risque de liquidité, à l'autre risque de prix, au risque de change et au risque de taux d'intérêt par ses participations dans le(s) fonds sous-jacent(s), dans la mesure où ceux-ci sont exposés aux mêmes risques. Veuillez vous référer à la note 8 pour une explication de la gestion des risques financiers. Les analyses de risque détaillées du (des) fonds sous-jacent(s) sont présentées dans les états financiers du (des) fonds sous-jacent(s).

# Notes des états financiers

## 1. LES FONDS

Les Fonds distincts SunWise<sup>®</sup> Essentiel 2 suivants ont été créés par une résolution du conseil d'administration de la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie (« Sun Life ») aux dates indiquées ci-dessous :

Fonds	Date
Fonds distinct jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé équilibré canadien de répartition d'actifs CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'obligations canadiennes CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'actions canadiennes SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct de croissance et de revenu canadien SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds jumelé équilibré diversifié CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2)	25 juillet 2013
Fonds distinct jumelé d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'actions mondiales CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct équilibré mondial Black Creek CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct mondial de croissance et de revenu CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct valeur mondiale CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct marché monétaire CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds jumelé équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct équilibré supérieur canadien CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'obligations canadiennes supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'obligations multistratégie Sun Life SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct jumelé équilibré canadien supérieur II CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur II SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct d'actions canadiennes supérieur III SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct canadien sélect CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées supérieur CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'actions américaines CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct jumelé canadien sélect CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012

## Fonds (suite)

Fonds	Date
Fonds distinct jumelé d'actions mondiales sélect CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct jumelé Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct de gestion d'actions internationales sélect CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct d'actions internationales Black Creek CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct jumelé d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'actions américaines sélectionnées CI SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Fidelity Répartition d'actifs canadiens SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Fidelity Étoile du Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Fidelity Frontière Nord <sup>MD</sup> SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct chefs de file mondiaux CI SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct chefs de file mondiaux Black Creek CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu supérieur SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct gestion du revenu Select CI SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance équilibrée SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles équilibrée prudente SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles prudente SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2 (auparavant Fonds distinct Série Portefeuilles de revenu SunWise Essentiel 2)	27 août 2012
Fonds distinct Série Portefeuilles croissance maximale SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'actions canadiennes BlackRock Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct portefeuille croissance équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct portefeuille équilibré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct portefeuille prudent Granite Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct portefeuille croissance Granite Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct portefeuille modéré Granite Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'obligations canadiennes MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé croissance mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct mondial de rendement global MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct valeur mondiale MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct croissance américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct jumelé valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct valeur américaine MFS Sun Life SunWise Essentiel 2	27 août 2012
Fonds distinct d'obligations canadiennes TD SunWise Essentiel 2 (le Fonds ou collectivement les Fonds ou les Fonds distincts SunWise <sup>®</sup> Essentiel 2)	27 août 2012

# Notes des états financiers (suite)

Le 16 septembre 2022, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
Fonds distinct de rendement diversifié CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2
Fonds distinct de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2
Fonds distinct jumelé diversifié CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2
Fonds distinct jumelé de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2
Fonds distinct jumelé de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2
Fonds distinct jumelé diversifié de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2

Le gestionnaire a utilisé la méthode de l'acquisition pour comptabiliser la fusion des Fonds. Selon cette méthode, l'un des Fonds est désigné le Fonds acquéreur et est désigné le « Fonds prorogé » et l'autre Fonds visé par la fusion est désigné le « Fonds clôturé ». Cette désignation est fondée sur la comparaison de la valeur liquidative relative des Fonds, ainsi que sur la prise en compte du maintien de certaines caractéristiques du Fonds prorogé, telles que les objectifs et procédures de placement et les types de titres en portefeuille.

En date du 16 septembre 2022, à la clôture des bureaux, le Fonds prorogé a acquis tous les actifs nets du Fonds clôturé en échange de titres du Fonds prorogé. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de cette fusion correspond à l'actif net transféré du Fonds clôturé. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont été effectuées avec report d'impôt.

