



GESTION
MONDIALE D'ACTIFS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2023

30 JUIN 2023

Table des matières

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI.....	1
FNB d'actions mondiales ONE CI.....	20
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI.....	31
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI.....	40
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI.....	49
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI.....	72
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI.....	83
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI.....	99
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI.....	113
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI.....	130
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI.....	147
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI.....	163
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI.....	178
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI.....	200
Notes des états financiers	217
Avis juridique	227

Le gestionnaire du Fonds, CI Investments Inc., nomme un auditeur indépendant pour qu'il réalise l'audit des états financiers annuels du Fonds. En vertu des lois canadiennes sur les valeurs mobilières (Règlement 81-106), si l'auditeur n'a pas effectué l'examen des états financiers semestriels, un avis accompagnant les états financiers doit en faire état.

L'auditeur indépendant du Fonds n'a pas effectué l'examen des présents états financiers semestriels en conformité avec les normes établies par Comptables professionnels agréés du Canada (CPA Canada).

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	44 346	43 935
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	349	246
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	17	12
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	82	-
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	44 794	44 193
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	21	17
Comptes créditeurs et charges à payer	32	24
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	53	41
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	44 741	44 152

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts non couvertes	44 741	44 152	21,31	23,24	2 100 000

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	683	108
Intérêts aux fins des distributions	3	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(698)	(89)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(3 813)	(866)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(3 825)	(847)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(21)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	-
Rabais sur frais	110	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	7	-
Total des autres revenus	97	-
Total des revenus	(3 728)	(847)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	131	20
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	19	4
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	44	7
Taxe de vente harmonisée	3	3
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	1
Total des charges	198	36
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 926)	(883)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts non couvertes	(3 926)	(883)	(1,93)	(2,94)	2 035 359	300 000

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	44 152	8 884
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 926)	(883)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(194)	(35)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(136)	(2)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(330)	(37)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 845	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	4 845	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	589	(920)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	44 741	7 964

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 926)	(883)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	698	89
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	19	4
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	3 813	866
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5 527	249
Achat de placements et de dérivés	(10 470)	(259)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(81)	(21)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	4	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	3
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(4 412)	46
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(330)	(37)
Produit de l'émission de parts rachetables	4 846	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	4 516	(37)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	104	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	246	40
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	349	50
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	558	80
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SERVICES FINANCIERS					
HKD	267000	Agricultural Bank of China Ltd.	120 367	138 860	
CNY	468100	Agricultural Bank of China Ltd.	267 842	301 007	
CNY	202 800	Bank of China Ltd.	125 462	144 447	
HKD	671 000	Bank of China Ltd., catégorie H	316 720	355 768	
CNY	223 400	Bank of Communications Co., Ltd.	208 418	236 034	
HKD	185 000	Bank of Communications Co., Ltd., catégorie H	142 088	162 126	
CNY	31 000	Bank of Ningbo Co., Ltd.	192 210	142 871	
CNY	26 400	China CITIC Bank Corp., Ltd.	25 958	28 759	
HKD	79 000	China Citic Bank, catégorie H	46 836	49 090	
CNY	59 600	China Construction Bank Corp.	66 704	67 965	
HKD	859 000	China Construction Bank Corp., catégorie H	723 407	735 386	
CNY	178 000	China Everbright Bank Co., Ltd.	110 099	99 545	
HKD	27 000	China Everbright Bank Co., Ltd., catégorie H	11 227	10 258	
CNY	5 400	China International Capital Corp., Ltd.	41 265	34 941	
HKD	13 200	China International Capital Corp., Ltd.	34 758	30 625	
CNY	12 700	China Life Insurance Co., Ltd.	88 584	80 879	
HKD	65 000	China Life Insurance Co., Ltd., catégorie H	143 628	143 341	
CNY	116 900	China Merchants Bank Co., Ltd.	822 549	697 624	
HKD	28 500	China Merchants Bank Co., Ltd., catégorie H	199 651	171 320	
CNY	232 400	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	170 572	158 756	
HKD	57 500	China Minsheng Banking Corp., Ltd., catégorie H	29 235	28 157	
CNY	31 300	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	159 683	148 131	
HKD	20 200	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd., catégorie H	66 755	69 070	
CNY	77 905	CITIC Securities Co., Ltd.	319 010	280 708	
HKD	12 000	CITIC Securities Co., Ltd., catégorie H	33 924	28 773	
CNY	9 100	CSC Financial Co., Ltd.	44 773	40 116	
HKD	8 000	CSC Financial Co., Ltd., catégorie H	11 304	10 915	
CNY	108 024	East Money Information Co., Ltd.	362 645	279 429	
CNY	302 300	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	259 769	265 429	
HKD	614 000	Industrial & Commercial Bank of China, catégorie H	423 157	433 370	
CNY	136 200	Industrial Bank Co., Ltd.	471 455	388 288	
HKD	72 000	Peoples Insurance Co., (Group) of China Ltd.	31 905	34 527	
CNY	24 400	Peoples Insurance Co., (Group) of China Ltd.	26 225	25 958	
CNY	73 600	Ping An Bank Co., Ltd.	195 654	150 564	
CNY	81 200	Ping An Insurance (Group) Co., of China Ltd.	796 633	686 336	
HKD	53 700	Ping An Insurance (Group) Co., of China Ltd., catégorie H	500 688	452 016	
HKD	68 000	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	54 796	55 344	
CNY	96 800	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	86 611	86 228	
CNY	138 100	Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd.	207 165	182 136	
			7 939 732	7 435 097	16,6
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
HKD	134 800	Alibaba Group Holding Ltd.	2 087 085	1 848 247	
HKD	10 800	ANTA Sports Products Ltd. Sports Products Ltd.	181 517	145 982	
CNY	7 000	BYD Co., Ltd.	351 940	329 333	
HKD	7 500	BYD Co., Ltd., catégorie H	249 896	316 603	
CNY	7 900	China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd.	325 177	159 063	
HKD	500	China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd., catégorie H	11 342	8 949	
CNY	6 500	FAW Jiefang Group Co., Ltd.	10 079	9 911	
CNY	9 100	Great Wall Motor Co., Ltd.	58 745	41 724	
HKD	20 000	Great Wall Motor Co., Ltd., catégorie H	41 908	30 293	
CNY	37 800	Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai	266 061	251 401	
CNY	34 600	Haier Smart Home Co., Ltd.	167 293	147 992	
HKD	20 000	Haier Smart Home Co., Ltd.	88 340	83 246	
HKD	21 450	JD.com Inc., catégorie A	570 673	479 545	
HKD	20 000	Li Ning Co., Ltd.	221 601	142 345	
HKD	41 570	Meituan, catégorie B	1 249 114	858 462	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
CNY	41 015	Midea Group Co., Ltd.	435 217	440 219	
USD	12 393	NIO Inc., CAAE	265 416	158 907	
USD	4 689	PDDHoldings Inc., CAAE	539 537	428 994	
CNY	32 200	SAIC Motor Corp., Ltd.	99 484	83 117	
HKD	7 000	Shenzhou International Group	96 789	88 353	
USD	3 614	Yum China Holdings Inc.	278 473	270 195	
			7 595 687	6 322 881	14,2
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
CNY	25 700	360 Security Technology Inc.	40 531	58 708	
CNY	510	3Peak Inc.	30 467	20 253	
CNY	3 648	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc., Chine	78 154	103 967	
CNY	2 394	Amlogic (Shanghai) Co., Ltd.	36 799	36 772	
CNY	1 300	Anker Innovations Technology Co., Ltd.	15 423	20 721	
CNY	5 700	Avary Holding (Shenzhen) Co., Ltd.	33 334	25 221	
CNY	476	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co., Ltd.	20 085	13 267	
CNY	1 741	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	94 591	149 764	
CNY	9 848	Beijing Shiji Information Technology Co., Ltd.	24 798	25 115	
CNY	287 900	BOE Technology Group Co., Ltd.	215 805	214 500	
HKD	6 500	BYD Electronic (International) Co., Ltd.	29 612	26 012	
CNY	1 590	Cambricon Technologies Corp., Ltd.	65 720	54 453	
CNY	11 100	Chaozhou Three-Circle Group Co., Ltd.	66 827	59 346	
CNY	17 000	China Greatwall Technology Group Co., Ltd.	40 962	42 829	
CNY	4 424	China National Software & Service Co., Ltd.	42 370	37 780	
CNY	17 929	China Railway Signal & Communication Corp., Ltd.	16 674	18 943	
HKD	15 000	China Railway Signal & Communication Corp., Ltd., catégorie H	7 708	7 497	
CNY	3 820	China Resources Microelectronics Ltd.	41 459	36 470	
CNY	3 000	China Zhenhua (Group) Science & Technology Co., Ltd.	65 636	52 381	
CNY	700	Empyrean Technology Co., Ltd.	15 681	15 664	
CNY	30 272	Everdisplay Optronics (Shanghai) Co., Ltd.	14 430	14 007	
CNY	5 100	Flat Glass Group Co., Ltd.	34 973	35 777	
HKD	3 000	Flat Glass Group Co., Ltd., catégorie H	10 374	13 551	
CNY	41 200	Foxconn Industrial Internet Co., Ltd.	78 805	189 130	
HKD	165 000	GCL Technology Holdings Ltd.	60 407	50 429	
CNY	5 376	GigaDevice Semiconductor (Beijing) Inc.	110 973	104 052	
CNY	11 480	Glodon Co., Ltd.	91 480	67 945	
CNY	20 400	Goertek Inc.	80 475	65 962	
CNY	10 800	GRG Banking Equipment Co., Ltd.	21 488	23 058	
CNY	2 900	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co., Ltd.	38 805	35 310	
CNY	3 200	Hangzhou Chang Chuan Technology Co., Ltd.	29 863	27 683	
CNY	6 305	Hangzhou First Applied Material Co., Ltd.	52 894	42 714	
CNY	3 900	Hangzhou Lion Electronics Co., Ltd.	36 355	26 094	
CNY	7 100	Hangzhou Silan Microelectronics Co., Ltd.	48 118	39 150	
CNY	7 000	Hengdian Group DMEGC Magnetics Co., Ltd.	27 542	23 220	
CNY	15 800	Hengtong Optic-Electric Co., Ltd.	48 666	42 194	
HKD	5 000	Hua Hong Semiconductor Ltd.	24 817	21 613	
CNY	13 005	Hundsun Technologies Inc.	104 085	104 925	
CNY	15 700	iFlytek Co., Ltd.	110 462	194 364	
CNY	2 000	Ingenic Semiconductor Co., Ltd.	31 122	32 174	
CNY	8 100	Inspur Electronic Information Industry Co., Ltd.	38 286	71 563	
CNY	10 472	JA Solar Technology Co., Ltd.	81 961	79 548	
CNY	11 200	JCET Group Co., Ltd.	54 974	63 594	
CNY	1 400	Jiangsu Pacific Quartz Co., Ltd.	34 674	29 033	
CNY	11 333	Jinko Solar Co., Ltd.	28 335	29 026	
HKD	5 500	Kingboard Holdings Ltd.	24 642	19 828	
HKD	7 500	Kingboard Laminates Holding Ltd.	11 646	9 333	
HKD	24 000	Kingdee International Software Group Co., Ltd.	63 293	42 470	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
HKD	64 000	Lenovo Group Ltd.	69 561	88 291	
CNY	16 300	Lens Technology Co., Ltd.	40 906	34 919	
CNY	24 500	Lingyi iTech (Guangdong) Co.	25 865	30 839	
CNY	47 744	LONGi Green Energy Technology Co., Ltd.	416 705	249 350	
CNY	5 000	Longshine Technology Group Co., Ltd.	24 189	21 204	
CNY	37 596	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	245 556	222 239	
CNY	3 016	Maxscend Microelectronics Co., Ltd.	72 318	53 089	
CNY	6 234	Montage Technology Co., Ltd.	84 208	65 207	
CNY	8 097	National Silicon Industry Group Co., Ltd.	32 679	30 827	
CNY	2 100	NAURA Technology Group Co., Ltd.	94 648	121 515	
CNY	19 200	NavInfo Co., Ltd.	43 550	40 502	
CNY	6 700	Ninestar Corp.	66 238	41 802	
CNY	232	Piotech Inc.	18 417	18 002	
CNY	2 568	Qi An Xin Technology Group Inc.	28 421	24 237	
CNY	5 500	Risen Energy Co., Ltd.	26 242	25 679	
CNY	1 400	Rockchip Electronics Co., Ltd.	21 290	18 579	
CNY	22 600	Sanan Optoelectronics Co., Ltd.	73 607	70 975	
CNY	2 000	Sangfor Technologies Inc.	50 402	41 260	
CNY	2 600	SG Micro Corp.	67 851	38 899	
CNY	7 420	Shanghai Aiko Solar Energy Co., Ltd.	39 268	41 563	
CNY	5 288	Shanghai Baosight Software Co., Ltd.	36 064	48 944	
USD	4 763	Shanghai Baosight Software Co., Ltd., catégorie B	15 631	16 639	
CNY	378	Shanghai Friendess Electronic Technology Corp., Ltd.	13 816	12 984	
CNY	1 502	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd.	21 441	13 708	
HKD	2 000	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co., Ltd., catégorie H	11 392	6 504	
CNY	9 800	Shengyi Technology Co., Ltd.	30 798	25 350	
CNY	1 440	Shennan Circuits Co., Ltd.	23 467	19 771	
CNY	2 100	Shenzhen SC New Energy Technology Corp.	50 544	42 979	
CNY	3 300	Shenzhen SED Industry Co., Ltd.	24 034	19 778	
CNY	2 427	Shenzhen Transsion Holdings Co., Ltd.	40 652	64 991	
CNY	600	StarPower Semiconductor Ltd.	38 540	23 521	
HKD	6 200	Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	107 832	81 815	
CNY	11 100	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co., Ltd.	54 845	52 370	
CNY	2 600	Thunder Software Technology Co., Ltd.	57 245	45 634	
CNY	2 800	Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co., Ltd.	19 412	15 409	
CNY	25 500	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co., Ltd.	156 516	154 220	
CNY	10 400	Tianma Microelectronics Co., Ltd.	20 330	17 392	
CNY	22 100	Tianshui Huatian Technology Co., Ltd.	40 350	37 038	
CNY	7 200	TongFu Microelectronics Co., Ltd.	25 724	29 642	
CNY	21 900	Tongwei Co., Ltd.	183 937	136 876	
CNY	8 087	Trina Solar Co., Ltd.	93 997	62 771	
CNY	5 419	Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	135 464	92 052	
CNY	13 316	Unisplendour Corp., Ltd.	54 595	77 259	
CNY	4 700	Universal Scientific Industrial (Shanghai) Co., Ltd.	15 901	12 808	
CNY	5 700	Venustech Group Inc.	29 522	30 901	
CNY	1 825	Verisilicon Microelectronics (Shanghai) Co., Ltd.	29 631	23 910	
CNY	4 900	Westone Information Industry Inc.	35 594	24 877	
CNY	6 145	Will Semiconductor Ltd.	113 904	109 746	
CNY	6 200	Wingtech Technology Co., Ltd.	75 796	55 229	
CNY	13 228	Wuhan Guide Infrared Co., Ltd.	24 084	18 723	
CNY	11 280	WUS Printed Circuit (Kunshan) Co., Ltd.	29 380	43 028	
CNY	586	Wuxi Autowell Technology Co., Ltd.	20 929	20 111	
CNY	1 100	Xiamen Faratronic Co., Ltd.	36 233	27 512	
HKD	125 400	Xiaomi Corp., catégorie B	273 187	226 990	
CNY	2 381	Xinjiang Daqo New Energy Co., Ltd.	23 086	17 544	
HKD	40 000	Xinyi Solar Holdings Ltd.	62 100	61 126	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
CNY	1 200	Yangling Metron New Material Inc.	9 274	9 481	
CNY	2 300	Yangzhou Yangjie Electronic Technology Co., Ltd.	25 139	16 998	
CNY	4 340	Yealink Network Technology Corp., Ltd.	39 322	27 726	
CNY	18 314	Yonyou Network Technology Co., Ltd.	86 375	68 391	
CNY	14 600	Zhejiang Dahua Technology Co., Ltd.	39 138	52 527	
CNY	5 300	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co., Ltd.	68 329	68 452	
CNY	3 970	Zhejiang Supcon Technology Co., Ltd.	48 108	45 402	
CNY	5 100	Zhongji Innolight Co., Ltd.	29 792	136 987	
CNY	26 000	ZTE Corp.	139 869	215 690	
HKD	6 600	ZTE Corp.	20 838	34 994	
			6 450 659	6 243 188	14,0
PRODUITS INDUSTRIELS					
CNY	6 200	AECC Aero-Engine Control Co., Ltd.	31 355	27 558	
CNY	11 800	AECC Aviation Power Co., Ltd.	102 457	90 839	
CNY	27 400	Air China Ltd.	54 142	41 128	
HKD	16 000	Air China Ltd., catégorie H	18 426	15 075	
CNY	2 500	AVIC Helicopter Co., Ltd.	23 293	18 134	
HKD	21 000	AviChina Industry & Technology Co., Ltd., catégorie H	14 350	13 475	
CNY	3 400	Beijing Easpring Material Technology Co., Ltd.	43 033	31 172	
CNY	8 200	Beijing New Building Materials PLC	44 267	36 612	
CNY	4 255	Beijing United Information Technology Co., Ltd.	55 709	28 625	
CNY	201 200	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co., Ltd.	208 232	192 787	
CNY	1 500	Centre Testing International Group Co., Ltd.	7 663	5 328	
CNY	15 540	China Baoan Group Co., Ltd.	36 876	34 168	
CNY	15 300	Chine CSSC Holdings Ltd.	70 504	91 724	
CNY	52 200	China Eastern Airlines Corp., Ltd.	54 943	45 263	
HKD	18 000	China Eastern Airlines Corp., Ltd., catégorie H	8 367	8 054	
CNY	100 700	China Energy Engineering Corp., Ltd.	48 992	42 925	
CNY	14 830	China International Marine Containers (Group) Co., Ltd.	21 719	18 613	
CNY	10 100	China Merchants Expressway Network & Technology Holdings Co., Ltd.	17 687	17 663	
CNY	2 600	China Merchants Port Group Co., Ltd.	8 733	8 180	
HKD	12 000	China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	23 335	22 410	
CNY	30 000	China National Chemical Engineering Co., Ltd.	54 771	45 250	
HKD	37 000	China Railway Group Ltd., catégorie H	27 660	32 300	
CNY	78 000	China Railway Group Ltd.	92 310	107 703	
CNY	35 300	China Southern Airlines Co., Ltd.	51 112	38 775	
HKD	14 000	China Southern Airlines Co., Ltd., catégorie H	11 900	10 449	
CNY	8 800	China Southern Power Grid Energy Efficiency&Clean Energy Co., Ltd	13 843	11 414	
CNY	160 600	China State Construction Engineering Corp., Ltd.	178 865	167 927	
HKD	16 000	China State Construction International Holdings Ltd.	24 222	24 126	
HKD	55 000	CITIC Ltd.	75 110	86 834	
CNY	25 100	CNPC Capital Co., Ltd.	36 823	33 058	
CNY	19 560	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd.	875 246	815 209	
CNY	35 100	COSCO SHIPPING Development Co., Ltd.	17 980	15 793	
CNY	46 600	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	112 216	79 795	
HKD	29 850	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd., catégorie H	40 761	35 585	
CNY	84 800	CRRC Corp., Ltd.	91 039	100 409	
HKD	38 000	CRRC Corp., Ltd., catégorie H	21 038	27 527	
CNY	47 400	Daqin Railway Co., Ltd.	63 542	64 155	
CNY	9 000	Dongfang Electric Corp., Ltd.	35 393	30 576	
CNY	1 440	Dongguan Yiheda Automation Co., Ltd.	13 653	11 720	
CNY	3 300	Eastern Air Logistics Co., Ltd.	8 141	7 815	
CNY	10 700	EVE Energy Co., Ltd.	183 675	117 924	
CNY	19 660	Fangda Carbon New Material Co., Ltd.	26 226	22 204	
USD	5 409	Full Truck Alliance Co., Ltd., CAAE	61 277	44 519	
CNY	1 850	Ginlong Technologies Co., Ltd.	63 232	35 082	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		PRODUITS INDUSTRIELS (suite)			
CNY	900	Gongniu Group Co., Ltd.	17 307	15 749	
CNY	8 500	Gotion High-tech Co., Ltd.	53 013	42 767	
CNY	1 000	Guangdong KinLong Hardware Products Co., Ltd.	20 748	11 788	
CNY	8 900	Guangzhou Baiyun International Airport Co., Ltd.	23 506	23 249	
HKD	6 000	Haitian International Holdings Ltd.	21 318	18 520	
CNY	6 800	Han's Laser Technology Industry Group Co., Ltd.	38 446	32 454	
CNY	6 740	Hongfa Technology Co., Ltd.	44 933	39 105	
HKD	16 000	JD Logistics Inc.	45 354	33 015	
CNY	4 300	Jiangsu Expressway Co., Ltd.	7 553	7 700	
HKD	10 000	Jiangsu Expressway Co., Ltd., catégorie H	12 163	12 191	
CNY	774	Jiangsu GoodWe Power Supply Technology Co., Ltd.	31 711	23 526	
CNY	3 548	Jiangsu Hengli Hydraulic Co., Ltd.	44 340	41 578	
CNY	22 700	Jiangsu Zhongtian Technology Co., Ltd.	69 071	65 790	
CNY	12 800	Jiangxi Special Electric Motor Co., Ltd.	48 763	27 794	
CNY	6 200	Juneyao Airlines Co., Ltd.	19 018	17 427	
CNY	9 800	Keda Industrial Group Co., Ltd.	29 599	20 280	
CNY	11 300	Kuang-Chi Technologies Co., Ltd.	40 408	31 412	
CNY	56 800	Liaoning Port Co., Ltd.	18 757	16 141	
HKD	25 000	Metallurgical Corp. of China Ltd.	8 536	8 147	
CNY	57 100	Metallurgical Corp. of China Ltd.	37 782	41 294	
CNY	15 400	Ming Yang Smart Energy Group Ltd.	78 766	47 354	
CNY	29 952	NARI Technology Co., Ltd.	124 523	126 038	
CNY	1 260	Ningbo Deye Technology Co., Ltd.	46 299	34 326	
CNY	3 700	Ningbo Orient Wires & Cables Co., Ltd.	46 335	33 047	
CNY	2 395	Ningbo Ronbay New Energy Technology Co., Ltd.	36 780	23 568	
CNY	23 800	Ningbo Zhoushan Port Co., Ltd.	17 437	14 697	
CNY	8 800	North Industries Group Red Arrow Co., Ltd.	38 712	28 999	
HKD	1 000	Orient Overseas International Ltd.	25 007	17 747	
CNY	54 000	Power Construction Corp. of China Ltd.	75 500	56 464	
CNY	648	Pylon Technologies Co., Ltd.	38 817	23 402	
CNY	7 500	Qingdao Port International Co., Ltd.	9 751	9 523	
CNY	3 800	Sany Heavy Industry Co., Ltd.	16 656	13 145	
CNY	20 700	S.F. Holding Co., Ltd.	237 257	170 025	
CNY	52 000	SANY Heavy Industry Co., Ltd.	176 534	157 528	
CNY	5 500	Shandong Hi-Speed Co., Ltd.	6 376	6 382	
CNY	39 300	Shanghai Construction Group Co., Ltd.	21 413	19 258	
CNY	39 300	Shanghai Electric Group Co., Ltd.	33 271	32 717	
CNY	8 100	Shanghai International Airport Co., Ltd.	92 399	67 019	
CNY	54 200	Shanghai International Port (Group) Co., Ltd.	57 905	51 835	
CNY	3 400	Shanghai M&G Stationery Inc.	36 193	27 648	
CNY	15 850	Shenzhen Inovance Technology Co., Ltd.	215 094	185 394	
CNY	7 300	Sichuan New Energy Power Co., Ltd.	29 599	19 149	
CNY	15 820	Sichuan Road & Bridge Co., Ltd.	25 379	28 271	
CNY	4 700	Sieyuan Electric Co., Ltd.	40 771	40 000	
CNY	9 200	Sinoma International Engineering Co., Ltd.	22 388	21 368	
HKD	18 000	Sinotrans Ltd.	8 276	8 480	
CNY	10 564	Sinotrans Ltd.	8 494	8 968	
HKD	6 000	Sinotruk (Hong Kong) Ltd.	12 431	15 420	
HKD	11 000	SITC International Holdings Co., Ltd.	29 922	26 561	
CNY	3 800	Spring Airlines Co., Ltd.	41 548	39 782	
CNY	8 800	Sungrow Power Supply Co., Ltd.	176 840	186 963	
CNY	11 300	Sunwoda Electronic Co., Ltd.	54 145	33 594	
CNY	1 280	Suzhou Maxwell Technologies Co., Ltd.	68 446	39 494	
CNY	27 500	TBEA Co., Ltd.	106 529	111 662	
CNY	43 200	Weichai Power Co., Ltd.	97 695	98 054	
HKD	17 000	Weichai Power Co., Ltd., catégorie H	33 082	32 954	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
CNY	8 920	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd.	78 504	58 773	
CNY	1 640	Wuxi Shangji Automation Co., Ltd.	38 542	22 272	
CNY	41 800	XCMG Construction Machinery Co., Ltd.	44 938	51 550	
CNY	12 800	Xiamen C & D Inc.	33 889	25 439	
CNY	22 500	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd.	51 649	43 528	
HKD	7 000	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd., catégorie H	10 397	6 347	
HKD	23 000	Xinyi Glass Holdings Co., Ltd.	63 286	47 381	
SGD	23 500	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	30 927	34 466	
CNY	13 400	YTO Express Group Co., Ltd.	53 162	35 541	
CNY	12 119	Yunda Holding Co., Ltd.	35 528	21 105	
CNY	9 400	Zhejiang Chint Electrics Co., Ltd.	54 517	47 346	
CNY	1 900	Zhejiang Dingli Machinery Co., Ltd.	21 543	19 385	
CNY	14 845	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co., Ltd.	67 273	81 829	
CNY	5 480	Zhejiang Weiming Environmental Protection Co., Ltd.	21 153	17 479	
CNY	5 040	Zhejiang Weixing New Building Materials Co., Ltd.	20 839	18 858	
CNY	1 326	Zhuzhou CRRC Times Electric Co.	14 885	10 111	
HKD	4 900	Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd.	30 630	24 160	
CNY	14 000	Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd.	28 942	21 984	
CNY	41 400	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co., Ltd.	51 351	50 906	
HKD	14 000	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd.	10 404	9 574	
USD	3 622	ZTO Express (Cayman) Inc., CAAE	125 032	120 204	
			6 780 405	5 910 883	13,2
MATÉRIAUX					
CNY	66 300	Aluminum Corporation of China Ltd.	61 296	66 305	
HKD	34 000	Aluminum Corporation of China Ltd., catégorie H	19 810	19 347	
CNY	19 740	Angang Steel Co., Ltd.	11 052	9 997	
CNY	18 000	Anhui Conch Cement Co., Ltd.	111 798	77 842	
HKD	10 500	Anhui Conch Cement Co., Ltd., catégorie H	55 395	36 878	
CNY	3 190	Anhui Honglu Steel Construction Group Co., Ltd.	20 319	16 742	
CNY	73 700	Baoshan Iron & Steel Co., Ltd.	85 226	75 451	
CNY	32 100	BBMG Corp.	16 984	12 747	
CNY	16 000	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co., Ltd.	101 987	79 453	
CNY	10 900	Beijing Shougang Co., Ltd.	7 278	6 950	
CNY	5 600	Chengxin Lithium Group Co., Ltd.	50 293	32 511	
CNY	11 600	Chifeng Jilong Gold Mining Co., Ltd.	31 025	28 442	
HKD	17 000	China Hongqiao Group Ltd.	21 731	18 257	
CNY	19 671	China Jushi Co., Ltd.	55 833	50 740	
CNY	5 100	China Minmetals Rare Earth Co., Ltd.	32 472	27 500	
CNY	60 900	China Molybdenum Co., Ltd.	58 130	59 130	
HKD	33 000	China Molybdenum Co., Ltd., catégorie H	21 212	22 846	
HKD	40 000	China National Building Material Co., Ltd., catégorie H	48 055	32 555	
CNY	18 100	China Northern Rare Earth (Group) High-Tech Co., Ltd.	90 356	79 066	
HKD	20 000	China Resources Cement Holding Ltd.	16 897	10 908	
CNY	11 000	Citic Pacific Special Steel Group Co., Ltd.	39 854	31 740	
CNY	1 700	CNGR Advanced Material Co., Ltd.	28 012	18 658	
CNY	14 465	CNNC Hua Yuan Titanium Dioxide Co., Ltd.	21 968	15 520	
CNY	8 120	Do-Fluoride New Materials Co., Ltd.	44 527	29 376	
CNY	1 700	Fujian Kuncai Material Technology Co., Ltd.	16 680	15 484	
CNY	9 340	Ganfeng Lithium Co., Ltd.	140 747	103 718	
HKD	3 560	Ganfeng Lithium Co., Ltd., catégorie H	45 127	30 717	
CNY	41 200	GEM Co., Ltd.	62 911	51 861	
CNY	14 100	Guangdong HEC Technology Holding Co., Ltd.	24 644	18 519	
CNY	10 720	Guangzhou Tinci Materials Technology Co., Ltd.	102 947	80 436	
CNY	4 300	Hangjin Technology Co., Ltd.	24 378	26 139	
CNY	4 100	Hangzhou Oxygen Plant Group Co., Ltd.	30 527	25 663	
CNY	1 800	Haohua Chemical Science & Technology Co., Ltd.	14 524	12 342	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		MATÉRIAUX (suite)			
CNY	14 000	Henan Shenhuo Coal & Power Co., Ltd.	45 040	33 154	
CNY	16 400	Hengli Petrochemical Co., Ltd.	57 902	42 811	
CNY	16 590	Hengyi Petrochemical Co., Ltd.	26 265	20 490	
CNY	38 300	Hesteel Co., Ltd.	18 220	15 768	
CNY	1 700	Hoshine Silicon Industry Co., Ltd.	32 271	21 684	
CNY	12 100	Huafon Chemical Co., Ltd.	17 848	15 121	
CNY	7 700	Huaibei Mining Holdings Co., Ltd.	20 794	16 159	
CNY	5 020	Huaxin Cement Co., Ltd.	16 395	11 294	
CNY	3 500	Hubei Feilihua Quartz Glass Co., Ltd.	35 071	31 369	
CNY	6 400	Hubei Xingfa Chemicals Group Co., Ltd.	41 574	25 905	
CNY	7 532	Hunan Changyuan Lico Co., Ltd.	23 750	15 463	
CNY	32 140	Hunan Valin Steel Co., Ltd.	31 651	27 927	
CNY	176 900	Inner Mongolia Baotou Steel Union Co., Ltd.	67 031	57 682	
CNY	3 920	Inner Mongolia ERDOS Resources Co., Ltd.	7 130	6 405	
CNY	28 000	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Group Co., Ltd.	24 165	20 912	
CNY	22 400	Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co., Ltd.	36 289	29 339	
CNY	16 600	Jiangsu Eastern Shenghong Co., Ltd.	47 738	35 743	
CNY	1 600	Jiangsu Yangnong Chemical Co., Ltd.	32 990	25 480	
CNY	2 100	Jiangsu Yoke Technology Co., Ltd.	22 129	27 880	
CNY	7 500	Jiangxi Copper Co., Ltd.	26 035	25 931	
HKD	9 000	Jiangxi Copper Co., Ltd., série H	17 735	18 297	
CNY	7 600	Jinduicheng Molybdenum Group Co., Ltd.	15 872	15 437	
CNY	12 400	LB Group Co., Ltd.	47 788	37 271	
CNY	2 600	Levima Advanced Materials Corp.	15 356	11 793	
CNY	8 500	Luxi Chemical Group Co., Ltd.	21 921	16 351	
CNY	22 100	Maanshan Iron & Steel Co., Ltd.	12 594	10 346	
CNY	23 100	Nanjing Iron & Steel Co., Ltd.	15 171	14 181	
HKD	15 000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	17 336	12 234	
CNY	8 780	Ningbo Shanshan Co., Ltd.	33 649	24 215	
CNY	18 500	Ningxia Baofeng Energy Group Co., Ltd.	52 532	42 496	
CNY	31 700	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co., Ltd.	31 974	22 579	
CNY	29 400	Qinghai Salt Lake Industry Co., Ltd., catégorie A	140 673	102 667	
CNY	27 100	Rongsheng Petrochemical Co., Ltd., catégorie A	68 940	57 463	
CNY	16 105	Satellite Chemical Co., Ltd.	47 662	43 889	
CNY	279	Shaanxi Huaqin Technology Industry Co., Ltd.	10 453	10 292	
CNY	14 984	Shandong Gold Mining Co., Ltd.	61 044	64 090	
HKD	6 250	Shandong Gold Mining Co., Ltd.	16 536	15 070	
CNY	12 440	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co., Ltd.	74 781	69 411	
CNY	59 600	Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd.	40 304	32 788	
CNY	6 500	Shandong Sinocera Functional Material Co., Ltd.	38 977	32 443	
CNY	13 300	Shandong Sun Paper Industry Joint Stock Co., Ltd.	29 744	25 900	
CNY	7 598	Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd.	57 983	52 900	
CNY	20 200	Shanxi Meijin Energy Co., Ltd.	41 179	27 745	
CNY	18 500	Shanxi Taigang Stainless Steel Co., Ltd.	16 323	13 042	
CNY	11 300	Shenghe Resources Holding Co., Ltd.	32 624	26 492	
CNY	4 140	Shenzhen Capchem Technology Co., Ltd.	35 835	39 133	
CNY	1 600	Shenzhen Dynanonic Co., Ltd.	49 581	32 128	
CNY	9 598	Shenzhen Senior Technology Material Co., Ltd.	45 970	30 055	
CNY	3 300	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co., Ltd.	20 258	14 662	
CNY	56 200	Sichuan Hebang Biotechnology Co., Ltd.	36 047	24 877	
CNY	8 800	Sichuan Yahua Industrial Group Co., Ltd.	44 489	28 502	
CNY	6 000	Sinoma Science & Technology Co., Ltd.	28 122	22 428	
CNY	4 340	Sinomine Resource Group Co., Ltd.	47 643	40 273	
CNY	17 700	SINOPEC Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	11 599	10 028	
CNY	1 540	Skshu Paint Co., Ltd.	26 597	18 352	
CNY	1 950	Sunresin New Materials Co., Ltd.	22 829	22 173	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
MATÉRIAUX (suite)					
CNY	1 426	Suzhou Nanomicro Technology Co., Ltd.	15 289	10 092	
CNY	4 290	SuZhou TA&A Ultra Clean Technology Co., Ltd.	41 287	27 977	
CNY	8 700	Tangshan Jidong Cement Co., Ltd.	14 994	11 680	
CNY	9 220	Tianqi Lithium Corp.	151 425	117 418	
HKD	1 000	Tianqi Lithium Corp.	9 643	9 211	
CNY	13 400	Tianshan Aluminum Group Co., Ltd.	20 020	14 622	
CNY	14 000	Tongkun Group Co., Ltd.	41 739	33 791	
CNY	57 200	Tongling Nonferrous Metals Group Holdings Co., Ltd.	33 156	30 113	
CNY	15 800	Wanhua Chemical Group Co., Ltd.	283 134	252 821	
CNY	4 000	Weihai Guangwei Composites Co., Ltd.	34 746	22 479	
CNY	13 700	Western Mining Co., Ltd.	28 938	26 229	
CNY	3 357	Western Superconducting Technologies Co., Ltd.	45 335	34 080	
CNY	6 800	Xiamen Tungsten Co., Ltd.	27 869	23 573	
CNY	5 300	Xinjiang Tianshan Cement Co., Ltd.	8 336	7 859	
CNY	13 600	Yintai Gold Co., Ltd.	30 149	28 986	
CNY	2 340	YongXing Special Materials Technology Co., Ltd.	35 862	26 688	
CNY	1 700	YOUNGY Co., Ltd.	39 915	20 696	
CNY	17 300	Yunnan Aluminium Co., Ltd.	38 584	40 118	
CNY	27 500	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co., Ltd.	26 931	25 148	
CNY	9 600	Yunnan Copper Co., Ltd.	23 362	19 324	
CNY	4 400	Yunnan Energy New Material Co., Ltd.	122 175	77 227	
CNY	8 100	Yunnan Tin Co., Ltd.	21 480	22 945	
CNY	9 600	Yunnan Yuntianhua Co., Ltd.	42 724	29 852	
CNY	4 700	Zangge Mining Co., Ltd.	26 501	19 324	
HKD	12 000	Zhaojin Mining Industry Co., Ltd., série H	22 149	19 817	
CNY	9 500	Zhejiang Hailiang Co., Ltd.	21 990	20 784	
CNY	10 778	Zhejiang Huayou Cobalt Co., Ltd.	132 820	90 138	
CNY	11 100	Zhejiang Juhua Co., Ltd.	35 998	27 863	
CNY	21 600	Zhejiang Longsheng Group Co., Ltd.	37 899	36 790	
CNY	22 800	Zhongjin Gold Corp., Ltd.	44 360	42 904	
CNY	11 660	Zibo Qixiang Tengda Chemical Co., Ltd.	16 499	13 530	
CNY	124 300	Zijin Mining Group Co., Ltd.	242 832	257 451	
HKD	50 000	Zijin Mining Group Co., Ltd.	87 978	97 092	
			5 278 523	4 350 982	9,7
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
CNY	1 200	Anhui Gujing Distillery Co., Ltd.	64 730	54 077	
HKD	900	Anhui Gujing Distillery Co., Ltd., catégorie B	20 719	20 516	
HKD	26 000	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	156 739	129 512	
HKD	14 000	China Resources Beer (Holdings) Co., Ltd.	134 273	121 981	
CNY	15 447	Foshan Haitian Flavouring & Food Co., Ltd.	208 659	131 831	
CNY	6 400	Guangdong Haid Group Co., Ltd.	74 978	54 608	
CNY	9 000	Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd.	49 086	40 151	
CNY	47 800	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	299 926	246 595	
HKD	9 050	JD Health International Inc.	121 363	75 566	
CNY	5 000	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	147 931	119 636	
CNY	5 000	Kweichow Moutai Co., Ltd.	1 656 988	1 540 198	
CNY	6 200	Luzhou Laojiao Co., Ltd.	245 717	236 692	
CNY	20 732	Muyuan Foodstuff Co., Ltd.	207 820	159 185	
HKD	15 200	Nongfu Spring Co., Ltd.	114 467	111 005	
CNY	3 360	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	171 760	113 276	
CNY	2 700	Tsingtao Brewery Co., Ltd.	54 722	50 970	
HKD	4 000	Tsingtao Brewery Co., Ltd.	52 296	48 090	
CNY	46 800	Wens Foodstuffs Group Co., Ltd.	173 412	156 439	
CNY	15 100	Wuliangye Yibin Co., Ltd.	531 666	449 929	
CNY	4 800	Yihai Kerry Arawana Holdings Co., Ltd.	44 811	34 967	
			4 532 063	3 895 224	8,7