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis (\$)	Parts émises
Fonds distinct de rendement diversifié CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct de rendement diversifié II CI SunWise Essentiel 2	10 246 038	761 302
Fonds distinct de croissance et de revenu de dividendes CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct équilibré canadien CI SunWise Essentiel 2	4 676 470	302 659
Fonds distinct jumelé diversifié CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2	32 304 277	1 708 937
Fonds distinct jumelé de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2	4 809 138	234 641
Fonds distinct jumelé de placements canadiens supérieur CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2	3 853 242	192 796
Fonds distinct jumelé diversifié de placements canadiens CI SunWise Essentiel 2	Fonds distinct jumelé d'actions canadiennes CI SunWise Essentiel 2	3 001 261	157 724

Les résultats des Fonds clôturés ne figurent pas dans ces états financiers.

La Sun Life, une filiale en propriété exclusive de la Financière Sun Life Inc., est la seule émettrice du contrat d'assurance individuelle à capital variable en vertu duquel les placements sont effectués dans chaque Fonds. Les actifs de chaque Fonds sont la propriété de la Sun Life et sont distincts des autres actifs de la Sun Life. Les Fonds ne sont pas des entités juridiques distinctes, mais sont des entités publiantes distinctes.

La Sun Life a nommé CI Investments Inc. (« CI » ou le « gestionnaire ») pour qu'elle offre en son nom certains services d'administration et de gestion concernant les Fonds et les contrats.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 28 avril 2023.

Les Fonds peuvent avoir jusqu'à trois catégories de parts, la catégorie Investissement/Succession, la catégorie Revenu et le programme de Gestion de placement privée (GPP) qui ont été proposées aux investisseurs à partir de la date de création des Fonds.

Les états de la situation financière sont aux 31 décembre 2022 et 2021. Les états du résultat global et les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021. Les inventaires du portefeuille sont au 31 décembre 2022. Les notes des états financiers propres au Fonds comprennent la participation dans le(s) fonds sous-jacent(s) aux 31 décembre 2022 et 2021, les transactions sur parts pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 2021 et les risques liés aux instruments financiers aux 31 décembre 2022 et 2021.

## 2. RÉSUMÉ DES PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

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

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

### a. Classement et comptabilisation des instruments financiers

Le ou les fonds de placement détenus par les Fonds sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net, conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers*. Les achats et les ventes d'actifs financiers sont comptabilisés à la date de l'opération. Les obligations des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat sont présentées au montant du rachat, qui se rapproche de la juste valeur. Tous les autres actifs et passifs financiers sont évalués au coût amorti, qui se rapproche de la juste valeur. Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisé s'il y a lieu, selon le taux d'intérêt effectif.

### b. Juste valeur des placements financiers

À la clôture, les titres cotés sont évalués au dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des conditions actuelles du marché. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. Le ou les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable selon la valeur liquidative présentée par le gestionnaire des fonds sous-jacents.

# Notes des états financiers (suite)

## c. Trésorerie

La trésorerie est constituée de fonds déposés. Le découvert bancaire est présenté dans les passifs courants dans les états de la situation financière.

## d. Coût des placements

Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est déterminé selon le coût moyen.

## e. Opérations de placement

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération. Les profits et les pertes réalisés à la vente de placements et la plus-value ou la moins-value latente des placements sont calculés selon le coût moyen.

## f. Comptabilisation du revenu

Les distributions provenant des placements sont comptabilisées à la date ex-distribution et les revenus d'intérêts sont cumulés quotidiennement.

Les distributions provenant des titres de fonds de placement sont comptabilisées par les Fonds sous la forme selon laquelle elles sont versées par le ou les fonds sous-jacents.

## g. Monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation

Les souscriptions et les rachats des Fonds sont libellés en dollars canadiens, monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation des Fonds.

## h. Classement des parts

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

## i. Valeur liquidative par part

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

La valeur liquidative totale de chaque catégorie est basée sur le calcul de la quote-part des actifs du Fonds revenant à cette catégorie, moins la quote-part du passif collectif du Fonds revenant à cette catégorie et le passif attribuable à cette catégorie. Les charges directement attribuables à une catégorie sont imputées à cette catégorie. Les revenus et les autres charges sont répartis proportionnellement entre chaque catégorie en fonction de la valeur liquidative totale de chaque catégorie par rapport à la valeur liquidative totale du Fonds.

## j. Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net liée attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, par part de chaque catégorie, est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat, liée aux activités, de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre moyen pondéré de parts de cette catégorie en circulation au cours de l'exercice.

## k. États financiers consolidés

Conformément à l'IFRS 10, *États financiers consolidés* (« IFRS 10 »), un Fonds doit fournir des états financiers consolidés s'il a le contrôle sur les entités dans lesquelles il investit. En octobre 2013, l'IASB a publié une modification à l'IFRS 10 relative à l'« entité d'investissement », qui prévoit une exception à la consolidation pour une entité qui répond à la définition d'une entité d'investissement. Le gestionnaire a déterminé que tous les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement.

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

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

Pour tous les Fonds qui investissent dans un ou des fonds sous-jacents, le gestionnaire a déterminé que les fonds servants satisfont aux critères d'une entité structurée par rapport aux fonds dominants.

L'exposition aux placements se rapportant à la participation de chaque Fonds dans un ou des fonds sous-jacents figure dans les notes des états financiers propres au Fonds de chaque Fonds.

## m. Montants non nuls

Certains soldes présentés dans les états financiers comprennent des montants qui sont arrondis à zéro.

## 3. UTILISATION DE JUGEMENTS ET D'ESTIMATIONS COMPTABLES

La préparation des états financiers exige que la direction émette des jugements, fasse des estimations et pose des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables ainsi que sur les montants présentés au titre de l'actif et du passif à la date de clôture et sur les montants présentés des revenus et des charges au cours de l'exercice.

Le paragraphe suivant présente une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation de leurs états financiers :

### *Évaluation de la juste valeur des placements non cotés sur un marché actif*

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

## 4. IMPÔT SUR LE REVENU

Chaque Fonds est réputé être une fiducie, qu'on appelle « fiducie créée à l'égard du fonds réservé », selon les dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et est réputé avoir attribué son revenu aux bénéficiaires. Les gains nets et les pertes nettes en capital de chaque Fonds sont réputés revenir aux bénéficiaires. Par conséquent, les Fonds ne sont pas assujettis à l'impôt sur leur revenu net, y compris les gains en capital nets réalisés pour l'exercice.

# Notes des états financiers (suite)

Voir le tableau sur les pertes fiscales reportées dans les notes des états financiers propres à chaque Fonds pour obtenir plus d'information sur les pertes autres qu'en capital reportées.

## 5. PARTS DES TITULAIRES DE CONTRAT

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

Les variations pertinentes relatives aux souscriptions et aux rachats des parts de chaque Fonds sont présentées dans les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux titulaires de contrat. Conformément aux politiques et aux objectifs de gestion des risques décrits à la note 8, les Fonds s'efforcent d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant suffisamment de liquidités pour répondre aux demandes de rachat, au moyen de la cession de placements, le cas échéant.

L'information se rapportant aux opérations sur parts pour chaque Fonds figure dans les notes des états financiers propres à chaque Fonds.

## 6. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

En contrepartie des frais de gestion qu'il reçoit, le gestionnaire fournit les services de gestion requis pour les activités quotidiennes des Fonds.

Les frais de gestion sont calculés selon un pourcentage annuel de la valeur liquidative totale de chaque catégorie de chaque Fonds à la fin de chaque jour et sont payés à la fin de chaque mois.

Pour les Fonds qui investissent dans un fonds sous-jacent autre qu'un fonds commun de placement CI, des frais de gestion sont payés à un tiers gestionnaire de portefeuille.

En plus des frais de gestion, des frais d'administration annuels sont imputés à chaque Fonds et chaque fonds sous-jacent. En contrepartie des frais d'administration annuels qu'il reçoit, le gestionnaire absorbe tous les frais d'exploitation de chaque Fonds et de chaque fonds sous-jacent (à part certaines taxes, certains coûts d'emprunt, certains nouveaux droits gouvernementaux et les coûts et les charges des rapports et autres notices explicatives exigés conformément aux lois et lignes directrices réglementaires régissant l'émission ou la vente de contrats de rente variable).

Les frais d'administration sont calculés selon un pourcentage annuel de la valeur liquidative totale de chaque catégorie de chaque Fonds à la fin de chaque jour ouvrable et sont payés à la fin de chaque mois.

Un Fonds qui investit dans des parts d'un fonds sous-jacent ne paiera pas de frais de gestion et d'administration en double sur la portion des actifs qui sont investis dans des parts du fonds sous-jacent. Au cours de l'exercice, un Fonds pourrait recevoir un rabais sur les frais de gestion ou d'administration du gestionnaire du fonds sous-jacent relativement à ses placements dans un fonds sous-jacent. Les rabais sur frais de gestion sont compris dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, selon le cas, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ». Le montant brut des frais de gestion et des rabais sur frais est présenté dans les états du résultat global de chaque Fonds.