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SOINS DE SANTÉ					
CNY	33 745	Aier Eye Hospital Group Co., Ltd.	154 358	114 029	
CNY	1 880	Asymchem Laboratories (Tianjin) Co., Ltd.	52 416	40 363	
CNY	1 630	Autobio Diagnostics Co., Ltd.	22 720	15 360	
CNY	712	BeiGene Ltd.	15 506	14 152	
HKD	7 500	BeiGene Ltd.	150 603	136 013	
CNY	7 800	Beijing Tiantan Biological Products Corp., Ltd.	38 627	38 577	
CNY	5 600	Beijing Tongrentang Co., Ltd.	51 709	58 718	
CNY	2 366	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co., Ltd.	44 182	28 778	
CNY	2 000	BGI Genomics Co., Ltd.	24 378	21 856	
CNY	830	Bloomage Biotechnology Corp., Ltd.	18 223	13 481	
CNY	2 500	Changchun High & New Technology Industry (Group) Inc.	97 882	62 072	
HKD	16 500	China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	20 998	19 001	
CNY	3 200	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co., Ltd.	32 802	35 360	
CNY	3 100	Chongqing Taiji Industry Group Co., Ltd.	34 061	33 595	
CNY	9 600	Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd.	116 098	77 296	
HKD	73 040	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	109 952	83 989	
HKD	10 000	Genscript Biotech Corp.	38 576	29 719	
CNY	5 300	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	33 961	30 779	
CNY	2 900	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co., Ltd.	43 561	39 885	
HKD	2 000	Guangzhou Pharmaceutical Co., Ltd., catégorie H	8 130	7 987	
CNY	4 400	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd.	84 796	51 730	
HKD	1 100	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd.	15 577	8 293	
HKD	10 000	Hansoh Pharmaceutical Group Co., Ltd.	28 255	21 276	
CNY	6 480	Huadong Medicine Co., Ltd.	54 965	51 195	
CNY	8 385	Hualan Biological Engineering Inc.	39 148	34 230	
CNY	500	Huaxia Eye Hospital Group Co., Ltd.	6 425	5 551	
CNY	2 900	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co., Ltd.	17 644	15 341	
CNY	8 400	Humanwell Healthcare (Group) Co., Ltd.	38 297	41 223	
CNY	800	Imeik Technology Development Co., Ltd.	85 783	64 843	
HKD	10 000	Innovent Biologics Inc.	57 250	49 981	
CNY	375	iRay Technology Co., Ltd.	21 999	19 293	
CNY	3 700	Jafron Biomedical Co., Ltd.	26 225	15 624	
CNY	33 564	Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd.	289 657	292 868	
CNY	5 000	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co., Ltd.	32 995	32 780	
CNY	2 380	Joynn Laboratories (China) Co., Ltd.	29 362	17 732	
USD	486	Legend Biotech Corp., CAE	34 932	44 393	
CNY	11 100	Lepu Medical Technology (Beijing) Co., Ltd.	50 092	45 718	
CNY	3 590	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	25 375	25 446	
HKD	1 300	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	6 197	5 916	
HKD	6 800	MicroPort Scientific Corp.	26 399	16 259	
CNY	3 807	Nanjing King-friend Biochemical Pharmaceutical Co., Ltd.	13 861	9 362	
CNY	3 900	Ovctek China Inc.	29 495	21 448	
CNY	5 600	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	72 520	39 050	
HKD	1 650	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	13 565	6 742	
CNY	1 285	RemeGen Co., Ltd.	19 288	13 050	
HKD	1 000	RemeGen Co., Ltd., catégorie H	6 220	5 783	
HKD	21 600	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co., Ltd., catégorie H	44 962	37 348	
HKD	4 000	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd.	17 233	14 116	
CNY	9 400	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd.	65 669	52 911	
CNY	3 040	Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd.	35 594	21 343	
HKD	1 600	Shanghai Junshi Biosciences Co., Ltd.	6 802	6 160	
CNY	7 200	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co.	27 407	29 393	
HKD	6 700	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd.	15 678	17 558	
CNY	31 800	Shanghai RAAS Blood Products Co., Ltd.	36 557	43 505	
CNY	5 000	Shenzhen Kangtai Biological Products Co., Ltd.	40 309	23 127	
CNY	5 100	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	316 539	278 526	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SOINS DE SANTÉ (suite)					
CNY	2 400	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co., Ltd.	28 287	25 794	
CNY	4 200	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co., Ltd.	26 735	23 863	
CNY	6 600	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co., Ltd.	57 380	30 887	
CNY	8 100	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co., Ltd.	37 621	43 794	
HKD	87 000	Sino Biopharmaceutical Ltd.	73 728	50 094	
CNY	1 800	Topchoice Medical Investment Corp.	51 921	31 760	
CNY	13 900	Walvax Biotechnology Co., Ltd.	106 403	66 974	
CNY	1 200	Winner Medical Co., Ltd.	9 497	9 109	
CNY	18 016	WuXi AppTec Co., Ltd.	291 147	204 493	
HKD	3 479	WuXi AppTec Co., Ltd.	47 809	36 715	
HKD	30 400	WuXi Biologics (Cayman) Inc.	288 401	192 751	
CNY	13 300	Xian International Medical Investment Co., Ltd.	31 053	20 377	
CNY	5 680	Yunnan Baiyao Group Co., Ltd.	66 472	54 301	
CNY	2 500	Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co., Ltd.	130 996	130 411	
CNY	7 600	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co., Ltd.	32 905	25 488	
CNY	4 500	Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co., Ltd.	36 696	22 444	
CNY	13 760	Zhejiang NHU Co., Ltd.	54 312	38 601	
CNY	2 200	Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co., Ltd.	22 596	13 478	
			4 235 774	3 401 458	7,6
SERVICES DE COMMUNICATION					
HKD	16 000	NetEase Inc.	421 079	412 277	
HKD	52 700	Tencent Holdings Ltd.	3 006 867	2 950 796	
			3 427 946	3 363 073	7,5
SERVICES PUBLICS					
HKD	97 000	CGN Power Co., Ltd.	30 578	30 956	
CNY	51 400	CGN Power Co., Ltd.	28 017	29 120	
HKD	26 600	China Gas Holdings Ltd.	53 303	40 289	
HKD	29 000	China Longyuan Power Group Corp.	49 300	39 517	
CNY	67 400	China National Nuclear Power Co., Ltd.	81 587	86 559	
HKD	7 900	China Resources Gas Group Ltd.	42 674	35 750	
HKD	16 000	China Resources Power Holdings Co., Ltd.	37 861	47 820	
CNY	74 400	China Three Gorges Renewables (Group) Co., Ltd.	82 905	72 780	
CNY	96 000	China Yangtze Power Co., Ltd.	390 219	385 780	
CNY	20 300	Datang International Power Generation Co. Ltd.	12 676	12 240	
CNY	9 700	ENN Ecological Holdings Co., Ltd.	33 020	33 538	
CNY	67 700	GD Power Development Co., Ltd.	52 089	47 234	
HKD	24 000	Guangdong Investment Ltd.	34 827	27 395	
CNY	11 000	Guangxi Guiguan Electric Power Co., Ltd.	12 662	11 161	
CNY	25 700	Huadian Power International Co., Ltd.	26 652	31 320	
HKD	14 000	Huadian Power International Corp., Ltd., catégorie H	8 661	9 669	
CNY	15 700	Huaneng Lancang River Hydropower Inc.	19 807	20 392	
CNY	37 900	Huaneng Power International Inc.	52 779	63 931	
HKD	32 000	Huaneng Power International Inc., catégorie H	18 771	26 476	
HKD	34 000	Kunlun Energy Co., Ltd.	34 380	35 364	
CNY	22 700	SDIC Power Holdings Co., Ltd.	50 608	52 309	
CNY	13 800	Sichuan Chuantou Energy Co., Ltd.	31 486	37 834	
CNY	37 400	Zhejiang Zheneng Electric Power Co., Ltd.	32 880	34 542	
			1 217 742	1 211 976	2,7
ÉNERGIE					
HKD	18 000	China Coal Energy Co., catégorie H	20 891	17 689	
CNY	13 400	China Coal Energy Co., Ltd.	22 605	20 602	
CNY	4 900	China Oilfield Services Ltd.	16 171	12 389	
HKD	16 000	China Oilfield Services Ltd., catégorie H	25 971	21 857	
CNY	108 000	China Petroleum & Chemical Corp.	96 620	125 125	
HKD	214 000	China Petroleum & Chemical Corp., catégorie H	139 575	165 860	
HKD	29 000	China Shenhua Energy Co., Ltd.	110 201	117 278	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ÉNERGIE (suite)					
CNY	22 800	China Shenhua Energy Co., Ltd.	123 785	127 715	
CNY	127 000	PetroChina Co., Ltd.	127 660	172 818	
HKD	182 000	PetroChina Co., Ltd., catégorie H	110 968	166 565	
CNY	29 600	Shaanxi Coal Industry Co., Ltd.	106 909	98 082	
HKD	12 000	Yankuang Energy Group Co., Ltd., catégorie H	47 421	45 490	
CNY	6 900	Yanzhou Coal Mining Co., Ltd.	48 703	37 607	
			997 480	1 129 077	2,5
IMMOBILIER					
CNY	23 600	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co., Ltd.	69 172	56 017	
HKD	32 500	China Overseas Land & Investment Ltd.	109 778	93 731	
HKD	24 000	China Resources Land Ltd.	137 923	134 544	
HKD	5 200	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd.	35 051	34 156	
HKD	17 300	China Vanke Co., Ltd.	50 442	30 731	
CNY	56 800	China Vanke Co., Ltd.	217 495	145 064	
HKD	94 000	Country Garden Holdings Co., Ltd.	55 644	25 237	
HKD	17 000	Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	69 246	29 050	
HKD	21 000	ESR Group Ltd.	62 298	47 658	
CNY	35 800	Gemdale Corp.	78 107	47 020	
CNY	31 900	Greenland Holdings Corp., Ltd.	17 158	15 980	
USD	5 798	KE Holdings Inc., CAAE	138 267	113 932	
HKD	15 000	Longfor Group Holdings Ltd.	65 969	48 225	
CNY	64 600	Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd.	197 175	153 335	
CNY	6 500	Seazen Holdings Co., Ltd.	29 004	17 062	
CNY	8 620	Shanghai Lingang Holdings Co., Ltd.	21 739	18 765	
CNY	5 560	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co., Ltd.	11 175	9 997	
HKD	1 500	Shimao Group Holdings Ltd.	7 309	-	
CNY	24 240	Youngor Group Co., Ltd.	31 210	27 863	
CNY	21 600	Zhejiang China Commodities City Group Co., Ltd.	23 891	33 563	
			1 428 053	1 081 930	2,4
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			49 884 064	44 345 769	99,1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(60 611)		
Total du portefeuille de placements			49 823 453	44 345 769	99,1
Autres actifs (passifs) nets				395 346	0,9
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				44 741 115	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	17	1
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 900 000	300 000
Parts rachetables émises	200 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 100 000	300 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,550

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	229	48
Garanties (hors trésorerie)	242	52

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	2	-
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	34,7	-

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Biens de consommation discrétionnaire	16,4
Services Financiers	16,3
Technologies de l'information	11,6
Produits industriels	10,3
Matériaux	10,1
Biens de consommation de base	9,6
Soins de santé	8,3
Services de communication	7,7
Énergie	4,2
Immobilier	2,7
Services publics	2,3
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions chinoises et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale en Chine.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement global S&P Chine 500	4 433 837

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement global S&P Chine 500	4 388 402

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Renminbi chinois	29 013	-	29 013	64,8
Dollar de Hong Kong	14 463	-	14 463	32,3
Dollar américain	1 253	-	1 253	2,8
Dollar de Singapour	38	-	38	0,1
Total	44 767	-	44 767	100,0

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Renminbi chinois	27 746	-	27 746	62,8
Dollar de Hong Kong	11 323	-	11 323	25,6
Dollar américain	4 897	-	4 897	11,1
Dollar de Singapour	33	-	33	0,1
Total	43 999	-	43 999	99,6

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 4 477 000 \$ (4 400 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	44 346	-	-	44 346
Total	44 346	-	-	44 346

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	43 935	-	-	43 935
Total	43 935	-	-	43 935

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	45 584	43 665
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	1 328	828
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	24	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	3	3
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	39	54
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	46 978	44 550
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	1
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	34	33
Comptes créditeurs et charges à payer	12	10
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	46	44
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	46 932	44 506

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts ONE CI	46 932	44 506	33,52	30,69	1 400 000

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	744	331
Intérêts aux fins des distributions	20	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	228
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	540
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 457	(213)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 458	(7 883)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	4 679	(6 997)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(38)	11
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	8	21
Rabais sur frais	17	20
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	(13)	52
Total des revenus	4 666	(6 945)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	196	199
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	31	17
Taxe de vente harmonisée	15	15
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	2
Total des charges	244	236
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 422	(7 181)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
	Parts ONE CI	4 422	(7 181)	3,08	(5,01)	1 434 254

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ONE CI	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	44 506	48 616
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 422	(7 181)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(399)	(90)
Profits nets réalisés	-	(219)
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(399)	(309)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 638	3 149
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 235)	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 597)	3 149
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 426	(4 341)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	46 932	44 275

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 422	(7 181)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 457)	213
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(7)	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	2
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 458)	7 883
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 230	536
Achat de placements et de dérivés	(832)	(541)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	15	(2)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	(4)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	2
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	916	907
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(399)	(309)
Produit de l'émission de parts rachetables	77	56
Montant versé au rachat de parts rachetables	(101)	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(423)	(253)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	7	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	493	654
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	828	115
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	1 328	770
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	729	539
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	20	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	170 651	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts couvertes)	4 577 022	5 356 734	
	56 281	FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI (Parts couvertes)	1 469 109	1 598 099	
USD	23 086	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	1 544 473	1 507 445	
USD	23 760	iShares Global REIT ETF	764 541	723 005	
USD	9 588	iShares Micro-Cap ETF	1 167 828	1 388 296	
USD	32 573	iShares MSCI EAFE Small-Cap ETF	2 736 616	2 545 051	
USD	3 106	iShares Russell 2000 Growth ETF	755 637	998 467	
USD	7 075	iShares Russell 2000 Value Index Fund	1 100 603	1 319 663	
	14 955	iShares S&P/TSX Capped REIT Index ETF	256 352	243 168	
	91 823	iShares S&P/TSX Completion Index Fund	2 446 890	2 791 419	
USD	6 500	FNB SPDR KBW Regional Banking	365 564	351 582	
			17 184 635	18 822 929	40,1
É.-U.					
USD	918	Adobe Inc.	444 285	594 671	
USD	4 671	Aflac Inc.	251 303	431 916	
USD	4 592	Alphabet Inc., catégorie C	365 399	735 891	
USD	2 125	Amazon.com Inc.	479 674	366 976	
USD	1 318	Amgen Inc.	329 833	387 651	
USD	3 337	Apple Inc.	260 152	857 482	
USD	9 231	Bank of America Corp.	329 732	350 843	
USD	1 094	Boeing Co. (The)	204 412	306 029	
USD	1 145	Cigna Corp.	263 372	425 625	
USD	4 788	Cisco Systems Inc.	235 364	328 182	
USD	3 446	Citigroup Inc.	295 117	210 177	
USD	5 685	DuPont de Nemours Inc.	535 271	538 029	
USD	929	Home Depot Inc. (The)	227 760	382 302	
USD	3 646	Intel Corp.	192 192	161 516	
USD	2 253	Johnson & Johnson	399 573	494 021	
USD	1 548	Meta Platforms Inc., catégorie A	367 294	588 514	
USD	2 146	Microsoft Corp.	323 096	968 127	
USD	3 233	NVIDIA Corp.	293 101	1 811 760	
USD	4 164	Pfizer Inc.	193 137	202 336	
USD	2 561	Procter & Gamble Co. (The)	327 615	514 806	
USD	630	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	326 454	599 688	
USD	3 693	RPM International Inc.	281 101	438 986	
USD	2 607	Salesforce Inc.	588 679	729 612	
USD	1 716	Target Corp.	205 115	299 844	
USD	540	Visa Inc., catégorie A	131 334	169 885	
			7 850 365	12 894 869	27,5
CANADA					
	9 126	Alimentation Couche-Tard Inc.	318 779	619 929	
	8 101	BCE Inc.	477 020	489 300	
	4 823	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	516 336	773 706	
	19 090	Canadian Natural Resources Ltd.	776 848	1 421 824	
	2 477	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	375 362	448 634	
	4 800	CCL Industries Inc., catégorie B	264 934	312 576	
	3 846	CGI inc.	345 330	537 286	
	5 997	Emera Inc.	296 718	327 196	
	9 650	Enbridge Inc.	404 832	475 166	
	6 047	Fortis Inc.	280 047	345 223	
	9 205	Les Compagnies Loblaw limitée	578 092	1 116 383	
	25 230	Société Financière Manuvie	591 347	631 759	
	6 750	Banque Royale du Canada	663 981	854 010	
	10 417	Financière Sun Life inc.	531 646	719 398	
	28 992	Suncor Énergie Inc.	985 637	1 126 630	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		CANADA (suite)			
	10 355	TELUS Corp.	242 864	266 952	
	4 629	Industries Toromont Limitée	272 431	503 774	
	9 149	Banque Toronto-Dominion (La)	706 245	751 224	
	16 320	Transcontinental Inc., catégorie A	245 737	239 251	
	6 379	West Fraser Timber Co., Ltd.	440 212	725 994	
			9 314 398	12 686 215	27,0
		R.-U.			
USD	3 968	BAE Systems PLC, CAAE	169 845	252 107	
USD	3 812	BP PLC, CAAE	174 898	178 213	
USD	2 364	Unilever PLC, CAAE	165 290	163 256	
			510 033	593 576	1,3
		ALLEMAGNE			
USD	1 402	SAP SE, CAAE	203 027	254 097	0,5
		SUISSE			
USD	4 473	Roche Holding AG, CAAE	187 705	226 358	0,5
		PAYS-BAS			
USD	3 693	Koninklijke Philips NV, CAAE	177 138	106 114	0,2
		Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	35 427 301	45 584 158	97,1
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(4 272)		
		Total du portefeuille de placements avant les dérivés	35 423 029	45 584 158	97,1
		Contrat(s) de change à terme		23 575	0,1
		Total du portefeuille de placements	35 423 029	45 607 733	97,2
		Autres actifs (passifs) nets		1 324 630	2,8
		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		46 932 363	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Nationale du Canada, Toronto	A-1	20 juillet 2023	CAD	7 000 000	USD	5 267 514	1,33	23 575
		Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme						23 575

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	24	-	-	24
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	24	-	-	24
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	-	-	(1)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	-	-	(1)

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne	21 950	1 598	7,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité	195 462	5 357	2,7
iShares S&P/TSX Completion Index Fund	924 768	2 791	0,3
iShares Global REIT ETF	698 174	723	0,1
iShares S&P/TSX Capped FPI Index FNB	265 038	243	0,1
iShares MSCI EAFE Small-Cap FNB	4 603 111	2 545	0,1
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	1 507	-
FNB SPDR KBW Regional Banking	2 205 975	352	-
iShares Micro-Cap ETF	15 808 193	1 388	-
iShares Russell 2000 Value Index Fund	26 232 955	1 320	-
iShares Russell 2000 Growth FNB	77 918 088	998	-

au 31 décembre 2022

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne	21 763	1 625	7,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité	152 886	4 951	3,2
iShares S&P/TSX Completion Index Fund	180 544	2 774	1,5
iShares Micro-Cap ETF	1 217 185	1 450	0,1
iShares S&P/TSX Capped FPI Index FNB	1 046 982	256	-
iShares Global REIT ETF	4 004 318	757	-
iShares MSCI EAFE Small-Cap FNB	14 640 520	2 580	-
iShares Russell 2000 Value Index Fund	16 218 843	1 376	-
iShares Russell 2000 Growth FNB	12 968 163	934	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	85 893 629	1 512	-

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ONE CI	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 450 000	1 400 000
Parts rachetables émises	50 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 400 000	1 500 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts ONE CI	0,850

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	1 774
Garanties (hors trésorerie)	-	1 877

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	12	39
Charges	(4)	(18)
Revenu tiré des prêts de titres	8	21
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	32,0	47,3

Related Party Investments (Note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité	
WisdomTree CI (parts couvertes)	5 357
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation	
WisdomTree CI (parts couvertes)	1 598

Placements	2022
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité	
WisdomTree CI	5 994
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation	
WisdomTree CI	1 631

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Fonds négocié(s) en bourse	40,8
Canada	31,2
É.-U.	23,5
Autres actifs (passifs) nets	1,9
R.-U.	1,3
Suisse	0,6
Allemagne	0,5
Pays-Bas	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,0
Brésil	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 4 558 000 \$ (4 367 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	23 345	(6 976)	16 369	34,9
Total	23 345	(6 976)	16 369	34,9

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	20 747	(7 001)	13 746	30,9
Total	20 747	(7 001)	13 746	30,9

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 637 000 \$ (1 375 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	26 761	-	-	26 761
Fonds négocié(s) en bourse	18 823	-	-	18 823
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	24	-	24
Total	45 584	24	-	45 608

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	25 451	-	-	25 451
Fonds négocié(s) en bourse	18 214	-	-	18 214
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(1)	-	(1)
Total	43 665	(1)	-	43 664

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	87 013	67 916
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	1 475	139
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	6	6
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	440	308
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	400	-
	89 334	68 369
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	38	34
Comptes créditeurs et charges à payer	8	8
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	46	42
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	89 288	68 327

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts ONE CI	89 288	68 327	46,99	47,12	1 900 000

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	524	-
Intérêts aux fins des distributions	735	767
Distributions de revenu provenant des placements	-	462
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	56
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(508)	(76)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	142	(5 830)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	893	(4 621)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	8	4
Rabais sur frais	36	43
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	44	47
Total des revenus	937	(4 574)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	220	249
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	18	20
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	2
Total des charges	239	273
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	698	(4 847)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts ONE CI	698	(4 847)	0,41	(2,59)	1 703 591	1 872 376

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ONE CI	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	68 327	91 048
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	698	(4 847)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(1 057)	(831)
Profits nets réalisés	-	(211)
Remboursement de capital	(25)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 082)	(1 042)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	21 345	4 946
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	21 345	4 946
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20 961	(943)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	89 288	90 105

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	698	(4 847)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	508	76
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(142)	5 830
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	10 059	6 525
Achat de placements et de dérivés	(9 914)	(5 237)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(132)	(3)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	4	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	1
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	1 081	2 344
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 082)	(1 042)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 337	295
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	255	(747)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 336	1 597
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	139	2 144
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	1 475	3 741
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	524	462
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	603	763
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS				
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE				
85 638	FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI (parts non couvertes)	4 116 230	3 649 035	
838 038	FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI (parts non couvertes)	40 096 546	37 829 035	
	Total des actions	44 212 776	41 478 070	46,4
OBLIGATIONS				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS				
799 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	785 494	778 516	
1 460 000	Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	1 474 011	1 413 499	
2 300 000	AltaGas Ltd., 3,84 %, 15 janvier 2025	2 413 265	2 236 263	
2 310 000	AltaGas Ltd., 3,98 %, 4 octobre 2027	2 406 766	2 189 018	
2 788 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	2 871 770	2 704 101	
2 300 000	Bank of America Corp., taux variable, 16 mars 2028	2 195 188	2 152 979	
1 084 000	Banque de Montréal, 3,19 %, 1 ^{er} mars 2028	1 017 157	1 013 916	
1 000 000	Bell Canada, 2,9 %, 12 août 2026	937 471	935 584	
930 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	970 175	928 706	
1 500 000	Brookfield Asset Management Inc., 3,8 %, 16 mars 2027	1 437 237	1 417 810	
3 459 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,8 %, 22 septembre 2025	3 568 445	3 294 855	
3 978 000	Capital Power Corp., 4,28 %, 18 septembre 2024	4 200 126	3 894 787	
1 027 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	1 058 600	961 918	
2 300 000	Dollarama Inc., 1,51 %, 20 septembre 2027	2 012 010	1 996 084	
1 000 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 4,41 %, 19 mai 2027	984 582	971 079	
1 500 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 30 novembre 2027	1 348 500	1 360 551	
1 000 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	887 060	880 316	
1 084 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 4,49 %, 11 décembre 2028	1 070 815	1 063 713	
1 118 000	Mullen Group Ltd., convertibles, 5,75 %, 30 novembre 2026	1 286 639	1 330 420	
1 116 000	Banque Nationale du Canada, 2,24 %, 4 novembre 2026	1 009 923	1 014 449	
1 770 000	Pembina Pipeline Corp., 3,71 %, 11 août 2026	1 889 022	1 688 138	
1 186 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	1 193 757	1 155 408	
2 300 000	TELUS Corp., 3,63 %, 1 ^{er} mars 2028	2 199 268	2 160 890	
1 187 000	Industries Toromont Limitée, 3,84 %, 27 octobre 2027	1 198 342	1 133 130	
1 116 000	Banque Toronto Dominion (La), 2,26 %, 7 janvier 2027	1 008 036	1 011 248	
1 500 000	Toyota Credit Canada Inc., 4,33 %, 24 janvier 2028	1 521 270	1 458 708	
2 220 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	2 333 467	2 056 024	
1 000 000	Verizon Communications Inc., 2,38 %, 22 mars 2028	915 641	889 261	
381 000	Wells Fargo & Co., 2,49 %, 18 février 2027	354 242	343 728	
1 025 000	Wells Fargo & Co., 2,98 %, 19 mai 2026	985 578	953 848	
		47 533 857	45 388 947	50,8
OBLIGATIONS PROVINCIALES				
155 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 20 septembre 2029	152 686	145 775	0,2
	Total des obligations	47 686 543	45 534 722	51,0
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		91 899 319	87 012 792	97,4
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-	-	
Total du portefeuille de placements		91 899 319	87 012 792	97,4
Autres actifs (passifs) nets			2 275 468	2,6
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			89 288 260	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement	47 447	37 829	79,7
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	13 242	3 649	27,6

au 31 décembre 2022

	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Entités structurées non consolidées			
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement	40 648	30 685	75,5
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	13 065	2 772	21,2

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ONE CI	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 450 000	1 800 000
Parts rachetables émises	450 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 900 000	1 900 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts ONE CI	0,550

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	219
Garanties (hors trésorerie)	-	230

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	12	6
Charges	(4)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	8	4
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	38,7

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI (parts non couvertes)	3 649
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI (parts non couvertes)	37 829

Placements	2022
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	41 756
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	3 675

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Fonds négocié(s) en bourse	49,0
Services Financiers	13,8
Services publics	9,3
Produits industriels	6,5
Biens de consommation discrétionnaire	5,0
Énergie	4,3
Biens de consommation de base	3,8
Services de communication	3,4
Technologies de l'information	3,0
Matériaux	1,1
Autres actifs (passifs) nets	0,6
Obligations et garanties provinciales	0,2
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	2,2
AA/Aa/A+	6,1
A	12,2
BBB/Baa/B++	27,9
B	1,1
Aucune	1,5
Total	51,0

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AA/Aa/A+	4,2
A	15,0
BBB/Baa/B++	29,7
Aucune	1,5
Total	50,4

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisque certains de ses actifs étaient investis dans un Fonds négocié en bourse.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 4 148 000 \$ (3 346 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	2 084	15 276	26 965	1 210	45 535

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	5 614	14 341	11 375	3 129	34 459

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 341 000 \$ (222 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	45 535	-	45 535
Fonds négocié(s) en bourse	41 478	-	-	41 478
Total	41 478	45 535	-	87 013

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	34 459	-	34 459
Fonds négocié(s) en bourse	33 457	-	-	33 457
Total	33 457	34 459	-	67 916

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	528 943	449 968
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 702	1 065
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	48	42
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	1 663	1 521
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	533 356	452 596
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	89	82
Comptes créditeurs et charges à payer	63	85
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	152	167
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	533 204	452 429

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts non couvertes	533 204	452 429	34,66	33,55	15 385 740

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	10 340	7 258
Intérêts aux fins des distributions	26	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(7 176)	9 490
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	21 662	(57 755)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	24 852	(41 007)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(6)	(26)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	8	4
Rabais sur frais	278	232
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	29	-
Total des autres revenus	309	210
Total des revenus	25 161	(40 797)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	529	455
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	94	155
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	11
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	24	23
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	11
Total des charges	648	656
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	24 513	(41 453)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts non couvertes	24 513	(41 453)	1,66	(3,27)	14 740 436	12 696 141

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	452 429	415 966
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	24 513	(41 453)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(6 699)	(4 905)
Profits nets réalisés	(478)	(1 117)
Remboursement de capital	(68)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(7 245)	(6 022)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	112 373	178 627
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	2 404
Acquisition des actifs de fonds clôturés	-	23 513
Rachat de parts rachetables	(48 866)	(101 824)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	63 507	102 720
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	80 775	55 245
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	533 204	471 211

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	24 513	(41 453)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	7 176	(9 490)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	94	155
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(21 662)	57 755
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	234 028	257 130
Achat de placements et de dérivés	(235 664)	(354 675)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(142)	(834)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	7	15
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(29)	28
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	8 321	(91 369)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(7 245)	(3 619)
Produit de l'émission de parts rachetables	972	95 704
Montant versé au rachat de parts rachetables	(411)	(799)
Acquisition des actifs de fonds dissous	-	264
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(6 684)	91 550
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 637	181
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 065	415
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	2 702	596
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10 198	6 424
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	26	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(11)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ÉNERGIE				
669 436	ARC Resources Ltd.	12 304 763	11 828 934	
347 739	Canadian Natural Resources Ltd.	26 532 748	25 899 601	
99 437	Enerplus Corp.	2 141 889	1 909 191	
344 833	Gibson Energy Inc.	7 891 966	7 182 871	
406 181	Imperial Oil Ltd.	26 142 549	27 530 948	
485 074	Keyera Corp.	15 872 171	14 819 011	
214 205	Paramount Resources Ltd., catégorie A	6 241 071	6 169 104	
147 477	Parex Resources Inc.	3 705 041	3 916 989	
608 705	Pembina Pipeline Corp.	27 334 482	25 352 563	
181 935	Tourmaline Oil Corp.	10 177 135	11 356 383	
112 813	Vermilion Energy Inc.	2 212 461	1 863 671	
		140 556 276	137 829 266	25,8
PRODUITS INDUSTRIELS				
165 681	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	24 239 937	26 578 546	
230 170	Canadian Pacific Kansas City Ltd.	21 563 852	24 628 190	
126 230	Finning International Inc.	4 450 125	5 143 873	
24 953	Richelieu Hardware Ltd.	964 353	1 045 531	
90 883	Métaux Russel Inc.	3 217 445	3 335 406	
34 973	Stantec Inc.	2 258 242	3 024 815	
32 823	TFI International Inc.	3 961 476	4 953 975	
152 021	Thomson Reuters Corp.	25 893 356	27 190 476	
41 849	Industries Toromont Limitée	4 332 540	4 554 427	
61 098	Waste Connections Inc.	10 051 986	11 567 684	
36 023	WSP Global Inc.	5 787 069	6 304 746	
		106 720 381	118 327 669	22,2
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE				
17 831	BRP Inc. du Canada	1 872 735	1 996 894	
76 369	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	13 016 745	13 831 953	
29 048	Dollarama Inc.	1 990 174	2 606 186	
143 813	Gildan Activewear Inc.	6 074 488	6 142 253	
328 939	Magna International Inc.	27 282 657	24 601 348	
21 886	Pet Valu Holdings Ltd.	679 939	665 334	
255 284	Restaurant Brands International Inc.	20 152 987	26 220 220	
18 553	Spin Master Corp.	671 329	650 283	
		71 741 054	76 714 471	14,4
SERVICES FINANCIERS				
145 253	Brookfield Asset Management Ltd., catégorie A	6 171 103	6 280 740	
333 625	CI Financial Corp.	5 606 515	5 017 720	
56 194	Definity Financial Corp.	1 965 526	1 975 219	
12 474	Fairfax Financial Holdings Ltd.	12 175 923	12 377 825	
408 179	Société financière IGM Inc.	16 673 954	16 461 859	
125 350	Intact Corporation financière	24 820 359	25 639 089	
		67 413 380	67 752 452	12,7
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE				
264 594	Alimentation Couche-Tard Inc.	14 708 897	17 973 870	
169 972	Empire Co., Ltd., catégorie A	6 182 003	6 396 046	
151 841	Les Compagnies Loblaw limitée	17 659 236	18 415 277	
125 278	Metro inc.	8 300 077	9 373 300	
299 758	Saputo inc.	10 466 700	8 896 818	
		57 316 913	61 055 311	11,5

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SERVICES DE COMMUNICATION				
289 582	Québecor Inc., catégorie B	8 908 743	9 454 852	
439 093	Rogers Communications Inc., catégorie B	27 354 616	26 538 781	
		36 263 359	35 993 633	6,7
MATÉRIAUX				
1 937 955	B2Gold Corp.	10 033 625	9 147 148	
95 610	CCL Industries Inc., catégorie B	5 993 865	6 226 123	
63 718	Stelco Holdings Inc.	2 692 015	2 753 892	
28 037	Stella-Jones Inc.	1 264 435	1 912 684	
47 503	West Fraser Timber Co., Ltd.	4 822 487	5 406 316	
		24 806 427	25 446 163	4,8
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION				
1 474	Constellation Software Inc.	2 958 587	4 045 776	0,8
IMMOBILIER				
8 716	FirstService Corp.	1 696 148	1 778 238	0,3
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		509 472 525	528 942 979	99,2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(102 221)		
Total du portefeuille de placements		509 370 304	528 942 979	99,2
Autres actifs (passifs) nets			4 261 200	0,8
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			533 204 179	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	92	142
Paiements indirects [†]	32	61

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13 485 740	11 879 440
Parts rachetables émises	3 300 000	5 350 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Émission de parts rachetables liée à l'acquisition des actifs de fonds clôturés	-	656 300
Parts rachetables rachetées	(1 400 000)	(2 950 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	15 385 740	14 935 740

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,210

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	12 153
Garanties (hors trésorerie)	-	12 800

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	11	6
Charges	(3)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	8	4
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	39,8

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
CI Financial Corp.	5 018

Placements	2022
CI Financial Corp.	4 932

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Énergie	21,9
Services de communication	16,9
Produits industriels	16,4
Services Financiers	13,0
Biens de consommation discrétionnaire	12,9
Biens de consommation de base	8,8
Matériaux	8,6
Technologies de l'information	0,7
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Services publics	0,3
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	52 716 703

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	44 913 409

Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	528 943	-	-	528 943
Total	528 943	-	-	528 943

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	449 968	-	-	449 968
Total	449 968	-	-	449 968

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	64 670	63 307
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	187	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	5	6
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	693	238
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	13	950
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	2 384
	65 568	66 885
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	67
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	5	2 381
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	21	20
Comptes créditeurs et charges à payer	238	186
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	264	2 654
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	65 304	64 231

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts non couvertes	65 304	64 231	25,12	23,79	2 600 000

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 845	2 341
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	312	(730)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 690	(15 141)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	4 847	(13 530)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(26)	(115)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	1
Rabais sur frais	33	67
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	8	40
Total des autres revenus	17	(7)
Total des revenus	4 864	(13 537)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	125	162
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	66	197
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	6
Retenues d'impôts	265	262
Taxe de vente harmonisée	13	24
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	65	5
Total des charges	535	657
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 329	(14 194)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts non couvertes	4 329	(14 194)	1,64	(4,52)	2 647 514	3 143 094

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	64 231	94 684
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 329	(14 194)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(742)	(1 487)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(27)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(769)	(1 487)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	3 019
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 487)	(22 651)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(2 487)	(19 632)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 073	(35 313)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	65 304	59 371