Les Fonds versent des frais d'assurance à la Sun Life. La Sun Life impute les frais d'assurance à chaque catégorie du Fonds pour l'option de garantie applicable à la catégorie du Fonds. Les frais d'assurance à payer à la fin de l'exercice sont compris dans les états de la situation financière sous « Frais d'assurance à payer », tandis que les charges liées aux frais d'assurance pour l'exercice sont comprises dans les états du résultat global sous « Frais d'assurance ».

## 7. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Un Fonds pourrait investir dans un fonds sous-jacent qui est également géré par CI, le gestionnaire des Fonds. Pour des détails, veuillez consulter les notes des états financiers propres à chaque Fonds ou l'inventaire du portefeuille de chaque Fonds.

Les frais de gestion et d'administration payés à CI sont également considérés comme une opération entre parties liées. Pour plus de détails, veuillez consulter la note 6.

## 8. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

### Conflit entre l'Ukraine et la Russie

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

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

### Gestion des risques

Les Fonds investissent dans des parts de fonds sous-jacents et sont indirectement exposés à divers risques liés aux instruments financiers : le risque de concentration, le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque de marché (y compris l'autre risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt). Le niveau de risque auquel chaque Fonds est exposé est fonction de l'objectif de placement et du type de placements que détiennent le ou les fonds sous-jacents. La valeur des placements dans un portefeuille d'un fonds sous-jacent peut changer de jour en jour en raison des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur, des conditions économiques et du marché, et des nouvelles propres aux sociétés dans lesquelles le fonds sous-jacent a investi, et ces facteurs ont une incidence sur la valeur de chaque Fonds. Le gestionnaire du ou des fonds sous-jacents peut atténuer les effets négatifs de ces risques à l'aide des mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions du ou des fonds sous-jacents et des événements du marché; la diversification du portefeuille de placements par catégorie d'actifs, pays, secteur et durée jusqu'à l'échéance, tout en respectant les objectifs établis; et par l'entremise des dérivés à titre de couverture de certains risques.

### Risque de concentration

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

Des renseignements ayant trait à l'exposition de chacun des Fonds au risque de concentration sont présentés dans les notes des états financiers propres au Fonds de chaque Fonds.

### Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque que l'émetteur du titre ou la contrepartie à un instrument financier ne puisse pas respecter ses obligations financières. La juste valeur d'un titre de créance tient compte de la note de crédit de l'émetteur. La valeur comptable des titres de créance représente l'exposition au risque de crédit de chaque fonds sous-jacent. L'exposition au risque de crédit pour les dérivés se fonde sur le profit latent de chaque fonds sous-jacent sur les obligations contractuelles envers la contrepartie à la date de clôture. L'exposition au risque de crédit des autres actifs des Fonds correspond à leur valeur comptable présentée dans les états de la situation financière.

# Notes des états financiers (suite)

---

## Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque qu'un Fonds ne puisse pas respecter ses engagements à temps ou à un prix raisonnable. Les Fonds sont exposés à des rachats en trésorerie quotidiens de parts rachetables. Les Fonds investissent la totalité de leur actif dans un ou plusieurs fonds sous-jacents qui peuvent être vendus facilement.

## Risque de marché

Les placements des Fonds sont exposés au risque de marché, qui est le risque que la juste valeur ou le flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des conditions du marché.

### *Autre risque de prix*

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt). La valeur de chaque placement est influencée par les perspectives de l'émetteur et par les conditions économiques et politiques générales, de même que par les tendances du secteur et du marché. Les titres présentent tous un risque de perte de capital.

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme et, par conséquent, ne sont pas exposés à l'autre risque de prix.

### *Risque de change*

Le risque de change provient d'instruments financiers qui sont libellés en devises autres que le dollar canadien, la monnaie fonctionnelle des Fonds et des fonds sous-jacents. Par conséquent, les fonds sous-jacents peuvent être exposés au risque que la valeur des titres libellés dans d'autres devises varie à cause de fluctuations des taux de change. Les actions négociées sur les marchés étrangers sont aussi exposées à des risques de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle des fonds sous-jacents afin de déterminer leur juste valeur.