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 329	(14 194)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(312)	730
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	7	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	66	197
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 690)	15 141
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	6 494	23 008
Achat de placements et de dérivés	(6 360)	(3 415)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(455)	(413)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	(11)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	52	55
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	1 132	21 099
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(769)	(1 488)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 384	3 019
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 486)	(22 650)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(871)	(21 119)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(7)	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	261	(20)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(67)	110
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	187	89
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 125	1 665
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(6)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TAÏWAN					
TWD	92 449	Acer Inc.	98 198	123 140	
TWD	4 525	Advantech Co., Ltd.	63 272	78 729	
TWD	6 048	Arcadyan Technology Corp.	25 978	31 607	
TWD	106 916	ASE Technology Holding Co., Ltd.	390 601	501 956	
TWD	65 781	Asia Cement Corp.	134 500	124 092	
TWD	22 239	Asustek Computer Inc.	298 442	297 164	
TWD	237 795	AU Optronics Corp.	193 532	187 921	
TWD	97 424	Capital Securities Corp.	41 893	58 985	
TWD	11 555	Catcher Technology Co., Ltd.	98 960	86 160	
TWD	129 529	Cathay Financial Holding Co., Ltd.	276 716	237 470	
TWD	75 528	Chang Hwa Commercial Bank	53 874	59 848	
TWD	22 208	Cheng Loong Corp.	25 472	32 128	
TWD	22 352	Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd.	40 911	38 130	
TWD	25 055	Chicony Electronics Co., Ltd.	89 554	104 323	
TWD	11 227	Chicony Power Technology Co., Ltd.	33 144	43 312	
TWD	64 254	China Bills Finance Corp.	38 464	42 042	
TWD	296 473	China Development Financial Holding Corp.	153 308	156 195	
TWD	28 023	China General Plastics Corp.	24 845	27 861	
TWD	511 661	China Steel Corp.	635 264	639 131	
TWD	26 175	ChipMOS TECHNOLOGIES INC.	36 161	40 592	
TWD	25 646	Chun Yuan Steel Industrial Co., Ltd.	16 732	19 831	
TWD	32 301	Chung Hung Steel Corp.	31 332	33 486	
TWD	8 324	Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp.	22 003	48 452	
TWD	72 197	Chunghwa Telecom Co., Ltd.	353 501	357 360	
TWD	117 563	Compal Electronics Inc.	108 964	146 102	
TWD	16 700	Compeq Manufacturing Co., Ltd.	33 625	31 504	
TWD	219 192	CTBC Financial Holding Co., Ltd.	209 063	231 426	
TWD	10 692	Delta Electronics Inc.	115 222	156 498	
TWD	8 372	Elan Microelectronics Corp.	45 142	36 104	
TWD	4 817	Elite Material Co., Ltd.	40 785	49 835	
TWD	10 633	Elite Semiconductor Microelectronics Technology Inc.	30 775	37 090	
TWD	15 436	ENNOSTAR Inc.	28 800	34 103	
TWD	13 808	Eternal Chemical Co., Ltd.	21 943	18 949	
TWD	20 617	EVA Airways Corp.	21 040	34 863	
TWD	33 971	Far Eastern Department Stores Ltd.	26 379	34 640	
TWD	94 820	Far Eastern International Bank	42 012	47 941	
TWD	79 614	Far Eastern New Century Corp.	107 930	113 148	
TWD	24 136	Far EasTone Telecommunications Co., Ltd.	71 473	80 602	
TWD	8 839	Farglory Land Development Co., Ltd.	22 001	22 908	
TWD	17 985	Feng Hsin Iron & Steel Co., Ltd.	49 042	54 483	
TWD	3 221	Feng Tay Enterprise Co., Ltd.	29 438	26 891	
TWD	98 395	First Financial Holding Co., Ltd.	98 319	115 592	
TWD	6 561	Flexium Interconnect Inc.	27 479	25 813	
TWD	74 304	Formosa Chemicals & Fibre Corp.	269 549	211 834	
TWD	3 289	Formosa International Hotels Corp.	26 580	36 263	
TWD	24 573	Formosa Petrochemical Corp.	81 980	88 013	
TWD	150 679	Formosa Plastics Corp.	563 141	548 648	
TWD	154 778	Fubon Financial Holding Co., Ltd.	356 711	399 828	
TWD	1 061	Genius Electronic Optical Co., Ltd.	18 931	17 851	
TWD	16 544	Getac Holdings Corp.	34 110	47 025	
TWD	3 575	Giant Manufacturing Co., Ltd.	42 065	34 935	
TWD	15 857	Gigabyte Technology Co., Ltd.	61 541	164 052	
TWD	4 912	Global Mixed Mode Technology Inc.	26 976	40 592	
TWD	23 147	Goldsun Building Materials Co., Ltd.	25 897	27 045	
TWD	21 791	Greatek Electronics Inc.	45 319	52 958	
TWD	44 325	Highwealth Construction Corp.	78 751	80 321	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TAÏWAN (suite)					
TWD	10 103	Holtek Semiconductor Inc.	29 329	29 318	
TWD	7 144	Holy Stone Enterprise Co., Ltd.	26 265	32 630	
TWD	134 831	Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	588 858	647 334	
TWD	3 520	Hotai Motor Co., Ltd.	87 457	121 738	
TWD	13 929	Hsin Kuang Steel Co., Ltd.	21 726	27 401	
TWD	6 410	Huaku Development Co., Ltd.	24 808	24 565	
TWD	241 936	Innolux Corp.	145 732	156 758	
TWD	54 848	Inventec Co., Ltd.	60 053	100 671	
TWD	10 099	ITE Technology Inc.	26 506	48 272	
TWD	6 926	ITEQ Corp.	32 056	20 334	
TWD	25 278	King's Town Bank	33 882	38 181	
TWD	4 273	Kinik Co.	15 304	22 331	
TWD	5 746	Kinsus Interconnect Technology Corp.	24 965	28 441	
TWD	2 781	KMC Kuei Meng International Inc.	18 337	17 842	
TWD	1 094	Largan Precision Co., Ltd.	120 833	99 005	
TWD	11 011	Lien Hwa Industrial Corp.	18 851	31 719	
TWD	37 929	Lite-On Technology Corp.	91 648	166 791	
TWD	679	LOTES Co., Ltd.	22 389	24 810	
TWD	43 227	Macronix International Co., Ltd.	66 649	60 057	
TWD	2 858	Makalot Industrial Co., Ltd.	26 354	36 672	
TWD	43 371	MediaTek Inc.	1 438 843	1 267 793	
TWD	3 021	Merida Industry Co., Ltd.	33 943	28 495	
TWD	24 075	Micro-Star International Co., Inc.	160 037	180 539	
TWD	15 258	Mirle Automation Corp.	23 667	24 667	
TWD	648	Momo.com Inc.	13 680	18 942	
TWD	224 682	Nan Ya Plastics Corp.	693 698	692 097	
TWD	3 319	Nan Ya Printed Circuit Board Corp.	28 960	37 228	
TWD	2 442	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	35 777	35 536	
TWD	15 315	Novatek Microelectronics Corp., Ltd.	194 687	277 521	
TWD	5 115	Nuvoton Technology Corp.	22 137	27 926	
TWD	50 476	Pegatron Corp.	137 787	160 416	
TWD	52 857	Pou Chen Corp.	64 436	70 741	
TWD	50 336	Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp.	67 028	66 191	
TWD	8 025	President Chain Store Corp.	97 194	96 322	
TWD	58 717	President Securities Corp.	36 310	43 408	
TWD	30 846	Promate Electronic Co., Ltd.	46 291	58 320	
TWD	35 658	Qisda Corp.	42 717	69 539	
TWD	56 280	Quanta Computer Inc.	248 708	363 461	
TWD	2 869	Raydium Semiconductor Corp.	30 546	39 129	
TWD	13 192	Realtek Semiconductor Corp.	192 817	217 192	
TWD	27 379	Ruentex Development Co., Ltd.	39 590	41 819	
TWD	20 398	Ruentex Industries Ltd.	47 548	52 173	
TWD	11 620	Sigurd Microelectronics Corp.	28 977	27 302	
TWD	143 490	SinoPac Financial Holdings Co.	85 833	105 775	
TWD	4 817	Sitronix Technology Corp.	36 288	47 993	
TWD	11 730	Sonix Technology Co., Ltd.	24 886	25 068	
TWD	8 462	Standard Chemical & Pharmaceutical Co., Ltd.	16 762	25 814	
TWD	16 874	Supreme Electronics Co., Ltd.	24 957	34 700	
TWD	22 862	Ta Chen Stainless Pipe Co., Ltd.	37 541	46 042	
TWD	53 941	Taichung Commercial Bank	28 276	34 836	
TWD	85 646	Taiwan Cooperative Financial Holding	81 831	102 071	
TWD	10 229	Taiwan Fertilizer Co., Ltd.	25 508	26 294	
TWD	34 448	Taiwan Mobile Co., Ltd.	148 042	139 921	
TWD	22 309	Taiwan PCB Techvest Co., Ltd.	31 290	37 393	
TWD	12 547	Taiwan Secom	52 089	61 039	
TWD	121 654	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	2 467 936	2 977 210	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TAÏWAN (suite)					
TWD	3 874	Thinking Electronic Industrial Co., Ltd.	18 640	27 158	
TWD	3 309	Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	24 956	25 728	
TWD	11 128	Tong Yang Industry Co., Ltd.	21 748	24 917	
TWD	4 521	Topco Scientific Co., Ltd.	24 194	35 056	
TWD	13 823	Transcend Information Inc.	39 053	46 045	
TWD	29 114	TSRC Corp.	33 934	31 790	
TWD	17 702	TXC Corp.	58 115	70 548	
TWD	7 972	Unimicron Technology Corp.	64 544	59 613	
TWD	53 348	Uni-President Enterprises Corp.	167 788	172 943	
TWD	229 264	United Microelectronics Corp.	389 245	472 431	
TWD	22 094	USI Corp.	24 625	21 684	
TWD	365	Voltronic Power Technology Corp.	13 582	30 473	
TWD	43 454	Walsin Lihwa Corp.	55 610	75 696	
TWD	8 000	Walsin Technology Corp.	25 957	32 426	
TWD	38 808	Weikeng Industrial Co., Ltd.	43 811	55 072	
TWD	49 367	Winbond Electronics Corp.	43 236	57 576	
TWD	62 012	Wistron Corp.	79 477	239 234	
TWD	6 463	Wistron NeWeb Corp.	20 557	26 169	
TWD	930	WiWynn Corp.	30 005	56 109	
TWD	27 024	WPG Holdings Co., Ltd.	58 332	62 805	
TWD	7 573	WT Microelectronics Co., Ltd.	19 471	21 879	
TWD	62 867	Yang Ming Marine Transport	166 531	168 277	
TWD	18 935	YFY Inc.	26 427	29 968	
TWD	209 614	Yuanta Financial Holding Co., Ltd.	193 406	205 728	
TWD	9 923	Yulon Motor Co., Ltd.	18 254	34 824	
			15 867 757	17 797 704	27,3
CHINE					
HKD	486 022	Agricultural Bank of China Ltd.	249 310	252 767	
CNY	118 417	Agricultural Bank of China Ltd.	73 406	76 147	
HKD	17 728	A-Living Smart City Services Co., Ltd.	17 572	15 087	
HKD	21 269	Aluminum Corporation of China Ltd., catégorie H	9 761	12 103	
CNY	8 080	Anhui Conch Cement Co., Ltd.	44 348	34 943	
HKD	29 774	Anhui Conch Cement Co., Ltd., catégorie H	186 209	104 572	
HKD	16 844	Anhui Expressway Co., Ltd., catégorie H	15 293	21 531	
HKD	4 438	ANTA Sports Products Ltd. Sports Products Ltd.	90 098	59 988	
HKD	3 445	AsialInfo Technologies Ltd.	6 569	6 341	
CNY	75 170	Bank of Beijing Co., Ltd.	68 655	63 400	
CNY	9 431	Bank of Chengdu Co., Ltd.	28 826	20 977	
CNY	87 916	Bank of China Ltd.	52 354	62 619	
HKD	1 863 877	Bank of China Ltd., catégorie H	828 852	988 237	
CNY	59 755	Bank of Communications Co., Ltd.	53 494	63 134	
HKD	538 494	Bank of Communications Co., Ltd., catégorie H	402 804	471 914	
CNY	8 930	Bank of Hangzhou Co., Ltd., catégorie A	23 551	19 114	
CNY	54 428	Bank of Shanghai Co., Ltd.	73 460	57 010	
HKD	44 398	Beijing Jingneng Clean Energy Co., Ltd.	12 340	14 019	
CNY	110 756	BOE Technology Group Co., Ltd.	86 707	82 519	
HKD	278 558	China Citic Bank, catégorie H	156 828	173 092	
HKD	25 117	China Coal Energy Co., catégorie H	14 804	24 683	
HKD	58 495	China Communications Services Corp., Ltd., catégorie H	25 198	38 126	
HKD	2 214 773	China Construction Bank Corp., catégorie H	2 147 147	1 896 056	
HKD	14 233	China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd.	5 381	6 297	
HKD	39 315	China Feihe Ltd.	94 036	28 944	
HKD	106 178	China Galaxy Securities Co.	69 275	74 942	
HKD	9 152	China International Capital Corp., Ltd.	19 106	21 233	
HKD	24 307	China International Marine Containers (Group) Co., Ltd., catégorie H	22 860	18 675	
HKD	98 009	China Life Insurance Co., Ltd., catégorie H	248 378	216 134	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
CHINE (suite)					
HKD	12 644	China Longyuan Power Group Corp.	20 059	17 229	
HKD	20 254	China Medical System Holdings Ltd.	41 499	43 639	
HKD	41 916	China Merchants Bank Co., Ltd., catégorie H	289 281	251 967	
CNY	2 914	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co., Ltd.	7 943	6 917	
HKD	30 760	China Molybdenum Co., Ltd., catégorie H	14 784	21 295	
HKD	30 424	China New Higher Education Group Ltd.	10 838	11 970	
HKD	35 722	China Nonferrous Mining Corp., Ltd.	19 040	22 318	
CNY	24 200	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	130 711	114 530	
CNY	85 511	China Petroleum & Chemical Corp.	70 547	99 070	
HKD	696 633	China Petroleum & Chemical Corp., catégorie H	436 048	539 922	
HKD	56 954	China Railway Signal & Communication Corp., Ltd., catégorie H	23 647	28 466	
HKD	236 508	China Reinsurance (Group) Corp.	21 648	21 166	
HKD	11 504	China Resources Medical Holdings Co., Ltd.	8 765	11 674	
HKD	156 168	China Shenhua Energy Co., Ltd.	524 112	631 556	
HKD	28 622	China Suntien Green Energy Corp., Ltd., catégorie H	14 609	13 581	
HKD	55 776	China Vanke Co., Ltd.	181 147	99 078	
HKD	19 874	China XLX Fertiliser Ltd.	13 207	11 242	
HKD	47 161	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd.	56 395	31 376	
HKD	31 626	CITIC Securities Co., Ltd., catégorie H	94 840	75 831	
CNY	28 304	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd.	61 010	48 466	
HKD	89 904	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd., catégorie H	138 453	107 176	
HKD	13 467	Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	23 676	23 013	
HKD	17 332	CSC Financial Co., Ltd., catégorie H	20 329	23 647	
HKD	47 201	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	77 795	54 277	
HKD	28 778	Dali Foods Group Co., Ltd.	16 808	17 008	
CNY	27 245	Daqin Railway Co., Ltd.	35 039	36 876	
HKD	4 832	ENN Energy Holdings Ltd.	93 785	79 633	
CNY	14 072	Fangda Special Steel Technology Co., Ltd.	16 090	11 869	
CNY	46 907	Focus Media Information Technology Co., Ltd.	49 592	58 190	
CNY	1 555	Foshan Haitian Flavouring & Food Co., Ltd.	17 593	13 271	
CNY	13 624	Foxconn Industrial Internet Co., Ltd.	22 128	62 541	
HKD	47 950	Fufeng Group Ltd.	37 971	32 063	
CNY	2 994	Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	21 229	19 553	
HKD	4 300	Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	27 761	23 525	
CNY	9 892	Gemdale Corp.	21 247	12 992	
HKD	38 317	Great Wall Motor Co., Ltd., catégorie H	55 897	58 036	
CNY	20 490	Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai	119 812	136 275	
CNY	14 525	Guanghui Energy Co., Ltd.	31 736	18 151	
HKD	31 199	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd., catégorie H	36 270	24 602	
HKD	2 634	Guangzhou Pharmaceutical Co., Ltd., catégorie H	8 449	10 519	
CNY	24 147	Guotai Junan Securities Co., Ltd.	67 229	61 538	
HKD	9 361	Guotai Junan Securities Co., Ltd., catégorie H	16 479	14 526	
HKD	12 185	Haier Smart Home Co., Ltd.	53 208	50 717	
CNY	4 153	Haier Smart Home Co., Ltd.	20 144	17 763	
HKD	3 910	Hansoh Pharmaceutical Group Co., Ltd.	9 492	8 319	
CNY	4 738	Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd.	25 527	21 137	
HKD	7 185	Hengan International Group Co., Ltd.	63 585	40 036	
HKD	6 357	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd., catégorie H	7 429	21 576	
CNY	12 570	Huatai Securities Co., Ltd.	29 728	31 531	
HKD	14 178	Huatai Securities Co., Ltd., catégorie H	27 290	23 174	
CNY	34 233	Huaxia Bank Co., Ltd.	32 936	33 737	
CNY	6 975	Huayu Automotive Systems Co., Ltd.	21 556	23 455	
CNY	22 252	Hunan Valin Steel Co., Ltd.	17 925	19 335	
HKD	1 633 349	Industrial & Commercial Bank of China, catégorie H	1 292 082	1 152 841	
CNY	49 351	Industrial Bank Co., Ltd.	166 568	140 693	
CNY	8 765	Inner Mongolia ERDOS Resources Co., Ltd.	18 069	14 322	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
CHINE (suite)					
CNY	7 625	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	49 165	39 337	
HKD	28 946	Jiangsu Expressway Co., Ltd., catégorie H	40 377	35 289	
CNY	916	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	33 693	21 917	
HKD	2 729	Kingsoft Corp. Ltd.	10 399	14 216	
CNY	393	Kweichow Moutai Co., Ltd.	135 192	121 060	
HKD	16 266	Legend Holdings Corp.	20 283	19 940	
HKD	5 782	Li Ning Co., Ltd.	58 246	41 152	
HKD	3 069	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	11 041	13 966	
HKD	32 859	Longfor Group Holdings Ltd.	182 536	105 642	
CNY	893	Luzhou Laojiao Co., Ltd.	30 723	34 091	
HKD	5 528	Minth Group Ltd.	27 675	20 069	
CNY	5 581	NARI Technology Co., Ltd.	22 581	23 485	
HKD	10 104	NetDragon Websoft Holdings Ltd.	25 597	25 148	
HKD	7 647	NetEase Inc.	166 175	197 042	
CNY	8 272	Ningxia Baofeng Energy Group Co., Ltd.	20 011	19 002	
HKD	7 181	Nongfu Spring Co., Ltd.	53 519	52 443	
CNY	93 671	PetroChina Co., Ltd.	91 620	127 464	
HKD	653 083	PetroChina Co., Ltd., catégorie H	498 099	597 698	
HKD	101 743	PICC Property and Casualty Co., Ltd., catégorie H	126 657	149 636	
HKD	86 828	Ping An Insurance (Group) Co., of China Ltd., catégorie H	937 887	730 868	
CNY	9 350	Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd.	24 920	22 193	
HKD	91 242	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	72 781	74 260	
CNY	25 518	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	22 302	22 731	
CNY	8 552	SAIC Motor Corp., Ltd.	36 714	22 075	
CNY	12 400	SANY Heavy Industry Co., Ltd.	46 852	37 564	
CNY	15 538	Shaanxi Coal Industry Co., Ltd.	39 952	51 486	
HKD	4 147	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd.	14 269	14 635	
CNY	22 342	Shanghai International Port (Group) Co., Ltd.	22 939	21 367	
HKD	11 826	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd.	23 200	30 992	
CNY	42 966	Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd.	80 376	56 667	
CNY	317	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	16 161	10 687	
HKD	24 473	Shenzhen Expressway Corp., Ltd., catégorie H	31 539	27 604	
HKD	146 412	Shui On Land Ltd.	21 039	22 003	
HKD	2 732	Sincere Pharmaceutical Group Ltd.	4 574	3 580	
HKD	72 955	Sinopec Engineering (Group) Co., Ltd.	45 319	42 993	
HKD	18 539	Sinopharm Group Co., Ltd., actions H	61 378	76 695	
HKD	86 144	Sinotrans Ltd.	31 525	40 583	
HKD	11 855	Smoores International Holdings Ltd.	53 736	15 934	
HKD	2 496	Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	62 043	32 937	
CNY	40 981	Tangshan Port Group Co., Ltd.	20 665	26 352	
CNY	9 149	TBEA Co., Ltd.	37 540	37 149	
HKD	8 988	Tencent Holdings Ltd.	578 100	503 259	
HKD	43 741	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	98 825	89 960	
HKD	12 951	Tong Ren Tang Technologies Co., Ltd.	10 255	17 014	
CNY	4 583	Tongwei Co., Ltd.	40 747	28 644	
HKD	2 328	Tsingtao Brewery Co., Ltd.	24 172	27 988	
HKD	24 153	Uni-President China Holdings Ltd.	31 343	26 917	
CNY	2 412	Wuliangye Yibin Co., Ltd.	81 342	71 869	
HKD	1 184	WuXi AppTec Co., Ltd.	13 885	12 495	
HKD	39 354	Xinyi Energy Holdings Ltd.	17 981	17 012	
HKD	10 741	Yadea Group Holdings Ltd.	25 227	32 320	
HKD	8 000	Yankuang Energy Group Co., Ltd., catégorie H	33 867	30 326	
CNY	22 596	Yanzhou Coal Mining Co., Ltd.	188 520	123 156	
HKD	623	Yum China Holdings Inc.	39 888	46 455	
CNY	1 324	Yunnan Baiyao Group Co., Ltd.	16 964	12 657	
CNY	4 346	Zangge Mining Co., Ltd.	23 022	17 868	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
CHINE (suite)					
HKD	30 425	Zhejiang Expressway Co., Ltd., catégorie H	33 631	30 568	
HKD	8 930	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co., Ltd., catégorie H	11 923	10 299	
HKD	4 922	Zhongsheng Group Holdings Ltd.	40 890	24 892	
CNY	9 879	Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd.	17 412	15 513	
CNY	47 517	Zijin Mining Group Co., Ltd.	76 739	98 418	
			14 623 692	13 841 396	21,2
CORÉE DU SUD					
KRW	904	APTC Co., Ltd.	12 418	16 759	
KRW	5 591	BNK Financial Group Inc.	40 526	38 910	
KRW	144	Celltrion Inc.	22 750	22 111	
KRW	1 641	Cheil Worldwide Inc.	42 614	29 878	
KRW	552	Coway Co., Ltd.	29 113	24 364	
KRW	192	CS Wind Corp.	11 841	16 640	
KRW	805	DB Insurance Co., Ltd.	53 167	60 308	
KRW	3 999	DGB Financial Group Inc.	27 835	29 196	
KRW	156	Dongkuk Steel Mill Co., Ltd.	10 769	2 729	
KRW	241	E-MART Inc.	20 191	18 612	
KRW	145	GOLFZON Co., Ltd.	15 481	16 848	
KRW	812	Green Cross Holdings Corp.	11 946	11 620	
KRW	1 376	GS Engineering & Construction Corp.	44 616	25 758	
KRW	1 710	GS Holdings Corp.	79 920	62 938	
KRW	783	GS Retail Co., Ltd.	18 416	18 007	
KRW	4 608	Hana Financial Group Inc.	198 943	181 401	
KRW	695	Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	24 528	24 010	
KRW	2 673	Hanon Systems	25 544	24 562	
KRW	505	Hanwha Corp.	11 876	15 189	
KRW	1 140	HD Hyundai Co., Ltd.	64 918	68 576	
KRW	2 899	HMM Co., Ltd.	53 554	54 878	
KRW	776	Huchems Fine Chemical Corp.	15 617	17 222	
KRW	296	Hyosung Corp.	20 904	18 787	
KRW	537	Hyundai Elevator Co., Ltd.	12 446	21 706	
KRW	517	Hyundai Engineering & Construction Co., Ltd.	25 727	19 781	
KRW	210	Hyundai Glovis Co., Ltd.	40 058	41 693	
KRW	809	Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	24 424	25 226	
KRW	1 500	Hyundai Motor Co., Ltd.	282 843	311 066	
KRW	721	Hyundai Steel Co.	22 153	24 437	
KRW	5 932	Industrial Bank of Korea	67 391	61 598	
KRW	454	Innocean Worldwide Inc.	18 373	17 941	
KRW	2 836	JB Financial Group Co., Ltd.	20 497	24 123	
KRW	137	JYP Entertainment Corp.	7 114	17 996	
KRW	5 473	KB Financial Group Inc.	307 268	262 446	
KRW	4 236	Kia Corp.	288 691	376 479	
KRW	223	KIWOOM Securities Co., Ltd.	17 277	19 797	
KRW	113	Korea Zinc Co., Ltd.	57 498	55 322	
KRW	247	LG Chem Ltd.	173 413	165 449	
KRW	1 113	LG Corp.	109 907	98 360	
KRW	3 584	LG Uplus Corp.	52 448	38 620	
KRW	694	Lotte Corp.	23 411	17 424	
KRW	266	LOTTE Fine Chemical Co., Ltd.	15 004	18 539	
KRW	156	Lotte Shopping Co., Ltd.	13 736	10 747	
KRW	381	LS Cable Ltd.	22 597	35 545	
KRW	665	LX International Corp.	27 679	24 075	
KRW	4 271	Mirae Asset Securities Co., Ltd.	25 599	31 011	
KRW	83	NCsoft Corp.	29 143	24 589	
KRW	700	Poongsan Corp.	18 581	30 509	
KRW	493	POSCO DAEWOO Corp.	10 135	19 730	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
CORÉE DU SUD (suite)					
KRW	1 366	POSCO Holdings Inc.	404 916	532 260	
KRW	458	S-1 Corp.	26 421	24 515	
KRW	876	Samsung C&T Corp.	93 417	92 987	
KRW	251	Samsung Electro-Mechanics Co., Ltd.	37 574	36 424	
KRW	45 305	Samsung Electronics Co., Ltd.	3 262 581	3 284 922	
KRW	403	Samsung Fire & Marine Insurance	94 708	93 084	
KRW	834	Samsung Life Insurance Co., Ltd.	69 673	56 367	
KRW	36	Samsung SDI Co., Ltd.	20 476	24 186	
KRW	340	Samsung SDS Co., Ltd.	57 265	41 964	
KRW	588	Seah Besteel Corp.	9 362	15 205	
KRW	483	SFA Engineering Corp.	18 493	17 462	
KRW	6 974	Shinhan Financial Group Co., Ltd.	282 408	238 124	
KRW	421	SK Chemicals Co., Ltd.	12 383	15 178	
KRW	207	SK Chemicals Co., Ltd.	17 869	14 593	
KRW	3 341	SK Hynix Inc.	339 543	386 519	
KRW	414	SK Inc.	99 901	61 823	
KRW	172	SKC Co., Ltd.	16 140	16 859	
KRW	752	S-Oil Corp.	62 248	50 372	
KRW	9 871	Woori Financial Group Inc.	125 126	116 874	
KRW	325	Youngone Corp.	14 175	21 052	
			7 635 579	7 734 282	11,8
INDE					
INR	664	ACC Ltd.	23 717	19 425	
INR	2 062	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	21 767	24 588	
INR	3 968	Ambuja Cements Ltd.	25 730	27 259	
INR	411	Angel One Ltd.	10 891	11 395	
INR	4 870	Apollo Tyres Ltd.	22 984	31 948	
INR	1 358	Asian Paints Ltd.	61 023	73 644	
INR	1 859	Axis Bank Ltd.	25 616	29 609	
INR	1 088	Bajaj Auto Ltd.	67 285	82 334	
INR	944	Britannia Industries Ltd.	59 096	76 508	
INR	2 979	Canara Bank Ltd.	12 968	14 504	
INR	15 048	Castrol (India) Ltd.	28 570	29 321	
INR	1 800	Cipla Ltd.	32 565	29 468	
INR	57 299	Coal India Ltd.	201 310	213 499	
INR	1 385	Colgate-Palmolive (India) Ltd.	38 131	37 712	
INR	2 240	Container Corporation of India Ltd.	27 536	23 912	
INR	1 450	Coromandel International Ltd.	23 831	22 182	
INR	1 338	Cummins India Ltd.	17 711	41 936	
INR	1 402	Cyient Ltd.	17 806	33 937	
INR	3 474	Dabur India Ltd.	32 984	32 106	
INR	605	Divi's Laboratories Ltd.	36 350	34 971	
INR	504	Dr. Reddy's Laboratories Ltd.	36 246	41 945	
INR	395	Eicher Motors Ltd.	23 427	22 810	
INR	15 863	Engineers India Ltd.	17 374	29 412	
INR	67 638	Gail (India) Ltd.	120 329	114 610	
INR	1 570	GHCL Ltd.	17 229	13 048	
INR	925	Havells India Ltd.	19 546	19 140	
INR	19 226	HCL Technologies Ltd.	319 080	368 403	
INR	925	HDFC Asset Management Co., Ltd.	29 758	34 252	
INR	1 754	Hero MotoCorp Ltd.	84 399	82 333	
INR	4 274	Hindalco Industries Ltd.	23 880	29 020	
INR	866	Hindustan Aeronautics Ltd.	16 013	52 976	
INR	12 893	Hindustan Petroleum Corp., Ltd.	60 496	56 951	
INR	3 093	Hindustan Unilever Ltd.	124 310	133 614	
INR	8 167	ICICI Bank Ltd.	110 146	123 119	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
INDE (suite)					
INR	14 479	IDFC Ltd.	18 546	23 985	
INR	2 843	Indian Bank	10 625	13 416	
INR	115 045	Indian Oil Corp., Ltd.	147 012	169 424	
INR	3 885	Indraprastha Gas Ltd.	24 641	29 663	
INR	27 495	Infosys Ltd.	622 983	592 290	
INR	110 082	ITC Ltd.	535 092	801 875	
INR	1 800	Jindal Steel & Power Ltd.	13 492	16 870	
INR	6 796	JSW Steel Ltd.	65 176	86 030	
INR	2 597	Larsen & Toubro Ltd.	67 078	103 700	
INR	241	LTIMindtree Ltd.	18 933	20 203	
INR	1 399	Lupin Ltd.	15 694	20 371	
INR	1 357	Mahanagar Gas Ltd.	18 449	22 950	
INR	3 100	Mahindra & Mahindra Ltd.	47 197	72 685	
INR	3 638	Marico Ltd.	29 029	31 157	
INR	6 404	Mindspace Business Parks REIT	34 349	31 929	
INR	16 913	National Aluminium Co., Ltd.	29 757	22 384	
INR	66 311	National Hydroelectric Power Corp., Ltd.	30 718	49 148	
INR	187	Nestlé India Ltd.	51 582	69 057	
INR	235	NIIT Technologies Ltd.	15 045	17 858	
INR	29 465	NMDC Ltd.	69 191	49 737	
INR	76 387	NTPC Ltd.	152 998	233 057	
INR	76 497	Oil and Natural Gas Corp., Ltd.	155 844	197 794	
INR	8 870	Oil India Ltd.	28 816	35 046	
INR	488	Oracle Financial Services Software Ltd.	28 735	30 373	
INR	30	Page Industries Ltd.	18 896	18 218	
INR	7 382	PCBL Ltd.	16 947	19 379	
INR	765	Pidilite Industries Ltd.	31 177	32 047	
INR	70 467	Power Grid Corp. of India Ltd.	203 889	290 013	
INR	19 649	Punjab National Bank	13 528	16 370	
INR	11 484	Redington (India) Ltd.	29 105	34 454	
INR	2 740	Reliance Industries Ltd.	89 546	112 712	
INR	493	Siemens Ltd.	23 408	29 951	
INR	3 703	State Bank of India	31 262	34 216	
INR	40 320	Steel Authority of India Ltd.	63 820	55 606	
INR	4 603	Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	50 521	78 078	
INR	1 091	Tata Communications Ltd.	21 247	28 062	
INR	5 046	Tata Consultancy Services Ltd.	253 316	268 778	
INR	7 355	Tata Power Co., Ltd.	17 363	26 320	
INR	98 655	Tata Steel Ltd.	195 762	178 227	
INR	2 036	Tata Tea Ltd.	26 895	28 273	
INR	3 076	Tech Mahindra Ltd.	51 768	56 108	
INR	1 008	Torrent Pharmaceuticals Ltd.	25 400	30 973	
INR	310	Ultra Tech Cement Ltd.	34 585	41 476	
INR	2 512	UPL Ltd.	30 257	27 859	
INR	30 538	Vedanta Ltd.	173 329	136 913	
INR	4 358	Zee Entertainment Enterprises Ltd.	19 025	12 467	
			5 442 132	6 309 393	9,7
BRÉSIL					
BRL	3 344	Aliansce Sonae Shopping Centers SA	18 005	22 629	
BRL	6 023	Alupar Investimento SA, Units	36 103	49 465	
BRL	62 324	Ambev SA	222 789	263 618	
BRL	3 291	Atacadao SA	17 014	10 120	
BRL	41 360	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	165 239	165 755	
BRL	9 155	Banco Bradesco SA	47 208	36 840	
BRL	32 186	Banco do Brasil SA	291 410	437 025	
BRL	2 911	Banco Santander (Brasil) SA	28 599	24 530	
BRL	13 491	BB Seguridade Participações SA	82 207	113 795	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BRÉSIL (suite)					
BRL	11 587	Caixa Seguridade Participacoes SA	26 899	32 737	
BRL	8 956	CCR SA	31 578	34 467	
BRL	4 118	Centrais Elétricas Brasileiras S.A.	40 528	44 946	
BRL	1 668	Cia Saneamento Basico de Sao Paulo NPV	24 834	25 961	
BRL	2 948	Companhia Paranaense de Energia-Copel	25 140	33 551	
BRL	6 066	Companhia de Saneamento do Paraná	36 313	36 390	
BRL	15 834	Cosan SA	69 070	77 703	
BRL	7 676	CPFL Energia SA	49 819	72 095	
BRL	7 108	EDP - Energias do Brasil SA	35 470	46 014	
BRL	4 732	Energisa SA	45 499	65 420	
BRL	6 548	Engie Brasil Energia SA	69 341	82 138	
BRL	4 364	Fleury SA	18 185	19 357	
BRL	3 554	Hypera SA	23 704	44 981	
BRL	319	Itau Unibanco Holding SA	1 593	2 146	
BRL	18 842	JBS SA	129 629	90 500	
BRL	2 986	Localiza Rent a Car SA	48 362	56 099	
BRL	6 164	Lojas Renner SA	45 550	33 918	
BRL	6 031	Minerva SA	12 905	17 420	
BRL	6 147	Movida Participacoes SA	21 098	17 705	
BRL	7 215	MRV Engenharia e Participações SA	18 715	22 839	
BRL	4 014	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	26 006	30 566	
BRL	6 469	Neoenergia SA	27 599	37 708	
BRL	132 441	Petroleo Brasileiro SA	850 994	1 204 315	
BRL	3 869	Porto Seguro SA	22 447	29 896	
BRL	5 006	Raia Drogasil SA	29 830	40 550	
BRL	3 766	Sendas Distribuidora SA	13 930	14 235	
BRL	9 225	Telefonica Brasil SA	92 890	109 974	
BRL	10 967	TIM SA	32 822	44 042	
BRL	10 122	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	90 937	104 564	
BRL	7 876	Ultrapar Participações SA	27 217	40 962	
BRL	79 734	Vale SA	1 537 161	1 407 429	
BRL	11 025	Vibra Energia SA	66 865	55 041	
BRL	5 613	WEG SA	40 832	58 231	
			4 542 336	5 157 677	7,9
AFRIQUE DU SUD					
ZAR	9 156	Absa Group Ltd.	126 114	107 687	
ZAR	5 344	AECI Ltd.	36 025	33 914	
ZAR	3 186	African Rainbow Minerals Ltd.	62 993	44 412	
ZAR	1 238	Anglo Platine Américain Ltd.	161 550	73 817	
ZAR	2 694	AngloGold Ashanti Ltd.	87 051	75 062	
ZAR	2 840	Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	50 308	36 527	
ZAR	8 100	AVI Ltd.	54 556	38 632	
ZAR	2 474	Bid Corp., Ltd.	54 641	71 620	
ZAR	4 575	Bidvest Group Ltd. (The)	73 695	83 842	
ZAR	381	Capitec Bank Holdings Ltd.	55 615	41 841	
ZAR	2 573	Clicks Group Ltd	59 100	47 092	
ZAR	40 884	Equites Property Fund Ltd.	50 464	33 048	
ZAR	10 638	Exxaro Resources Ltd.	150 783	122 405	
ZAR	54 250	FirstRand Ltd.	265 583	260 299	
ZAR	4 983	Foschini Group Ltd. (The)	43 643	32 817	
ZAR	7 557	Gold Fields Ltd.	147 800	138 495	
ZAR	149 737	Growthpoint Properties Ltd.	152 623	122 295	
ZAR	13 006	Hyprop Investments Ltd.	36 873	27 977	
ZAR	17 506	Impala Platinum Holdings Ltd.	307 935	153 670	
ZAR	3 681	Investec Ltd.	22 553	27 336	
ZAR	3 580	JSE Ltd.	27 532	22 819	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
AFRIQUE DU SUD (suite)					
ZAR	56 953	KAP Industrial Holdings Ltd.	18 640	10 771	
ZAR	3 315	Motus Holdings Ltd.	29 144	23 262	
ZAR	2 493	Mr Price Group Ltd.	42 196	25 181	
ZAR	10 156	Nedbank Group Ltd.	157 887	162 609	
ZAR	15 598	Pepkor Holdings Ltd.	24 992	18 027	
ZAR	5 941	Pick n Pay Stores Ltd.	25 337	16 180	
ZAR	190 211	Redefine Properties Ltd.	59 078	43 834	
ZAR	4 587	Remgro Ltd.	47 627	47 247	
ZAR	7 871	Resilient REIT Ltd.	35 216	23 327	
ZAR	6 334	Reunert Ltd.	20 848	26 105	
ZAR	20 877	Sanlam Ltd.	104 579	85 328	
ZAR	1 982	Santam Ltd.	38 548	40 122	
ZAR	6 752	Sasol Ltd.	147 686	110 320	
ZAR	3 941	Spar Group Ltd. (The)	59 522	28 985	
ZAR	16 240	Standard Bank Group Ltd.	193 635	201 971	
ZAR	6 551	Thungela Resources Ltd.	149 043	67 885	
ZAR	3 113	Tiger Brands Ltd.	47 449	36 465	
ZAR	17 812	Vodacom Group Ltd.	192 919	146 225	
ZAR	17 260	Woolworths Holdings Ltd.	81 351	86 261	
			3 503 134	2 795 712	4,3
MEXIQUE					
MXN	76 887	Alfa SAB de CV, série A	71 713	62 822	
MXN	14 924	Alpek SAB de CV	28 785	19 586	
MXN	179 243	America Movil SAB de CV	182 424	256 953	
MXN	19 343	Banco del Bajío SA	59 053	78 038	
MXN	12 320	Bolsa Mexicana de Valores SA	28 281	33 821	
MXN	9 423	Coca-Cola FEMSA SAB de CV	63 333	103 922	
MXN	12 684	Corporacion Inmobiliaria Vesta SAB de CV	30 443	54 373	
MXN	3 148	El Puerto de Liverpool SA de CV	20 567	25 364	
MXN	73 776	Fibra Uno Administracion SA	97 201	142 248	
MXN	11 630	Fomento Económico Mexicano SAB de CV	112 996	169 960	
MXN	1 718	Gentera SAB de CV	2 298	2 427	
MXN	2 092	GRUMA SAB de CV, catégorie B	29 991	44 363	
MXN	4 971	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	49 834	69 804	
MXN	3 560	Grupo Aeroportuario del Pacífico SAB de CV	59 104	84 613	
MXN	1 272	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV	32 814	46 960	
MXN	3 246	Grupo Carso SAB de CV, série A1	16 893	30 980	
MXN	24 513	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	221 799	266 334	
MXN	64 729	Grupo México SAB de CV, série B	327 501	411 021	
MXN	22 567	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, série A	49 786	66 495	
MXN	29 196	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV	50 392	68 322	
MXN	6 354	Megacable Holdings SAB de CV	26 241	19 443	
MXN	20 058	PLA Administradora Industrial S de RL de CV	37 734	50 544	
MXN	3 428	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	33 205	45 434	
MXN	4 115	Qualitas Controladora SAB de CV	24 917	40 201	
MXN	780	Regional SAB de CV	5 896	7 464	
MXN	43 967	Wal-Mart de Mexico SAB de CV, série V	180 620	230 302	
			1 843 821	2 431 794	3,7
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
USD	38 763	iShares MSCI Saudi Arabia ETF	2 257 050	2 119 945	3,2
INDONÉSIE					
IDR	734 134	Bank Rakyat Indonesia (Persero) TBK PT	270 323	351 515	
IDR	15 230	Indo Tambangraya Megah PT	57 832	32 429	
IDR	413 993	PT Adaro Energy Indonesia TBK	116 128	81 483	
IDR	156 440	PT AKR Corporindo TBK	18 890	19 607	
IDR	282 824	PT Astra International TBK	150 878	169 119	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
INDONÉSIE (suite)					
IDR	261 190	PT Bank Central Asia TBK	147 447	210 933	
IDR	454 680	PT Bank Mandiri (Persero) TBK	155 505	208 678	
IDR	27 424	PT Bank Negara Indonesia (Persero) TBK	22 544	22 147	
IDR	170 497	PT Bukit Asam (Persero) TBK	59 496	40 329	
IDR	50 065	PT Charoen Pokphand Indonesia TBK	23 848	23 309	
IDR	13 637	PT Gudang Garam TBK	28 616	33 250	
IDR	218 259	PT Hanjaya Mandala Sampoerna TBK	18 481	18 204	
IDR	33 013	PT Indocement Tunggul Prakarsa TBK	36 691	28 919	
IDR	35 401	PT Indofood CBP Sukses Makmur TBK	29 389	35 385	
IDR	190 586	PT Kalbe Farma TBK	25 649	34 484	
IDR	288 533	PT Perusahaan Gas Negara TBK	46 446	33 233	
IDR	814 844	PT Puradelta Lestari TBK	12 045	12 298	
IDR	198 015	PT Sarana Menara Nusantara TBK	18 495	18 438	
IDR	105 672	PT Sawit Sumbermas Sarana Tbk	13 795	11 285	
IDR	30 385	PT Semen Indonesia (Persero)TBK	22 874	16 292	
IDR	598 978	PT Telkom Indonesia (Persero) TBK	182 754	211 466	
IDR	71 869	PT Unilever Indonesia TBK	41 008	27 022	
IDR	30 371	PT United Tractors TBK	72 453	62 390	
			1 571 587	1 702 215	2,6
MALAISIE					
MYR	47 600	Berjaya Auto BHD	26 892	30 093	
MYR	5 700	British American Tobacco Malaysia BHD	16 800	16 418	
MYR	18 236	Bursa Malaysia BHD	41 084	33 295	
MYR	4 811	Carlsberg Brewery Malaysia BHD	31 308	27 770	
MYR	101 254	CIMB Group Holdings BHD	162 150	145 251	
MYR	49 400	Dialog Group BHD	26 120	28 850	
MYR	60 673	DiGi.Com BHD	72 693	70 696	
MYR	11 761	Hap Seng Consolidated BHD	21 191	10 436	
MYR	3 120	Heineken Malaysia BHD	21 347	23 086	
MYR	6 648	Hong Leong Bank BHD	36 532	35 734	
MYR	5 870	Hong Leong Financial Group BHD	32 474	29 389	
MYR	30 500	IHH Healthcare BHD	54 044	50 930	
MYR	36 521	Inari Amertron BHD	31 326	28 369	
MYR	59 603	IOI Corp. BHD	71 831	63 028	
MYR	33 928	Maxis BHD	46 360	39 437	
MYR	345	Nestlé (Malaysia) BHD	13 273	12 813	
MYR	64 667	Petronas Chemicals Group BHD	165 163	110 000	
MYR	3 437	Petronas Dagangan BHD	20 867	21 632	
MYR	18 241	Petronas Gas BHD	91 942	86 362	
MYR	9 133	Groupe PPB BHD	44 734	40 755	
MYR	158 485	Public Bank BHD	200 237	172 985	
MYR	86 955	RHB Capital BHD	145 146	133 860	
MYR	76 947	Sime Darby BHD	52 667	44 720	
MYR	92 300	FPI Sunway	38 748	40 821	
MYR	38 657	Supermax Corp. BHD	10 098	8 768	
MYR	22 298	Ta Ann Holdings BHD	24 593	21 114	
MYR	21 340	Telekom Malaysia BHD	34 587	29 705	
MYR	31 116	Tenaga Nasional BHD	101 949	79 834	
MYR	40 271	TIME dotCom BHD	52 973	59 368	
MYR	29 785	Westports Holdings BHD	28 573	30 737	
MYR	97 210	YTL Corp. BHD	16 408	28 662	
			1 734 110	1 554 918	2,4
THAÏLANDE					
THB	16 703	Advanced Info Service PCL	117 283	133 406	
THB	24 896	Bangchak Corp. PCL	27 917	33 915	
THB	7 250	Bangkok Bank PCL	35 292	43 158	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
THAÏLANDE (suite)					
THB	58 066	Bangkok Chain Hospital PCL	37 628	38 358	
THB	65 787	Banpu PCL	30 354	21 729	
THB	83 900	BTS Group Holdings PCL	31 039	23 328	
THB	17 043	CP All PCL	40 452	39 755	
THB	5 793	Electricity Generating Public Co., Ltd.	35 283	28 215	
THB	13 653	Gulf Energy Development PCL	20 555	23 822	
THB	48 845	Home Product Center PCL	23 908	25 522	
THB	33 162	Indorama Ventures PCL	51 919	42 390	
THB	11 686	Intouch Holdings PCL	28 296	32 275	
THB	165 630	IRPC Public Co., Ltd.	27 630	14 094	
THB	6 252	Kasikornbank PCL	33 109	30 217	
THB	9 175	KCE Electronics PCL	14 460	13 355	
THB	13 744	Kiatnakin Bank Public Co., Ltd.	31 176	30 649	
THB	1 145	Kiatnakin Bank Public Co., Ltd., bons de souscription, 31 décembre 2024	-	2 553	
THB	1 145	Kiatnakin Bank Public Co., Ltd., bons de souscription, 31 décembre 2026	-	2 553	
THB	44 689	Krung Thai Bank Public Co., Ltd.	27 838	32 357	
THB	143 895	Land and Houses Public Co., Ltd.	45 637	45 380	
THB	35 036	Major Cineplex Group PCL	23 337	19 091	
THB	30 529	Osotspa PCL	30 799	33 897	
THB	23 398	PTT Global Chemical PCL	55 736	32 529	
THB	34 502	PTT Oil & Retail Business PCL	31 927	27 299	
THB	201 531	PTT PCL	276 107	251 972	
THB	22 320	Ratchaburi Group PCL	32 758	29 781	
THB	5 862	Siam Cement Public Co., Ltd. (The)	77 497	70 448	
THB	33 776	Siam Global House PCL	23 411	19 917	
THB	86 370	Star Petroleum Refining PCL	35 873	25 949	
THB	24 785	Thai Oil Public Co., Ltd.	49 948	40 932	
THB	53 004	Thai Union Frozen Products Public Co., Ltd.	36 053	25 519	
THB	21 188	Thanachart Capital PCL	30 449	39 341	
THB	14 805	Tisco Financial Group Public Co., Ltd.	49 542	53 598	
THB	75 284	TTW PCL	26 317	24 304	
THB	200 658	WHA Corp. PCL	26 127	34 449	
			1 465 657	1 386 057	2,1
CHILI					
CLP	59 280	Aguas Andinas SA, catégorie A	16 208	27 186	
CLP	682 414	Banco de Chile	86 423	94 211	
CLP	690	Banco de Credito e Inversiones	33 685	27 885	
CLP	794 851	Banco Santander Chile	50 507	49 747	
CLP	19 264	Cencosud SA	35 336	49 381	
CLP	4 004	Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.	17 533	21 303	
CLP	9 425	Empresas Copec SA	86 128	92 509	
CLP	11 266	Quinenco SA	44 975	49 993	
CLP	14 374	Vina Concha Y Toro SA	20 912	22 133	
			391 707	434 348	0,7
POLOGNE					
PLN	1 051	Asseco Poland SA	23 465	27 469	
PLN	1 719	Bank Polska Kasa Opieki SA	56 653	62 032	
PLN	238	CD Projekt SA	8 115	12 003	
PLN	6 828	Cyfrowy Polsat SA	49 261	36 715	
PLN	876	KGHM Polska Miedz SA	34 050	32 068	
PLN	6 719	Polski Koncern Naftowy Orlen SA	160 153	140 948	
PLN	10 194	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	71 305	120 020	
			403 002	431 255	0,7

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PHILIPPINES					
PHP	17 059	Aboitiz Equity Ventures Inc.	21 396	22 246	
PHP	27 500	Aboitiz Power Corp.	20 825	25 348	
PHP	1 282	Ayala Corp.	19 747	19 208	
PHP	14 032	Bank of the Philippine Islands	30 872	36 598	
PHP	3 691	BDO Unibank Inc.	9 483	12 184	
PHP	79 066	DMCI Holdings Inc.	16 777	17 172	
PHP	508	Globe Telecom Inc.	29 097	21 080	
PHP	8 218	International Container Terminal Services Inc.	31 404	40 149	
PHP	4 087	Manila Electric Co.	32 024	32 821	
PHP	15 906	Metropolitan Bank & Trust Co.	18 852	21 238	
PHP	1 286	PLDT Inc.	43 698	40 447	
PHP	17 929	Semirara Mining and Power Corp.	16 741	12 034	
PHP	1 084	SM Investments Corp.	19 761	24 037	
PHP	9 672	Universal Robina Corp.	33 668	31 881	
			344 345	356 443	0,5
TURQUIE					
TRY	15 379	Akbank TAS	11 413	15 768	
TRY	2 368	Aksa Akriklik Kimya Sanayii AS	10 666	8 702	
TRY	4 202	Aksa Enerji Uretim AS	12 992	6 915	
TRY	2 505	Arcelik AS	11 943	16 529	
TRY	2 882	BIM Birlesik Magazalar AS	23 504	24 941	
TRY	15 939	Enka Insaat ve Sanayi AS	19 877	23 704	
TRY	941	Ford Otomotiv Sanayi AS	19 812	36 349	
TRY	8 933	Haci Omer Sabanci Holding AS	18 278	20 866	
TRY	13 949	Kardemir Karabuk Demir Celik Sanayi ve Ticaret AS, catégorie D	13 249	15 647	
TRY	5 666	KOC Holding AS	16 919	29 823	
TRY	12 538	Koza Altin Isletmeleri AS	9 638	15 783	
TRY	2 180	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	11 541	27 940	
TRY	23 614	Turkiye Is Bankasi AS, série C	13 858	16 852	
TRY	8 182	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS (Sisecam)	16 697	18 464	
			210 387	278 283	0,4
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE					
CZK	3 465	CEZ AS	149 619	189 493	
CZK	722	Komerčni Banka AS	27 865	29 153	
CZK	9 665	Moneta Money Bank AS	38 809	46 865	
			216 293	265 511	0,4
HONGRIE					
HUF	6 325	MOL Hungarian Oil & Gas PLC	68 194	73 147	0,1
RUSSIE					
USD	70 419	Gazprom PJSC	873 913	2	
USD	4 426	Lukoil PJSC, CAAE	550 963	-	
USD	14 861	Magnit PJSC, CIAE	285 067	-	
USD	9 037	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC, CIAE, actions nominatives	113 249	-	
USD	22 647	MMC Norilsk Nickel PJSC, CAAE	844 053	-	
USD	22 956	Mobile TeleSystems PJSC, CAAE	260 323	-	
USD	655	NovaTek PJSC, CIAE	169 543	-	
USD	8 088	Novolipetsk Steel OJSC, CIAE, enregistrée S	297 464	-	
USD	30	PhosAgro PJSC	645	-	
USD	4 733	PhosAgro PJSC, CIAE	101 823	-	
USD	1 207	PJSC Polyus, CIAE	120 204	-	
USD	12 577	Rosneft Oil Co., CIAE	106 139	-	
USD	57 566	Sberbank of Russia PJSC, CAAE	1 069 429	2	
USD	11 694	Severstal	329 980	-	
USD	5 448	Surgutneftegaz, CAAE	34 410	-	
USD	3 712	Tatneft PAO, CAAE	254 085	-	
USD	23 117	VTB Bank, CIAE	35 836	-	
			5 447 126	4	-