### *Risque de taux d'intérêt*

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt varie en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur du ou des fonds sous-jacents qui investissent dans des titres de créance ou des titres de fiducies de revenu sera influencée par des fluctuations du taux d'intérêt applicable. Si les taux d'intérêt diminuent, la juste valeur des titres de créance existants pourrait augmenter en raison du rendement plus élevé. Par contre, si les taux d'intérêt augmentent, la réduction du rendement des titres de créance existants pourrait entraîner une baisse de leur juste valeur. En général, la baisse est plus importante pour les titres de créance à long terme que pour les titres de créance à court terme.

Le risque de taux d'intérêt s'applique également aux titres convertibles. La juste valeur de ces titres varie de façon inverse aux taux d'intérêt, tout comme d'autres titres de créance. Toutefois, étant donné qu'ils peuvent être convertis en actions ordinaires, les titres convertibles sont généralement moins touchés par les fluctuations de taux d'intérêt que d'autres titres de créance.

L'exposition des Fonds à la sensibilité aux taux d'intérêt des placements à court terme portant intérêt est minime en raison de leur courte durée.

## Hiérarchie des justes valeurs

Les Fonds doivent classer les instruments financiers évalués selon la juste valeur en utilisant une hiérarchie des justes valeurs. Les placements évalués selon des cours cotés sur des marchés actifs sont classés au niveau 1. Ce niveau comprend des actions cotées en Bourse, des fonds négociés en Bourse, des fonds communs de placement offerts aux particuliers, des bons de souscription négociés en Bourse, des contrats à terme standardisés et des options négociées en Bourse.

Les instruments financiers qui sont négociés sur les marchés qui ne sont pas considérés comme étant actifs, mais qui sont évalués selon les cours du marché, les cotations de courtiers ou d'autres sources d'évaluations étayées par des données observables sont classés au niveau 2. Ces instruments comprennent les titres à revenu fixe, les titres adossés à des créances hypothécaires, les instruments à court terme, les bons de souscription hors cote, les options hors cote, les billets structurés de titres indexés et, le cas échéant, les contrats de change à terme et les swaps.

L'évaluation des placements classés au niveau 3 repose sur des données non observables importantes. Les placements du niveau 3 comprennent les actions de sociétés fermées, les prêts à terme privés, les fonds d'actions privés et certains dérivés. Des cours observables n'étant pas disponibles pour ces titres, les Fonds pourraient utiliser une variété de techniques d'évaluation pour calculer la juste valeur.

Les Fonds investissent uniquement dans d'autres fonds de placement et ces placements sont classés au niveau 1.

Des renseignements ayant trait à l'exposition aux risques liés aux instruments financiers de chaque Fonds sont présentés dans les notes des états financiers propres au Fonds de chaque Fonds.

## 9. FONDS SOUS-JACENTS TIERS

Certains Fonds investissent dans des fonds communs de placement non gérés par CI. Ces fonds ne sont pas gérés par CI et, par conséquent, ils ne sont pas assujettis au même processus que les Fonds qui investissent dans des Fonds CI. CI n'est pas responsable de la gestion des risques des fonds qui ne sont pas gérés par CI et ne reçoit pas de renseignements détaillés sur la gestion des risques de la part du gestionnaire du fonds sous-jacent dans le cadre normal de ses activités. CI n'est également pas en mesure de valider ces renseignements.

# Avis juridique

---

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires de ces états financiers en composant le 1 800 792-9355, en envoyant un courriel à [servicefrancais@ci.com](mailto:servicefrancais@ci.com), ou en communiquant avec votre représentant.

La Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie, membre du groupe Financière Sun Life, est le seul émetteur du contrat d'assurance individuelle à capital variable en vertu duquel les placements sont effectués dans les Fonds Série SunWise Essentiel 2. Une description des principales caractéristiques du contrat d'assurance individuelle à capital variable applicable est contenue dans la notice explicative. **SOUS RÉSERVE DE TOUTE GARANTIE À L'ÉCHÉANCE OU AU DÉCÈS QUI S'APPLIQUENT, TOUT MONTANT AFFECTÉ À UN FONDS DISTINCT EST INVESTI AUX RISQUES DU OU DES TITULAIRES DU CONTRAT ET SA VALEUR PEUT AUGMENTER OU DIMINUER.**

Certains noms, mots, phrases, graphiques ou logos figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Placements CI. Placements CI et le logo Placements CI sont des marques déposées de Gestion mondiale d'actifs CI. SunWise est une marque déposée de la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie.

**Pour plus d'informations, veuillez visit [www.ci.com](http://www.ci.com).**

AR\_F 04/23