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
R.-U.					
GBP	36 322	Evrax PLC	383 103	-	-
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			67 951 012	64 670 084	99,0
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(95 444)		
Total du portefeuille de placements			67 855 568	64 670 084	99,0
Autres actifs (passifs) nets				634 323	1,0
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				65 304 407	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
iShares MSCI Saudi Arabia ETF	2 260 334	2 120	0,1

au 31 décembre 2022

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
iShares MSCI Saudi Arabia ETF	1 195 271	1 768	0,2

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	17	57
Paiements indirects [†]	6	24

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 700 000	3 300 000
Parts rachetables émises	-	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(900 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 600 000	2 500 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,380

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	136	632
Garanties (hors trésorerie)	144	703

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	3	1
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	2	1
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,4	36,6

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Taiwan	24,2
Chine	22,5
Corée du Sud	11,1
Inde	9,4
Bésil	8,0
Afrique du Sud	5,6
Mexique	3,5
Malaisie	3,0
Indonésie	2,8
Fonds négocié(s) en bourse	2,8
Thaïlande	2,6
Autres actifs (passifs) nets	1,4
Pologne	0,7
Chili	0,7
Turquie	0,6
Philippines	0,6
République tchèque	0,4
Hongrie	0,1
Russie	0,0
Hong Kong	0,0
R.-U.	0,0
É.-U.	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des Fonds négociés en bourse.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Autre risque de prix (suite)

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Emerging Markets Dividend	6 420 476

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Emerging Markets Dividend	6 287 745

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar taiwanais	18 190	-	18 190	27,9
Dollar de Hong Kong	11 286	-	11 286	17,3
Won coréen	7 769	-	7 769	11,9
Roupie indienne	6 345	-	6 345	9,7
Réal brésilien	5 267	-	5 267	8,1
Rand sud-africain	2 809	-	2 809	4,3
Renminbi chinois	2 757	-	2 757	4,2
Peso mexicain	2 431	-	2 431	3,7
Dollar américain	2 126	-	2 126	3,3
Roupie indonésienne	1 739	-	1 739	2,7
Ringgit malaisien	1 561	-	1 561	2,4
Baht thaïlandais	1 386	-	1 386	2,1
Peso chilien	435	-	435	0,7
Zloty polonais	432	-	432	0,7
Peso philippin	356	-	356	0,5
Couronne tchèque	301	-	301	0,5
Lire turque	279	-	279	0,4
Forint hongrois	73	-	73	0,1
Livre sterling	1	-	1	0,0
Total	65 543	-	65 543	100,5

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022[~]

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar taiwanais	16 729	-	16 729	26,0
Dollar de Hong Kong	11 603	-	11 603	18,1
Won coréen	7 034	-	7 034	11,0
Roupie indienne	6 039	-	6 039	9,4
Réal brésilien	5 213	-	5 213	8,1
Rand sud-africain	3 613	-	3 613	5,6
Renminbi chinois	3 087	-	3 087	4,8
Peso mexicain	2 234	-	2 234	3,5
Ringgit malaisien	1 878	-	1 878	2,9
Roupie indonésienne	1 774	-	1 774	2,8
Dollar américain	1 769	-	1 769	2,8
Baht thaïlandais	1 618	-	1 618	2,5
Zloty polonais	460	-	460	0,7
Peso chilien	414	-	414	0,6
Lire turque	399	-	399	0,6
Peso philippin	390	-	390	0,6
Couronne tchèque	257	-	257	0,4
Forint hongrois	62	-	62	0,1
Livre sterling	1	-	1	0,0
Total	64 574	-	64 574	100,5

[~] Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 6 554 000 \$ (6 457 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des Fonds négociés en bourse.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	62 550	-	-	62 550
Fonds négocié(s) en bourse	2 120	-	-	2 120
Total	64 670	-	-	64 670

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023.

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	61 525	-	15	61 540
Fonds négocié(s) en bourse	1 767	-	-	1 767
Total	63 292	-	15	63 307

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1 et 2 et les niveaux 2 et 3 au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Niveau 3 - Rapprochement

Le ou les tableaux ci-dessous résument le mouvement des instruments financiers classés au niveau 3.

pour la période ou l'exercice clos le 30 juin 2023

	Solde au 31 déc. 2022 (en milliers de dollars)	Achats (en milliers de dollars)	Ventes (en milliers de dollars)	Transferts entrants (en milliers de dollars)	Transferts (sortants) (en milliers de dollars)	Profit (perte) réalisé(e) (en milliers de dollars)	Profit (perte) latent(e)* (en milliers de dollars)	Solde au 30 juin 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Actions	15	-	(24)	-	-	(26)	35	-
Total	15	-	(24)	-	-	(26)	35	-

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 30 juin 2023 s'est établie à nil \$.

pour la période ou l'exercice clos le 31 décembre 2022

	Solde au 31 déc. 2021 (en milliers de dollars)	Achats (en milliers de dollars)	Ventes (en milliers de dollars)	Transferts entrants (en milliers de dollars)	Transferts (sortants) (en milliers de dollars)	Profit (perte) réalisé(e) (en milliers de dollars)	Profit (perte) latent(e)** (en milliers de dollars)	Solde au 31 déc. 2022 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Actions	-	15	-	181	-	-	(181)	15
Total	-	15	-	181	-	-	(181)	15

**La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 décembre 2022 s'est établie à (5 864 744 \$).

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, des placements ayant une juste valeur de 181 000 \$ ont été transférés du niveau 1 au niveau 3 puisque des cours du marché n'étaient plus disponibles pour ces placements.

Les placements classés au niveau 3 sont évalués à la juste valeur selon des hypothèses et des données non observables qui peuvent comprendre des écarts de taux, des multiples sectoriels et des taux d'actualisation. Selon la direction, le fait de remplacer ces données par d'autres raisonnablement possibles n'aurait pas une incidence importante sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds au 31 décembre 2022.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	11 578	12 739
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	-	12
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	34	26
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	1	-
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	731	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	12 344	12 777
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	351	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	3
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	368	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	6	6
Comptes créditeurs et charges à payer	30	23
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	756	32
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	11 588	12 745

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Parts couvertes	7 514	9 153	30,06	26,15	250 000	350 000
Parts non couvertes	4 074	3 592	27,16	23,95	150 000	150 000

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	504	407
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	616	935
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 260	(3 873)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	2 380	(2 531)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(8)	4
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	8	1
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	5	8
Total des autres revenus	5	13
Total des revenus	2 385	(2 518)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	37	41
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	26
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	94	77
Taxe de vente harmonisée	5	7
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	14
Total des charges	147	166
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 238	(2 684)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts couvertes	1 618	(1 936)	5,06	(4,36)	319 890	444 199
Parts non couvertes	620	(748)	4,13	(7,05)	150 000	106 077

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	9 153	13 581	3 592	2 801	12 745	16 382
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 618	(1 936)	620	(748)	2 238	(2 684)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(219)	(176)	(138)	(71)	(357)	(247)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(12)	-	-	(1)	(12)	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(231)	(176)	(138)	(72)	(369)	(248)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 276	-	1 195	-	2 471
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 026)	(4 177)	-	-	(3 026)	(4 177)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 026)	(2 901)	-	1 195	(3 026)	(1 706)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 639)	(5 013)	482	375	(1 157)	(4 638)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	7 514	8 568	4 074	3 176	11 588	11 744

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 238	(2 684)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(616)	(935)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	26
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 260)	3 873
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 711	4 254
Achat de placements et de dérivés	(57)	(2 601)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(1)	(3)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	8	(3)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	3 033	1 925
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(369)	(248)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 470
Montant versé au rachat de parts rachetables	(3 026)	(4 177)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(3 395)	(1 955)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(362)	(30)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12	48
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	(351)	18
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	409	327
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
EUR	394	Adidas AG	96 773	101 122	
EUR	2 641	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	292 209	429 007	
EUR	93	Brunello Cucinelli SpA	7 396	10 821	
EUR	476	CIE Automotive SA	14 105	19 241	
EUR	1 949	Compagnie Générale des Établissements Michelin	80 545	76 139	
EUR	267	Ferrari NV	60 599	115 445	
EUR	544	Fiskars OYJ Abp	11 919	12 157	
EUR	59	Hermes International	73 469	169 501	
EUR	89	Hugo Boss AG	5 650	9 192	
EUR	201	Kering	134 783	146 713	
EUR	397	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	210 622	494 616	
EUR	4 207	Mercedes-Benz Group AG	369 666	447 435	
EUR	452	Moncler SpA	40 680	41 332	
EUR	147	Puma SE	10 981	11 698	
EUR	501	Salvatore Ferragamo Italia SPA	10 157	10 907	
EUR	129	Sodexo Alliance SA	15 255	18 782	
EUR	32 470	Stellantis NV	602 572	754 232	
EUR	311	Valeo	10 537	8 813	
			2 047 918	2 877 153	24,7
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
EUR	2 460	Anheuser-Busch InBev SA/NV	181 118	184 069	
EUR	103	Beiersdorf AG	14 392	18 030	
EUR	1 710	Danone	150 139	138 591	
EUR	1 014	Davide Campari-Milano NV	14 462	18 577	
EUR	616	Ebro Foods SA	12 587	14 371	
EUR	1 035	Glanbia PLC	16 761	20 470	
EUR	803	Heineken Holding NV	89 220	92 335	
EUR	1 926	Heineken NV	244 112	261 868	
EUR	475	Henkel AG & Co., KGaA	56 879	44 230	
EUR	76	Inter Parfums	4 484	7 165	
EUR	1 684	JDE Peet's N.V.	65 700	66 272	
EUR	247	Kerry Group PLC, catégorie A	36 308	31 872	
EUR	4 907	Koninklijke Ahold Delhaize NV	167 414	221 448	
EUR	751	L'Oréal SA	267 235	463 059	
EUR	560	Pernod Ricard SA	127 284	163 631	
EUR	38	Rémy Cointreau S.A.	7 748	8 062	
EUR	284	Viscofan SA	23 335	25 953	
			1 479 178	1 780 003	15,3
PRODUITS INDUSTRIELS					
EUR	4 455	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	154 113	206 902	
EUR	719	Airbus SE	108 945	137 389	
EUR	725	Andritz AG	46 818	53 432	
EUR	363	Arcadis NV	21 512	20 061	
EUR	216	Brenntag SE	16 556	22 265	
EUR	611	Bureau Veritas SA	25 078	22 158	
EUR	87	Carel Industries SPA	2 432	3 467	
EUR	224	Cargotec OYJ	11 199	16 282	
EUR	3962	CNH Industrial NV	81 284	75 530	
EUR	89	Dassault Aviation SA	18 213	23 564	
EUR	78	Duerr AG	3 797	3 338	
EUR	1 315	Fluidra SA	52 111	33 849	
EUR	264	GEA Group AG	14 886	14 601	
EUR	443	Hapag-Lloyd AG	104 992	118 891	
EUR	165	Hochtief AG	15 423	18 866	
EUR	93	IMCD Group NV	16 028	17 682	
EUR	2 677	Kone OYJ, catégorie B	219 299	184 848	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
EUR	594	Konecranes OYJ	24 977	31 600	
EUR	41	Krones AG	5 066	6 576	
EUR	359	Legrand SA	37 440	47 059	
EUR	1 440	Leonardo SPA	16 099	21 610	
EUR	3 376	Metso Outotec OYJ	42 447	53 831	
EUR	38	MTU Aero Engines Holding AG	9 276	13 024	
EUR	47	Nexans SA	5 814	5 384	
EUR	570	Prysmian SPA	26 543	31 500	
EUR	787	Schneider Electric SE	102 612	189 126	
EUR	896	Signify N.V.	51 483	33 205	
EUR	91	Société BIC SA	10 401	6 897	
EUR	43	Teleperformance	12 766	9 526	
EUR	1 222	Valmet Corp.	44 188	44 951	
EUR	5 196	WeBuild SpA	15 127	12 955	
EUR	814	Wolters Kluwer NV	86 853	136 669	
			1 403 778	1 617 038	14,0
MATÉRIAUX					
EUR	3 234	Acerinox SA	50 897	45 399	
EUR	655	Air Liquide SA	102 213	155 268	
EUR	1 122	Altri SGPS S.A.	8 636	6 742	
EUR	172	Arkema SA	25 005	21 429	
EUR	3 995	BASF SE	390 061	256 478	
EUR	413	Bekaert SA	20 954	24 744	
EUR	166	Corbion NV	7 343	5 239	
EUR	3 562	CRH PLC	172 208	259 688	
EUR	478	DSM-Firmenich AG	84 942	68 055	
EUR	108	Eramet	10 065	13 042	
EUR	1 720	Evonik Industries AG	65 456	43 280	
EUR	603	HeidelbergCement AG	54 343	65 464	
EUR	374	Huhtamaki OYJ	21 353	16 230	
EUR	207	Imerys SA	14 580	10 669	
EUR	875	Kemira OYJ	14 791	18 430	
EUR	4 535	OCI NV	236 424	143 838	
EUR	591	Solvay SA	79 983	87 283	
EUR	80	Symrise AG	9 144	11 090	
EUR	211	Wacker Chemie AG	37 314	38 305	
			1 405 712	1 290 673	11,1
SERVICES FINANCIERS					
EUR	12 931	Aegon NV	80 029	86 433	
EUR	48 216	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	399 717	489 482	
EUR	90 559	Banco Santander SA	371 468	442 545	
EUR	385	Hannover Rueckversicherungs SE	75 685	108 022	
EUR	36 898	Mapfre SA	98 644	96 895	
			1 025 543	1 223 377	10,6
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
EUR	68	Aixtron AG	2 110	3 052	
EUR	60	ASM International NV	12 970	33 639	
EUR	560	ASML Holding NV	242 735	536 004	
EUR	123	Austria Technologie & Systemtechnik AG	6 742	5 846	
EUR	232	Barco NV	6 631	7 650	
EUR	681	BE Semiconductor Industries NV	51 145	97 626	
EUR	378	Dassault Systemes SE	13 538	22 169	
EUR	789	Infineon Technologies AG	24 488	43 039	
EUR	36	Jenoptik AG	1 076	1 634	
EUR	43	Lectra	2 060	1 695	
EUR	265	Melexis NV	27 442	34 393	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
EUR	6 801	Nokia OYJ	40 918	37 658	
EUR	33	Reply SPA	5 234	4 959	
EUR	1 436	SAP SE	209 009	259 428	
EUR	82	Siltronic AG	7 013	8 287	
EUR	862	STMicroelectronics NV	36 717	56 703	
			689 828	1 153 782	10,0
SOINS DE SANTÉ					
EUR	2 329	Bayer AG, actions nominatives	235 558	170 368	
EUR	69	bioMérieux	9 665	9 575	
EUR	57	DiaSorin	14 595	7 850	
EUR	437	EssilorLuxottica SA	114 178	108 890	
EUR	84	Merck KGaA	16 922	18 378	
EUR	3 178	Sanofi SA	388 159	450 539	
EUR	23	Sartorius Stedim Biotech	8 575	7 594	
EUR	1 174	Siemens Healthineers AG	72 315	87 896	
EUR	459	UCB SA	54 177	53 806	
			914 144	914 896	7,9
SERVICES DE COMMUNICATION					
EUR	13 242	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	299 135	381 882	
EUR	94	Ipsos	4 656	6 914	
EUR	642	Publicis Groupe	50 445	68 122	
EUR	4 953	Universal Music Group NV	132 331	145 512	
			486 567	602 430	5,2
ÉNERGIE					
EUR	103	Gaztransport & Technigaz SA	16 129	13 866	
EUR	1 102	Koninklijke Vopak NV	59 323	52 007	
EUR	1 851	SBM Offshore NV	39 010	33 563	
			114 462	99 436	0,9
SERVICES PUBLICS					
EUR	21	Neoen SA	988	879	
EUR	563	Rubis SCA	29 929	18 077	
			30 917	18 956	0,2
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			9 598 047	11 577 744	99,9
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(13 582)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			9 584 465	11 577 744	99,9
Contrat(s) de change à terme				32 585	0,3
Total du portefeuille de placements			9 584 465	11 610 329	100,2
Autres actifs (passifs) nets				(22 525)	(0,2)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				11 587 804	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	7 464 720	EUR	5 146 691	1,45	34 061
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	250 561	EUR	173 975	1,44	(619)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	EUR	112 707	CAD	163 581	0,69	(857)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								32 585

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	34	(1)	-	33
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	34	(1)	-	33
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	1	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	26	(3)	-	23
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	26	(3)	-	23
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(3)	3	-	-

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	3	5
Paiements indirects [†]	1	2

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	350 000	450 000	150 000	100 000
Parts rachetables émises	-	50 000	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(150 000)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	250 000	350 000	150 000	150 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,550
Parts non couvertes	0,550

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	25	1 313
Garanties (hors trésorerie)	27	1 424

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	11	2
Charges	(3)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	8	1
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	35,6

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Biens de consommation discrétionnaire	23,9
Biens de consommation de base	15,6
Produits industriels	14,2
Matériaux	12,9
Services Financiers	10,3
Technologies de l'information	8,7
Soins de santé	7,4
Services de communication	5,7
Énergie	1,0
Services publics	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,2
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions européennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale en Europe.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Europe Hedged Equity	1 089 837

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Europe Hedged Equity	1 258 984

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Euro	11 580	(7 519)	4 061	35,0
Total	11 580	(7 519)	4 061	35,0

au 31 décembre 2022~

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Euro	12 741	(9 184)	3 557	27,9
Total	12 741	(9 184)	3 557	27,9

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 406 000 \$ (356 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	11 578	-	-	11 578
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	33	-	33
Total	11 578	33	-	11 611

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	12 739	-	-	12 739
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	23	-	23
Total	12 739	23	-	12 762

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	194 283	153 611
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	345	221
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	912	163
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	35	29
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	147	92
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	195 722	154 116
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	34	1 061
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	19	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	75	64
Comptes créditeurs et charges à payer	132	105
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	260	1 230
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	195 462	152 886

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Parts couvertes	82 900	64 536	31,28	28,06	2 650 000	2 300 000
Parts non couvertes	112 562	88 350	26,99	24,75	4 170 000	3 570 000

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 351	6 181
Intérêts aux fins des distributions	4	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	282	(3 634)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	15 351	(49 392)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	18 988	(46 845)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(11)	(81)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	17	19
Rabais sur frais	195	265
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	18	49
Total des autres revenus	219	252
Total des revenus	19 207	(46 593)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	420	478
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	98	134
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	2
Retenues d'impôts	628	749
Taxe de vente harmonisée	22	27
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	2
Total des charges	1 169	1 393
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 038	(47 986)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts couvertes	8 318	(11 370)	3,47	(5,83)	2 398 895	1 950 276
Parts non couvertes	9 720	(36 616)	2,54	(7,08)	3 828 011	5 174 972

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	64 536	56 743	88 350	176 453	152 886	233 196
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 318	(11 370)	9 720	(36 616)	18 038	(47 986)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(909)	(636)	(1 489)	(2 880)	(2 398)	(3 516)
Profits nets réalisés	-	(1 179)	-	(494)	-	(1 673)
Remboursement de capital	-	-	(94)	-	(94)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(909)	(1 815)	(1 583)	(3 374)	(2 492)	(5 189)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	10 955	21 759	16 075	-	27 030	21 759
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(5 931)	-	(55 210)	-	(61 141)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	10 955	15 828	16 075	(55 210)	27 030	(39 382)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 364	2 643	24 212	(95 200)	42 576	(92 557)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	82 900	59 386	112 562	81 253	195 462	140 639

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 038	(47 986)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(282)	3 634
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	2	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	98	134
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(15 351)	49 392
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	7 412	64 481
Achat de placements et de dérivés	(34 307)	(26 587)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(55)	(1)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	12	(33)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	20	(12)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(24 413)	43 023
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 492)	(5 189)
Produit de l'émission de parts rachetables	27 031	21 760
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(61 142)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	24 539	(44 571)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	126	(1 548)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	221	1 657
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	345	108
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 668	5 432
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(2)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SUISSE					
CHF	73 707	ABB Ltd., enregistré	2 920 263	3 835 247	
GBP	14 122	Coca-Cola HBC AG	560 643	557 117	
CHF	239	Comet Holding AG, actions nominatives	61 123	80 739	
CHF	1 237	Geberit AG, actions nominatives	775 670	856 440	
CHF	250	Givaudan SA, actions nominatives	1 020 029	1 096 361	
CHF	4 215	Logitech International SA, actions nominatives	421 510	331 913	
CHF	463	Lonza Group AG, enregistré	327 169	365 277	
CHF	47 635	Nestlé SA, actions nominatives	7 217 887	7 581 011	
CHF	63 530	Novartis AG, actions nominatives	7 256 113	8 456 878	
CHF	1 226	Partners Group Holding AG	1 838 294	1 526 107	
CHF	12 926	Roche Holding AG	5 976 601	5 228 898	
CHF	1 608	Roche Holding AG-BR	770 945	698 282	
CHF	1 287	Schindler Holding AG	417 389	399 177	
CHF	2 201	Schindler Holding AG, actions nominatives	687 202	654 342	
CHF	8 546	SGS SA, actions nominatives	1 029 475	1 068 850	
CHF	2 440	Sika AG, actions nominatives	769 494	922 804	
CHF	1 253	Sonova Holding AG, actions nominatives	626 544	441 450	
CHF	4 191	Stadler Rail AG	178 065	216 709	
CHF	1 167	Straumann Holding AG	289 556	250 540	
CHF	2 316	Sulzer AG, enregistré	218 602	263 423	
CHF	381	Swissquote Group Holding S.A.	69 122	104 647	
CHF	1 657	Temenos AG	259 062	174 351	
			33 690 758	35 110 563	18,0
R.-U.					
GBP	181 865	Airtel Africa Ltd.	341 463	329 818	
GBP	9 707	Ashtead Group PLC	728 023	889 017	
GBP	21 818	Auto Trader Group PLC	214 702	224 046	
GBP	13 326	Burberry Group PLC	443 281	475 273	
GBP	31 527	Compass Group PLC	947 213	1 167 904	
GBP	58 765	Diageo PLC	3 675 231	3 340 519	
GBP	22 720	Drax Group PLC	199 171	221 689	
GBP	1 966	Games Workshop Group PLC	252 595	361 171	
GBP	4 028	Greggs PLC	147 087	173 068	
GBP	314 162	GSK PLC	7 204 319	7 340 073	
GBP	4 608	Halma PLC	158 525	176 515	
GBP	32 118	Hargreaves Lansdown PLC	413 214	440 690	
GBP	7 366	IMI PLC	180 408	203 228	
GBP	83 404	Imperial Brands PLC	2 708 866	2 439 319	
GBP	6 142	Intertek Group PLC	535 009	440 693	
GBP	3 212	Kainos Group PLC	79 110	66 572	
GBP	59 888	RELX PLC	2 087 846	2 640 668	
GBP	33 120	Rentokil Initial PLC	284 195	342 667	
GBP	21 104	Rightmove PLC	226 676	185 755	
GBP	29 647	Rotork PLC	131 313	152 021	
GBP	12 210	RS Group PLC	225 678	156 153	
GBP	36 989	Sage Group PLC (The)	431 934	575 476	
GBP	34 011	Smith & Nephew PLC	563 124	725 514	
GBP	3 984	Spectris PLC	196 229	240 949	
GBP	1 308	Spirax-Sarco Engineering PLC	251 077	228 078	
GBP	19 312	Spirent Communications PLC	73 939	53 152	
GBP	16 842	Tate & Lyle PLC	190 855	205 701	
GBP	124 839	Unilever PLC	7 922 051	8 605 503	
GBP	4 568	Victrex PLC	155 776	106 973	
			30 968 910	32 508 205	16,6

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FRANCE					
EUR	48 490	Bollore SE	347 814	399 719	
EUR	3 244	Capgemini SE	722 974	812 778	
EUR	30 254	Carrefour SA	687 074	758 009	
EUR	1 578	Gaztransport & Technigaz SA	243 754	212 433	
EUR	859	Hermes International	1 475 102	2 467 817	
EUR	4 364	Kering	3 763 337	3 185 360	
EUR	10 166	La Française des Jeux SAEM	615 849	528 934	
EUR	9 670	L'Oréal SA	4 309 083	5 962 422	
EUR	9 874	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	9 110 220	12 301 855	
EUR	451	Sartorius Stedim Biotech	232 745	148 905	
EUR	981	Teleperformance	457 957	217 321	
EUR	6 167	Verallia	263 023	306 088	
EUR	45 635	Vivendi SE	528 683	553 801	
			22 757 615	27 855 442	14,3
JAPON					
JPY	5 369	Anritsu Corp.	92 600	60 288	
JPY	6 200	Asahi Holdings Inc.	139 512	110 176	
JPY	61 756	Astellas Pharma Inc.	1 308 304	1 215 023	
JPY	1 990	BayCurrent Consulting Inc.	86 624	97 799	
JPY	4 631	Benefit One Inc.	117 211	62 113	
JPY	4 229	BIPROGY Inc.	126 721	136 789	
JPY	5 712	Capcom Co., Ltd.	211 518	297 818	
JPY	13 530	Casio Computer Co., Ltd.	165 991	146 291	
JPY	1 729	CREATE SD HOLDINGS Co., Ltd.	60 377	56 115	
JPY	8 994	CyberAgent Inc.	94 538	86 294	
JPY	8 337	Daifuku Co., Ltd.	184 638	224 592	
JPY	3 855	Daito Trust Construction Co., Ltd.	521 396	514 754	
JPY	5 036	Daiwabo Holdings Co., Ltd.	107 971	127 966	
JPY	1 715	DIP Corp.	68 493	56 132	
JPY	4 281	Fujimi Inc.	109 178	138 549	
JPY	4 264	Fujitsu Ltd.	709 338	725 909	
JPY	893	GOLDWIN Inc.	76 054	99 742	
JPY	3 530	Hoya Corp.	561 579	551 829	
JPY	1 930	Information Services International - Dentsu	84 669	89 055	
JPY	3 611	Internet Initiative Japan Inc.	80 085	89 277	
JPY	5 294	Kakaku.com Inc.	163 663	99 989	
JPY	16 285	Kao Corp.	789 313	777 370	
JPY	1 884	KATITAS Co., Ltd.	62 543	42 742	
JPY	1 454	Keyence Corp.	912 995	903 198	
JPY	2 486	KOBE BUSSAN CO., LTD.	98 049	84 803	
JPY	13 049	KOEI TECMO HOLDINGS CO., LTD.	344 040	296 934	
JPY	778	KOSE Corp.	107 670	98 223	
JPY	3 596	M3 Inc.	213 854	102 355	
JPY	4 565	Meitec Corp.	106 933	103 397	
JPY	7 409	MIRAIT Holdings Corp.	102 489	122 808	
JPY	4 514	Monotaro Co., Ltd.	110 413	75 339	
JPY	20 335	Murata Manufacturing Co., Ltd.	1 392 774	1 533 309	
JPY	7 167	NEC Networks & System Integration Corp.	104 976	130 181	
JPY	3 243	Net One Systems Co., Ltd.	89 945	93 495	
JPY	5 555	Nexon Co., Ltd.	140 668	139 705	
JPY	3 349	NIFCO Inc.	109 181	130 585	
JPY	6 024	Nihon M&A Center Holdings Inc.	127 088	60 583	
JPY	5 109	NIPPON GAS CO., LTD.	97 993	94 554	
JPY	1 516	Nippon Shinyaku Co., Ltd.	135 671	81 527	
JPY	4 542	Nissan Chemical Corp.	301 294	256 526	
JPY	11 240	Nomura Research Institute Ltd.	475 254	407 605	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
JAPON (suite)					
JPY	3 897	NSD CO., LTD.	92 004	102 931	
JPY	1 660	OBIC Co., Ltd.	344 415	350 154	
JPY	4 676	Open House Group Co., Ltd.	234 564	221 198	
JPY	3 726	Oracle Corp. Japan	286 093	364 661	
JPY	17 340	Osaka Gas Co., Ltd.	344 685	350 444	
JPY	5 281	Persol Holdings Co., Ltd.	145 597	125 175	
JPY	12 000	Recruit Holdings Co., Ltd.	620 216	501 303	
JPY	3 579	Relo Holdings Inc.	69 462	64 059	
JPY	3 229	ROHTO Pharmaceutical Co., Ltd.	70 830	95 811	
JPY	7 982	Sega Sammy Holdings Inc.	157 443	224 492	
JPY	3 596	Seria Co., Ltd.	100 257	75 589	
JPY	3 355	Shinko Electric Industries Co., Ltd.	119 197	179 749	
JPY	1 328	Sugi Holdings Co., Ltd.	73 672	78 055	
JPY	17 130	SUMCO Corp.	309 086	318 049	
JPY	14 939	Systema Corp.	68 490	39 937	
JPY	6 661	Taiheiyo Cement Corp.	134 449	173 161	
JPY	4 287	Taiyo Yuden Co., Ltd.	234 651	160 408	
JPY	3 648	TechnoPro Holdings Inc.	121 742	103 635	
JPY	7 993	Terumo Corp.	327 331	333 837	
JPY	4 606	TIS Inc.	169 920	151 429	
JPY	6 834	Uni-Charm Corp.	293 225	334 169	
JPY	1 892	WORKMAN CO., LTD.	126 092	90 073	
JPY	9 349	ZOZO Inc.	336 587	254 294	
			15 673 611	15 214 352	7,8
PAYS-BAS					
EUR	631	ASM International NV	221 865	353 769	
EUR	5 756	ASML Holding NV	4 078 474	5 509 358	
EUR	7 048	BE Semiconductor Industries NV	635 386	1 010 373	
EUR	1 909	Corbion NV	97 575	60 245	
EUR	295 108	Koninklijke KPN NV	1 161 670	1 392 716	
EUR	9 502	Prosus NV	695 349	920 596	
EUR	19 263	SBM Offshore NV	365 907	349 285	
EUR	51 036	Universal Music Group NV	1 392 346	1 499 366	
EUR	5 596	Wolters Kluwer NV	795 337	939 559	
			9 443 909	12 035 267	6,2
SUÈDE					
SEK	5 232	AAK AB	109 654	129 987	
SEK	4 559	AB Sagax	125 333	118 964	
SEK	4 800	AddTech AB, actions B	92 508	138 072	
SEK	12 972	Alfa Laval AB	483 864	624 547	
SEK	27 452	Assa Abloy AB, catégorie B	959 348	871 043	
SEK	73 139	Atlas Copco AB, actions A	1 286 319	1 392 407	
SEK	38 020	Atlas Copco AB, catégorie B	562 127	625 306	
SEK	9 679	Avanza Bank Holding AB	264 497	260 274	
SEK	3 865	Beijer Ref AB	88 979	65 153	
SEK	8 351	Bilia AB	165 660	114 993	
SEK	17 892	Elekta AB, catégorie B	137 772	182 675	
SEK	19 182	Epiroc AB, catégorie A	555 423	479 156	
SEK	10 526	Epiroc AB, catégorie B	225 196	224 764	
SEK	24 166	Essity AB, catégorie B	736 833	849 970	
SEK	4 510	Evolution AB	630 642	754 622	
SEK	30 448	Husqvarna AB, actions B	450 294	364 210	
SEK	13 943	Investissement AB Latour	329 706	365 199	
SEK	3 011	Loomis AB	114 977	116 047	
SEK	14 175	NIBE Industrier AB, catégorie B	239 842	177 823	
SEK	12 748	Nolato AB, catégorie B	141 675	79 180	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SUEDE (suite)					
SEK	14 118	Nordnet AB	292 725	249 577	
SEK	45 069	Sandvik AB	1 343 462	1 160 585	
SEK	31 214	Securitas AB, série B	348 171	338 269	
SEK	182 483	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, actions B	1 370 796	1 305 797	
			11 055 803	10 988 620	5,6
AUSTRALIE					
AUD	2 775	Altium Ltd.	88 571	90 243	
AUD	3 503	ARB Corp., Ltd.	117 016	88 246	
AUD	14 124	Aristocrat Leisure Ltd.	528 528	480 958	
AUD	4 004	AUB Group Ltd.	77 399	103 688	
AUD	3 667	Breville Group Ltd.	76 355	64 406	
AUD	1 375	Cochlear Ltd.	287 453	277 433	
AUD	65 574	Coles Group Ltd.	1 063 873	1 063 920	
AUD	19 173	Computershare Ltd.	424 110	394 841	
AUD	7 423	CSL Ltd.	1 972 334	1 813 604	
AUD	50 138	Goodman Group	780 424	886 344	
AUD	4 093	IDP Education Ltd.	103 396	79 675	
AUD	6 695	Netwealth Group Ltd.	98 369	81 616	
AUD	227 773	Nickel Mines Ltd.	174 079	177 555	
AUD	41 751	Northern Star Resources Ltd.	371 934	444 244	
AUD	12 985	Pinnacle Investment Management Group Ltd.	99 083	114 146	
AUD	2 769	REA Group Ltd.	394 319	348 849	
AUD	13 968	Seven Group Holdings Ltd.	246 458	303 277	
AUD	6 704	Technology One Ltd.	64 918	92 414	
AUD	13 870	Washington H. Soul Pattinson & Co., Ltd.	350 397	388 256	
AUD	67 675	Wesfarmers Ltd.	2 815 581	2 941 137	
AUD	1 103	Wisetech Global Ltd.	64 622	77 539	
			10 199 219	10 312 391	5,3
ALLEMAGNE					
EUR	9 152	Adidas AG	2 501 061	2 348 906	
EUR	1 709	Aixtron AG	59 952	76 706	
EUR	2 697	Bechtle AG	132 113	141 414	
EUR	826	Carl Zeiss Meditec AG	136 612	118 102	
EUR	5 456	Fielmann AG	398 001	384 380	
EUR	1 273	Nemetschek SE	108 976	126 146	
EUR	3 476	Puma SE	272 805	276 602	
EUR	1 245	Rheinmetall AG	306 103	450 779	
EUR	33 356	SAP SE	4 581 016	6 026 106	
EUR	3 934	Stroer SE & Co., KGaA	224 280	252 732	
			8 720 919	10 201 873	5,2
ESPAGNE					
EUR	4 980	CIE Automotive SA	176 887	201 305	
EUR	168 255	Industria de Diseño Textil SA	7 295 483	8 613 375	
EUR	1 444	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	111 367	88 264	
EUR	1 823	Viscofan SA	152 089	166 593	
			7 735 826	9 069 537	4,6
DANEMARK					
DKK	65 876	Alm. Brand AS	127 934	136 410	
DKK	2 819	Christian Hansen Holdings AS	223 458	258 854	
DKK	5 197	Coloplast AS, catégorie B	974 280	859 711	
DKK	28 608	Novo Nordisk AS, catégorie B	3 722 596	6 098 065	
DKK	4 424	Novozymes AS, catégorie B	310 437	272 681	
DKK	5 265	Pandora AS	429 247	621 881	
DKK	2 254	Royal Unibrew AS	297 896	266 583	
DKK	1 044	SimCorp AS	139 715	146 348	
			6 225 563	8 660 533	4,4

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
HONG KONG					
HKD	212 582	CLP Holdings Ltd.	2 050 015	2 186 040	
HKD	61 217	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	2 749 172	3 051 424	
HKD	66 429	Techtronic Industries Co., Ltd.	1 140 203	955 117	
			5 939 390	6 192 581	3,2
ITALIE					
EUR	2 724	Amplifon SPA	160 851	132 094	
EUR	15 616	Azimut Holding SpA	365 437	445 362	
EUR	10 574	Banca Generali SPA	443 180	480 858	
EUR	61 865	Banca Mediolanum SPA	646 915	739 685	
EUR	9 493	Davide Campari-Milano NV	126 592	173 913	
EUR	10 138	De'Longhi SPA	364 799	293 010	
EUR	1 832	Ferrari NV	487 585	792 117	
EUR	23 864	FinecoBank Banca Fineco SPA	455 128	424 272	
EUR	66 293	Italgas SPA	483 986	519 199	
EUR	4 705	Moncler SpA	420 543	430 234	
EUR	20 569	RAI Way SPA	158 887	163 618	
EUR	7 125	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	493 401	450 018	
EUR	435	Reply SPA	77 315	65 374	
EUR	6 942	Technogym SPA	86 393	84 986	
			4 771 012	5 194 740	2,7
FINLANDE					
EUR	27 488	Kone OYJ, catégorie B	1 670 392	1 898 062	
EUR	6 203	Konecranes OYJ	238 435	329 994	
EUR	18 138	Neste OYJ	1 181 355	923 290	
EUR	7 595	Sanoma OYJ	112 121	72 805	
EUR	6 859	Terveystalo Oyj	75 048	81 791	
EUR	12 715	Valmet Corp.	522 190	467 716	
			3 799 541	3 773 658	1,9
SINGAPOUR					
HKD	38 346	BOC Aviation Ltd.	393 628	410 186	
ILS	8 397	Kenon Holdings Ltd.	416 381	258 998	
SGD	57 136	Singapore Exchange Ltd.	533 200	536 865	
SGD	240 495	Singapore Technologies Engineering Ltd.	799 691	865 338	
SGD	159 183	StarHub Ltd.	163 735	161 868	
			2 306 635	2 233 255	1,1
BELGIQUE					
EUR	7 668	Colruyt Group	264 971	378 041	
EUR	4 070	UCB SA	430 750	477 109	
EUR	2 676	VGP N.V.	286 660	345 761	
			982 381	1 200 911	0,6
PORTUGAL					
EUR	29 067	Jeronimo Martins SGPS SA	783 163	1 059 147	0,5
NORVÈGE					
NOK	2 368	Kongsberg Gruppen ASA	123 945	142 787	
NOK	40 440	Leroey Seafood Group ASA	256 545	203 389	
NOK	9 431	Salmar ASA	441 834	504 259	
NOK	4 092	Tomra Systems ASA	149 734	87 183	
			972 058	937 618	0,5
AUTRICHE					
EUR	1 400	Austria Technologie & Systemtechnik AG	62 304	66 536	
EUR	6 290	Österreichische Post AG	253 786	296 938	
EUR	3 048	Verbund AG	333 367	323 201	
			649 457	686 675	0,4

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ISRAËL					
ILS	6 137	Matrix IT Ltd.	193 994	165 285	
ILS	5 542	Maytronics Ltd.	120 825	100 073	
ILS	5 085	Strauss Group Ltd.	182 895	151 294	
			497 714	416 652	0,2
MEXIQUE					
GBP	33 920	Fresnillo PLC	470 848	348 205	0,2
IRLANDE					
EUR	2 194	Kerry Group PLC, catégorie A	270 704	283 102	0,1
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			177 915 036	194 283 327	99,4
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(358 482)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			177 556 554	194 283 327	99,4
Contrat(s) de change à terme				877 807	0,4
Total du portefeuille de placements			177 556 554	195 161 134	99,8
Autres actifs (passifs) nets				301 124	0,2
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				195 462 258	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	AUD	106 315	CAD	93 665	1,14	(18)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	AUD	114 496	CAD	101 011	1,13	(157)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	AUD	96 793	CAD	85 782	1,13	(521)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	168 024	AUD	186 975	0,90	3 327
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	140 703	AUD	157 494	0,89	1 974
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	4 279 454	AUD	4 864 983	0,88	(5 864)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	14 200 530	CHF	9 517 763	1,49	120 395
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	562 391	CHF	380 283	1,48	(181)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	3 604 801	DKK	18 503 260	0,19	16 909
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	77 690	DKK	400 989	0,19	(64)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	141 178	DKK	733 464	0,19	(1 045)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	28 223 659	EUR	19 459 329	1,45	128 783
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	717 926	EUR	497 358	1,44	(146)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	744 004	EUR	515 802	1,44	(697)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	1 119 197	EUR	780 427	1,43	(7 564)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	13 443 900	GBP	7 979 171	1,68	20 656
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	316 127	GBP	187 111	1,69	1 353
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	535 364	GBP	319 464	1,68	(2 066)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	2 603 719	HKD	14 994 560	0,17	71 785
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	56 686	HKD	330 602	0,17	861
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	106 159	HKD	624 949	0,17	632
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	75 293	HKD	445 887	0,17	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	6 446 995	JPY	659 856 904	0,01	404 047
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	256 968	JPY	26 801 585	0,01	11 520
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	231 694	JPY	24 061 007	0,01	11 344
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	148 787	JPY	15 580 103	0,01	6 104
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	9 543	NOK	75 663	0,13	197
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	16 296	NOK	131 465	0,12	58
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	11 137	NOK	90 200	0,12	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	414 249	NOK	3 394 598	0,12	(5 044)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	4 509 863	SEK	36 088 106	0,12	88 475
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	110 456	SEK	887 087	0,12	1 773

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	178 974	SEK	1 453 715	0,12	870
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	656 666	SGD	654 218	1,00	16 969
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	23 675	SGD	23 804	0,99	400
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	25 128	SGD	25 334	0,99	356
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CHF	228 376	CAD	336 183	0,68	1 666
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	DKK	533 207	CAD	102 943	5,18	449
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	DKK	687 544	CAD	133 280	5,16	39
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	EUR	564 410	CAD	814 702	0,69	179
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	JPY	14 308 673	CAD	131 066	109,17	(27)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	JPY	16 744 902	CAD	153 707	108,94	(358)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	JPY	18 316 365	CAD	169 202	108,25	(1 462)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	JPY	17 791 469	CAD	170 581	104,30	(7 647)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	NOK	85 149	CAD	10 449	8,15	68
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	NOK	102 827	CAD	12 642	8,13	59
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	NOK	85 314	CAD	10 492	8,13	45
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	NOK	87 485	CAD	10 861	8,05	(56)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	NOK	71 723	CAD	8 974	7,99	(115)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	SEK	1 165 838	CAD	142 737	8,17	98
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	SEK	760 151	CAD	93 343	8,14	(212)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	SGD	15 168	CAD	14 750	1,03	82
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	SGD	17 303	CAD	16 915	1,02	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	SGD	25 949	CAD	25 797	1,01	(424)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								877 807

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	912	(34)	-	878
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	912	(34)	-	878
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(34)	34	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(34)	34	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	163	(163)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	163	(163)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 061)	163	-	(898)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1 061)	163	-	(898)

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	74	80
Paiements indirects [†]	26	34

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 300 000	1 700 000	3 570 000	5 770 000
Parts rachetables émises	350 000	700 000	600 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(200 000)	-	(2 200 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 650 000	2 200 000	4 170 000	3 570 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,480
Parts non couvertes	0,480

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	485	5 766
Garanties (hors trésorerie)	517	6 582

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	24	31
Charges	(7)	(12)
Revenu tiré des prêts de titres	17	19
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	38,8

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Suisse	19,0
R.-U.	18,0
France	13,0
Japon	8,4
Australie	5,8
Suède	5,8
Pays-Bas	5,7
Allemagne	4,5
Danemark	4,4
Espagne	3,6
Hong Kong	3,5
Italie	2,7
Finlande	2,1
Singapour	1,2
Norvège	0,6
Belgique	0,5
Portugal	0,5
Autriche	0,4
Mexique	0,3
Israël	0,3
Irlande	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Chine	0,0
Chili	0,0
Contrat(s) de change à terme	(0,6)
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,5
Total	0,5

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth	18 861 760

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth	14 967 815

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Euro	71 362	(29 870)	41 492	21,2
Franc suisse	34 555	(14 305)	20 250	10,4
Livre sterling	33 551	(14 275)	19 276	9,9
Yen japonais	15 267	(6 036)	9 231	4,7
Couronne suédoise	10 990	(4 472)	6 518	3,3
Dollar australien	10 324	(4 309)	6 015	3,1
Couronne danoise	8 662	(3 571)	5 091	2,6
Dollar de Hong Kong	6 613	(2 769)	3 844	2,0
Dollar de Singapour	1 566	(631)	935	0,5
Shekel israélien	677	-	677	0,3
Couronne norvégienne	939	(403)	536	0,3
Dollar américain	1	-	1	0,0
Total	194 507	(80 641)	113 866	58,3

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022[~]

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)		Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Euro	50 931	(22 035)		28 896	18,9
Livre sterling	28 234	(12 002)		16 232	10,6
Franc suisse	28 507	(12 522)		15 985	10,5
Yen japonais	12 925	(5 657)		7 268	4,8
Dollar australien	8 934	(3 813)		5 121	3,3
Couronne suédoise	8 938	(3 835)		5 103	3,3
Couronne danoise	6 769	(2 916)		3 853	2,5
Dollar de Hong Kong	5 750	(2 473)		3 277	2,1
Dollar de Singapour	1 222	(529)		693	0,5
Couronne norvégienne	850	(361)		489	0,3
Shekel israélien	723	(291)		432	0,3
Dollar américain	(1)	-		(1)	0,0
Total	153 782	(66 434)		87 348	57,1

[~]Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 11 387 000 \$ (8 735 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	194 283	-	-	194 283
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	878	-	878
Total	194 283	878	-	195 161

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	153 611	-	-	153 611
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(898)	-	(898)
Total	153 611	(898)	-	152 713

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	17 236	18 248
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	33	16
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	47	105
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	14	11
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	17 330	18 380
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	17	43
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	2	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	9	10
Comptes créditeurs et charges à payer	51	38
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	79	91
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	17 251	18 289

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts à couverture variable	17 251	18 289	28,75	26,13	600 000

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	327	1 196
Intérêts aux fins des distributions	-	1
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	448	738
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 249	(9 482)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	2 024	(7 547)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(3)	(22)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	3
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	2	9
Total des autres revenus	-	(10)
Total des revenus	2 024	(7 557)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	54	121
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	17	57
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	58	144
Taxe de vente harmonisée	7	17
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	4
Total des charges	137	343
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 887	(7 900)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts à couverture variable	1 887	(7 900)	3,11	(5,78)	606 077	1 367 956

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts à couverture variable	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	18 289	43 625
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 887	(7 900)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(185)	(308)
Profits nets réalisés	-	(568)
Remboursement de capital	(8)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(193)	(876)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 732)	(7 722)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(2 732)	(7 722)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 038)	(16 498)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	17 251	27 127

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 887	(7 900)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(448)	(738)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	17	57
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 249)	9 482
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 632	167
Achat de placements et de dérivés	(1 905)	(598)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(3)	(3)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	(4)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(3)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	12	(2)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	2 942	461
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(192)	(876)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	3 116
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 733)	(2 707)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(2 925)	(467)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	(3)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	17	(6)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	16	32
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	33	23
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	266	1 048
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	(3)
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SUISSE					
CHF	6 798	ABB Ltd., enregistré	262 966	353 725	
GBP	1 451	Coca-Cola HBC AG	60 185	57 242	
CHF	129	Geberit AG, actions nominatives	80 855	89 314	
CHF	24	Givaudan SA, actions nominatives	96 593	105 251	
CHF	479	Logitech International SA, actions nominatives	42 357	37 719	
CHF	4 256	Nestlé SA, actions nominatives	635 264	677 334	
CHF	5 643	Novartis AG, actions nominatives	629 427	751 174	
CHF	119	Partners Group Holding AG	152 678	148 129	
CHF	1 138	Roche Holding AG	534 755	460 350	
CHF	135	Roche Holding AG-BR	59 127	58 624	
CHF	134	Schindler Holding AG	42 972	41 562	
CHF	216	Schindler Holding AG, actions nominatives	70 138	64 215	
CHF	839	SGS SA, actions nominatives	101 849	104 934	
CHF	252	Sika AG, actions nominatives	79 534	95 306	
CHF	132	Sonova Holding AG, actions nominatives	66 405	46 506	
			2 915 105	3 091 385	17,8
R.-U.					
GBP	18 309	Airtel Africa Ltd.	34 017	33 204	
GBP	964	Ashtead Group PLC	65 321	88 288	
GBP	3 267	Auto Trader Group PLC	33 438	33 548	
GBP	1 360	Burberry Group PLC	45 875	48 504	
GBP	3 029	Compass Group PLC	89 329	112 208	
GBP	5 312	Diageo PLC	339 252	301 963	
GBP	2 516	Drax Group PLC	22 095	24 550	
GBP	222	Games Workshop Group PLC	26 852	40 783	
GBP	27 942	GSK PLC	635 963	652 836	
GBP	3 448	Hargreaves Lansdown PLC	44 899	47 310	
GBP	7 679	Imperial Brands PLC	249 600	224 588	
GBP	708	Intertek Group PLC	63 233	50 799	
GBP	5 570	RELX PLC	179 311	245 601	
GBP	3 523	Rightmove PLC	37 900	31 009	
GBP	4 463	Sage Group PLC (The)	52 992	69 436	
GBP	3 476	Smith & Nephew PLC	57 187	74 149	
GBP	2 717	Tate & Lyle PLC	31 791	33 184	
GBP	11 093	Unilever PLC	692 185	764 671	
			2 701 240	2 876 631	16,7
FRANCE					
EUR	5 281	Bollore SE	37 256	43 533	
EUR	337	Capgemini SE	76 543	84 435	
EUR	2 974	Carrefour SA	66 852	74 513	
EUR	77	Hermes International	99 264	221 213	
EUR	385	Kering	349 653	281 018	
EUR	1 041	La Française des Jeux SAEM	64 807	54 163	
EUR	855	L'Oréal SA	357 816	527 184	
EUR	873	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	684 703	1 087 656	
EUR	57	Sartorius Stedim Biotech	31 641	18 819	
EUR	116	Teleperformance	43 699	25 698	
EUR	680	Verallia	29 179	33 751	
EUR	4 611	Vivendi SE	53 488	55 957	
			1 894 901	2 507 940	14,5
JAPON					
JPY	6 114	Astellas Pharma Inc.	126 318	120 290	
JPY	683	Capcom Co., Ltd.	25 074	35 611	
JPY	2 264	Casio Computer Co., Ltd.	28 740	24 479	
JPY	419	Daito Trust Construction Co., Ltd.	55 800	55 949	
JPY	455	Fujitsu Ltd.	76 275	77 460	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
JAPON (suite)					
JPY	429	Hoya Corp.	66 560	67 064	
JPY	1 666	Kao Corp.	81 072	79 527	
JPY	164	Keyence Corp.	102 582	101 874	
JPY	1 638	KOEI TECMO HOLDINGS CO., LTD.	43 444	37 273	
JPY	1 598	MIRAIT Holdings Corp.	23 540	26 488	
JPY	2 063	Murata Manufacturing Co., Ltd.	140 070	155 554	
JPY	783	Nexon Co., Ltd.	20 043	19 692	
JPY	656	Nissan Chemical Corp.	43 221	37 050	
JPY	1 314	Nomura Research Institute Ltd.	55 558	47 651	
JPY	228	OBIC Co., Ltd.	47 769	48 093	
JPY	603	Open House Group Co., Ltd.	29 885	28 525	
JPY	453	Oracle Corp. Japan	35 605	44 335	
JPY	1 859	Osaka Gas Co., Ltd.	36 785	37 571	
JPY	1 077	Persol Holdings Co., Ltd.	30 299	25 528	
JPY	1 409	Recruit Holdings Co., Ltd.	70 526	58 861	
JPY	1 058	Sega Sammy Holdings Inc.	20 644	29 756	
JPY	2 000	SUMCO Corp.	36 291	37 134	
JPY	1 098	Terumo Corp.	44 182	45 859	
JPY	789	TIS Inc.	29 360	25 939	
JPY	853	Uni-Charm Corp.	36 973	41 710	
JPY	1 133	ZOZO Inc.	39 334	30 818	
			1 345 950	1 340 091	7,8
PAYS-BAS					
EUR	69	ASM International NV	17 931	38 685	
EUR	517	ASML Holding NV	278 007	494 846	
EUR	679	BE Semiconductor Industries NV	55 611	97 339	
EUR	26 143	Koninklijke KPN NV	99 524	123 378	
EUR	893	Prosus NV	63 992	86 518	
EUR	1 954	SBM Offshore NV	37 170	35 431	
EUR	4 709	Universal Music Group NV	126 626	138 344	
EUR	538	Wolters Kluwer NV	74 398	90 329	
			753 259	1 104 870	6,4
SUÈDE					
SEK	1 253	Alfa Laval AB	44 665	60 327	
SEK	2 626	Assa Abloy AB, catégorie B	96 668	83 322	
SEK	6 682	Atlas Copco AB, actions A	115 729	127 210	
SEK	3 592	Atlas Copco AB, catégorie B	45 843	59 077	
SEK	1 100	Avanza Bank Holding AB	31 312	29 580	
SEK	2 718	Epiroc AB, catégorie A	79 544	67 894	
SEK	2 147	Essity AB, catégorie B	62 927	75 515	
SEK	421	Evolution AB	48 657	70 443	
SEK	3 294	Husqvarna AB, actions B	50 573	39 402	
SEK	1 575	Investissement AB Latour	38 302	41 253	
SEK	1 725	NIBE Industrier AB, catégorie B	30 035	21 640	
SEK	1 698	Nordnet AB	36 428	30 017	
SEK	4 265	Sandvik AB	134 141	109 829	
SEK	3 318	Securitas AB, série B	37 952	35 957	
SEK	16 555	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, actions B	124 275	118 463	
			977 051	969 929	5,6
AUSTRALIE					
AUD	1 473	Aristocrat Leisure Ltd.	56 361	50 159	
AUD	175	Cochlear Ltd.	36 644	35 310	
AUD	6 395	Coles Group Ltd.	103 948	103 757	
AUD	2 051	Computershare Ltd.	45 792	42 237	
AUD	692	CSL Ltd.	181 013	169 071	
AUD	5 020	Goodman Group	79 391	88 744	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
AUSTRALIE (suite)					
AUD	24 408	Nickel Mines Ltd.	19 373	19 027	
AUD	3 704	Northern Star Resources Ltd.	30 595	39 412	
AUD	343	REA Group Ltd.	48 625	43 212	
AUD	1 680	Seven Group Holdings Ltd.	30 676	36 477	
AUD	1 593	Washington H. Soul Pattinson & Co., Ltd.	40 525	44 592	
AUD	6 291	Wesfarmers Ltd.	260 315	273 405	
			933 258	945 403	5,5
ALLEMAGNE					
EUR	819	Adidas AG	240 205	210 200	
EUR	577	Fielmann AG	41 237	40 650	
EUR	351	Puma SE	29 022	27 931	
EUR	120	Rheinmetall AG	28 142	43 449	
EUR	3 006	SAP SE	397 568	543 065	
EUR	427	Stroer SE & Co., KGaA	24 325	27 432	
			760 499	892 727	5,2
ESPAGNE					
EUR	652	CIE Automotive SA	24 524	26 356	
EUR	14 965	Industria de Diseño Textil SA	668 504	766 094	
			693 028	792 450	4,6
DANEMARK					
DKK	325	Christian Hansen Holdings AS	26 289	29 843	
DKK	505	Coloplast AS, catégorie B	93 465	83 539	
DKK	2 555	Novo Nordisk AS, catégorie B	277 497	544 623	
DKK	493	Novozymes AS, catégorie B	34 738	30 387	
DKK	521	Pandora AS	41 356	61 538	
DKK	253	Royal Unibrew AS	30 502	29 923	
			503 847	779 853	4,5
HONG KONG					
HKD	18 634	CLP Holdings Ltd.	178 324	191 619	
HKD	5 422	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	232 853	270 265	
HKD	6 212	Techtronic Industries Co., Ltd.	111 812	89 316	
			522 989	551 200	3,2
ITALIE					
EUR	1 609	Azimut Holding SpA	38 431	45 888	
EUR	1 095	Banca Generali SPA	46 673	49 796	
EUR	5 919	Banca Mediolanum SPA	61 747	70 770	
EUR	1 070	De'Longhi SPA	40 065	30 925	
EUR	171	Ferrari NV	41 338	73 937	
EUR	2 458	FinecoBank Banca Fineco SPA	47 469	43 700	
EUR	5 536	Italgas SPA	39 525	43 357	
EUR	480	Moncler SpA	44 820	43 892	
EUR	728	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	50 314	45 981	
			410 382	448 246	2,6
FINLANDE					
EUR	2 514	Kone OYJ, catégorie B	149 415	173 593	
EUR	699	Konecranes OYJ	27 018	37 186	
EUR	1 706	Neste OYJ	101 002	86 842	
EUR	1 347	Valmet Corp.	50 286	49 549	
			327 721	347 170	2,0
SINGAPOUR					
HKD	3 433	BOC Aviation Ltd.	35 303	36 723	
ILS	890	Kenon Holdings Ltd.	44 286	27 451	
SGD	5 856	Singapore Exchange Ltd.	52 788	55 025	
SGD	22 744	Singapore Technologies Engineering Ltd.	75 300	81 836	
			207 677	201 035	1,2

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PORTUGAL					
EUR	2 831	Jeronimo Martins SGPS SA	73 388	103 156	0,6
BELGIQUE					
EUR	417	UCB SA	43 539	48 883	
EUR	292	VGP N.V.	32 351	37 729	
			75 890	86 612	0,5
NORVÈGE					
NOK	4 965	Leroey Seafood Group ASA	32 156	24 971	
NOK	955	Salmar ASA	44 804	51 062	
			76 960	76 033	0,4
AUTRICHE					
EUR	699	Österreichische Post AG	28 612	32 999	
EUR	279	Verbund AG	30 255	29 584	
			58 867	62 583	0,4
MEXIQUE					
GBP	2 919	Fresnillo PLC	43 904	29 965	0,2
ISRAËL					
ILS	1 077	Matrix IT Ltd.	33 301	29 006	0,2
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			15 309 217	17 236 285	99,9
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(26 882)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			15 282 335	17 236 285	99,9
Contrat(s) de change à terme				30 251	0,2
Total du portefeuille de placements			15 282 335	17 266 536	100,1
Autres actifs (passifs) nets				(15 793)	(0,1)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				17 250 743	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	AUD	14 662	CAD	12 889	1,14	28
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	AUD	12 294	CAD	10 846	1,13	(17)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	367 203	AUD	407 017	0,90	8 653
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	8 292	AUD	9 442	0,88	(25)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	31 062	CHF	21 022	1,48	(51)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	1 146 807	CHF	777 892	1,47	(4 521)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	4 190	DKK	21 630	0,19	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	4 339	DKK	22 411	0,19	(8)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	193 095	DKK	1 000 020	0,19	(862)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	36 946	EUR	25 609	1,44	(35)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	61 533	EUR	42 653	1,44	(60)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	1 545 018	EUR	1 074 462	1,44	(6 553)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	15 276	GBP	9 042	1,69	66
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	17 560	GBP	10 508	1,67	(116)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	734 256	GBP	439 133	1,67	(4 461)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	219 113	HKD	1 283 458	0,17	2 386
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	8 604	HKD	50 909	0,17	8
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	4 566	HKD	27 072	0,17	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	710 846	JPY	73 975 053	0,01	32 878
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	19 625	JPY	2 140 188	0,01	11
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	1 141	NOK	9 062	0,13	22
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	1 072	NOK	8 722	0,12	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	30 827	NOK	249 623	0,12	(10)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	122 582	SEK	990 017	0,12	1 269
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	2 532	SEK	20 335	0,12	41

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	3 938	SEK	32 267	0,12	(16)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	69 383	SGD	69 756	0,99	1 168
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	2 279	SGD	2 331	0,98	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CHF	32 988	CAD	48 580	0,68	244
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	DKK	21 392	CAD	4 127	5,18	22
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	DKK	37 880	CAD	7 345	5,16	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	EUR	24 781	CAD	35 592	0,70	193
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	EUR	29 422	CAD	42 477	0,69	10
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	GBP	18 228	CAD	30 616	0,60	48
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	HKD	46 755	CAD	7 865	5,94	30
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	JPY	4 027 273	CAD	36 914	109,10	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	JPY	1 818 617	CAD	16 725	108,74	(57)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	NOK	7 373	CAD	905	8,15	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	NOK	7 570	CAD	931	8,13	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	NOK	6 059	CAD	745	8,13	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	NOK	9 143	CAD	1 135	8,05	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	NOK	9 675	CAD	1 209	8,00	(14)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	SEK	28 918	CAD	3 541	8,17	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	SEK	20 813	CAD	2 556	8,14	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	SEK	26 822	CAD	3 295	8,14	(8)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	SGD	1 425	CAD	1 391	1,03	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	SGD	2 356	CAD	2 304	1,02	1
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								30 251

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	47	(17)	-	30
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	47	(17)	-	30
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(17)	17	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(17)	17	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	105	(43)	-	62
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	105	(43)	-	62
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(43)	43	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(43)	43	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	6	14
Paiements indirects [†]	2	6

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts à couverture variable	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	700 000	1 400 000
Parts rachetables émises	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(300 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	600 000	1 100 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts à couverture variable	0,630

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	1 062
Garanties (hors trésorerie)	-	1 171

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	5
Charges	-	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	1	3
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	38,5

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Suisse	18,8
R.-U.	17,8
France	12,7
Japon	8,4
Suède	5,8
Australie	5,8
Pays-Bas	5,7
Allemagne	4,5
Danemark	4,4
Espagne	3,6
Hong Kong	3,5
Italie	2,7
Finlande	2,1
Singapour	1,2
Norvège	0,6
Belgique	0,5
Portugal	0,5
Autriche	0,4
Contrat(s) de change à terme	0,3
Mexique	0,3
Israël	0,3
Irlande	0,2
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,6
Total	0,6

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Variably (couvert en \$ CA)	1 716 242

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Variably (couvert en \$ CA)	1 824 422

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Euro	6 348	(1 572)	4 776	27,7
Livre sterling	2 979	(741)	2 238	13,0
Franc suisse	3 035	(1 134)	1 901	11,0
Couronne suédoise	971	(118)	853	4,9
Yen japonais	1 346	(644)	702	4,1
Dollar australien	948	(343)	605	3,5
Couronne danoise	781	(191)	590	3,4
Dollar de Hong Kong	590	(222)	368	2,1
Dollar de Singapour	139	(67)	72	0,4
Shekel israélien	57	-	57	0,3
Couronne norvégienne	79	(28)	51	0,3
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
Dollar américain	2	-	2	0,0
Total	17 276	(5 060)	12 216	70,7

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022[~]

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Euro	6 023	(2 023)	4 000	21,9
Franc suisse	3 393	(2 266)	1 127	6,2
Livre sterling	3 378	(2 791)	587	3,2
Dollar de Hong Kong	685	(114)	571	3,1
Couronne danoise	803	(270)	533	2,9
Yen japonais	1 539	(1 066)	473	2,6
Couronne suédoise	1 067	(888)	179	1,0
Dollar de Singapour	141	(70)	71	0,4
Shekel israélien	87	(41)	46	0,3
Couronne norvégienne	103	(86)	17	0,1
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
Dollar américain	1	-	1	0,0
Dollar australien	1 064	(1 066)	(2)	0,0
Total	18 285	(10 681)	7 604	41,7

[~] Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 222 000 \$ (760 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	17 236	-	-	17 236
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	30	-	30
Total	17 236	30	-	17 266

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	18 248	-	-	18 248
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	62	-	62
Total	18 248	62	-	18 310

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	687 905	402 419
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 393	412
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	200	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	255	148
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	1 383	1 088
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	458	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	692 594	404 067
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	41
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	458	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	256	157
Comptes créditeurs et charges à payer	542	393
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	1 256	591
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	691 338	403 476

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Parts couvertes	9 224	2 877	36,90	28,77	250 000	100 000
Parts non couvertes	682 114	400 599	27,71	24,81	24 620 000	16 150 000

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	9 282	7 490
Intérêts aux fins des distributions	42	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 652	(5 217)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	55 559	(47 587)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	66 535	(45 314)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(683)	(358)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	217	109
Rabais sur frais	1 193	826
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	126	47
Total des autres revenus	853	624
Total des revenus	67 388	(44 690)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	1 217	864
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	217	139
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	1 392	1 123
Taxe de vente harmonisée	8	17
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	6
Total des charges	2 835	2 150
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	64 553	(46 840)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts couvertes	1 202	17	8,99	0,17	133 702	100 000
Parts non couvertes	63 351	(46 857)	3,32	(3,25)	19 089 669	14 417 265

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 877	2 782	400 599	394 618	403 476	397 400
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 202	17	63 351	(46 857)	64 553	(46 840)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(72)	(18)	(7 102)	(6 691)	(7 174)	(6 709)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(1)	(26)	(1 202)	(74)	(1 203)	(100)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(73)	(44)	(8 304)	(6 765)	(8 377)	(6 809)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	5 218	-	241 158	11 704	246 376	11 704
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(14 690)	(57 696)	(14 690)	(57 696)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5 218	-	226 468	(45 992)	231 686	(45 992)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 347	(27)	281 515	(99 614)	287 862	(99 641)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 224	2 755	682 114	295 004	691 338	297 759

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	64 553	(46 840)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 652)	5 217
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	13	(25)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	217	139
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(55 559)	47 587
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	28 275	63 345
Achat de placements et de dérivés	(257 009)	(13 759)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(295)	216
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	100	(44)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	41	80
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(221 316)	55 916
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(8 376)	(6 809)
Produit de l'émission de parts rachetables	246 375	11 705
Montant versé au rachat de parts rachetables	(14 689)	(57 696)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	223 310	(52 800)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(13)	25
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 994	3 116
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	412	168
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	2 393	3 309
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	7 596	6 583
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	42	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS					
JPY	48 029	AGC Inc.	2 453 168	2 270 255	
JPY	16 435	ALCONIX CORP.	219 287	206 590	
JPY	15 692	Alps Logistics Co., Ltd.	188 531	231 730	
JPY	76 882	Amada Co., Ltd.	955 704	994 571	
JPY	24 801	ANEST IWATA Corp.	229 857	267 929	
JPY	27 056	Asahi Diamond Industrial Co., Ltd.	201 186	214 511	
JPY	12 773	BeNext-Yumeshin Group Co.	234 805	245 222	
JPY	14 287	CHORI CO., LTD.	305 036	386 647	
JPY	13 552	COSEL CO., LTD.	121 029	155 214	
JPY	31 354	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	963 252	1 170 601	
JPY	27 332	Daifuku Co., Ltd.	761 846	736 303	
JPY	12 887	Daikin Industries Ltd.	3 157 426	3 452 783	
JPY	27 916	DMG Mori Seiki Co., Ltd.	536 146	635 876	
JPY	16 316	Ebara Corp.	945 075	1 025 172	
JPY	8 338	en Japan Inc.	195 854	189 161	
JPY	10 213	ENVIPRO HOLDINGS Inc.	65 308	51 613	
JPY	115 504	FANUC Corp.	5 627 889	5 321 163	
JPY	13 690	Fuji Electric Co., Ltd.	759 655	788 357	
JPY	29 706	Fujikura Ltd.	280 909	327 038	
JPY	2 588	Harmonic Drive Systems Inc.	110 375	109 228	
JPY	36 969	Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	1 125 595	1 363 314	
JPY	89 767	Hitachi Ltd.	6 196 618	7 311 060	
JPY	13 770	HOKUETSU INDUSTRIES CO., LTD.	162 574	176 873	
JPY	10 164	Hoshizaki Corp.	512 523	479 785	
JPY	5 476	HOSOKAWA MICRON CORP.	147 326	175 720	
JPY	27 681	IHI Corp.	926 686	985 319	
JPY	49 827	Iino Kaiun Kaisha Ltd.	394 337	386 382	
JPY	18 453	Inabata & Co., Ltd.	429 834	544 836	
JPY	22 112	Inui Global Logistics Co., Ltd.	368 544	264 387	
JPY	240 966	ITOCHU Corp.	10 057 404	12 546 075	
JPY	11 763	Iwaki Co., Ltd.	150 051	149 908	
JPY	16 881	JGC Holdings Corp.	292 656	288 234	
JPY	106 629	Kajima Corp.	1 804 281	2 118 380	
JPY	17 164	Kawasaki Heavy Industries Ltd.	471 376	577 333	
JPY	34 147	Kitz Corp.	297 593	339 196	
JPY	169 594	Komatsu Ltd.	5 595 574	6 025 915	
JPY	8 634	Kurita Water Industries Ltd.	480 082	434 280	
JPY	9 261	Kyokuto Boeki Kaisha Ltd.	124 084	148 885	
JPY	11 191	Mabuchi Motor Co., Ltd.	451 525	410 644	
JPY	5 126	Makino Milling Machine Co., Ltd.	234 908	261 868	
JPY	600 044	Marubeni Corp.	9 060 190	13 404 228	
JPY	18 348	MAX. CO., LTD.	383 324	443 299	
JPY	14 429	MISUMI Group Inc.	562 500	378 997	
JPY	390 964	Mitsubishi Corp.	17 318 601	24 804 980	
JPY	276 425	Mitsubishi Electric Corp.	4 634 493	5 129 794	
JPY	35 398	Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	1 638 842	2 174 878	
JPY	12 077	MITSUBISHI PENCIL Co., Ltd.	167 493	185 090	
JPY	20 434	Mitsuboshi Belting Ltd.	665 145	824 078	
JPY	419 953	Mitsui & Co., Ltd.	16 064 559	20 804 012	
JPY	6 320	Mitsui Matsushima Co.	172 872	150 439	
JPY	252 571	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	7 519 525	7 991 459	
JPY	10 914	MITSUMI-SOKO Co., Ltd.	350 251	349 221	
JPY	15 488	Nabtesco Corp.	621 704	447 934	
JPY	7 532	Nachi-Fujikoshi Corp.	282 922	281 345	
JPY	79 462	NGK Insulators Ltd.	1 478 416	1 246 922	
JPY	11 326	NIHON FLUSH CO., LTD.	101 718	100 478	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
JPY	14 006	Nippon Express Holdings Inc.	1 163 365	1 039 160	
JPY	6 260	Nippon Koei Co., Ltd.	206 159	214 346	
JPY	34 938	NIPPON THOMPSON Co., Ltd.	191 094	189 360	
JPY	364 220	Nippon Yusen Kabushiki Kaisha	10 185 910	10 637 103	
JPY	7 431	Nishi-Nippon Railroad Co.	191 116	166 305	
JPY	3 649	NISSEI ASB MACHINE Co., Ltd.	141 335	136 803	
JPY	18 297	NISSEI PLASTIC INDUSTRIAL CO., LTD.	168 089	166 005	
JPY	42 085	Nisshinbo Holdings Inc.	418 512	458 504	
JPY	8 902	Nissin Corp.	175 532	204 483	
JPY	4 830	Nitto Boseki Co., Ltd.	100 434	101 131	
JPY	13 749	NITTO KOHKI CO., LTD.	226 085	248 729	
JPY	2 539	Nomura Micro Science Co., Ltd.	111 479	156 207	
JPY	6 920	Noritake Co., Ltd.	292 052	345 914	
JPY	4 778	Noritsu Koki Co.	113 653	101 485	
JPY	11 339	NS United Kaiun Kaisha Ltd.	390 715	355 553	
JPY	110 734	NSK Ltd.	830 181	930 055	
JPY	47 180	NTN Corp.	134 830	131 052	
JPY	129 304	Obayashi Corp.	1 253 227	1 472 656	
JPY	2 359	OKAMOTO MACHINE TOOL WORKS LTD.	114 375	136 926	
JPY	7 976	Organo Corp.	236 104	309 248	
JPY	22 547	OSG Corp.	435 585	424 921	
JPY	48 612	Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	371 217	343 626	
JPY	16 254	Persol Holdings Co., Ltd.	441 778	385 266	
JPY	5 298	PILOT CORP.	240 031	220 937	
JPY	36 160	Recruit Holdings Co., Ltd.	1 764 332	1 510 594	
JPY	9 751	Ryobi Ltd.	126 657	182 384	
JPY	41 182	Sanwa Shutter Corp.	611 351	703 350	
JPY	2 743	Sanyo Denki Co., Ltd.	167 885	194 624	
JPY	9 044	SEIKA CORP.	151 160	163 033	
JPY	78 629	SG Holdings Co., Ltd.	1 513 522	1 473 926	
JPY	7 639	Shinwa Co., Ltd.	150 750	164 002	
JPY	14 742	SINFONIA TECHNOLOGY CO., LTD.	210 540	231 602	
JPY	4 814	SMC Corp.	3 286 681	3 502 941	
JPY	92 387	Sojitz Corp.	2 204 293	2 687 181	
JPY	489 070	Sumitomo Corp.	10 433 768	13 616 212	
JPY	40 298	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	1 239 702	1 268 406	
JPY	11 918	Tadano Ltd.	110 963	124 879	
JPY	9 204	Teikoku Electric Manufacturing Co., Ltd.	200 977	228 863	
JPY	20 479	THK Co., Ltd.	542 632	552 157	
JPY	18 157	Toto Ltd.	963 375	718 951	
JPY	4 433	Toyo Tanso Co., Ltd.	167 323	207 796	
JPY	59 818	Toyota Tsusho Corp.	3 273 627	3 909 652	
JPY	18 666	Transcosmos Inc.	575 634	609 228	
JPY	15 582	Tsubakimoto Chain Co.	508 224	522 837	
JPY	16 624	TSUGAMI Corp.	195 166	209 879	
JPY	7 666	Union Tool Co.	248 434	226 343	
JPY	1 797	Weathernews Inc.	123 519	109 241	
JPY	10 056	WILL GROUP INC.	117 399	101 363	
JPY	18 363	YASKAWA Electric Corp.	960 771	1 106 716	
			157 540 007	185 687 447	26,9
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
JPY	11 426	ABC-Mart Inc.	804 333	816 671	
JPY	66 174	AISIN Corp.	2 747 721	2 682 043	
JPY	6 962	ARCLAND SERVICE Holdings Co., Ltd.	156 747	186 053	
JPY	14 290	Asics Corp.	428 746	578 391	
JPY	7 528	AUCNET INC.	139 512	117 441	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
JPY	109 908	Bandai Namco Holdings Inc.	3 270 576	3 341 697	
JPY	117 436	Bridgestone Corp.	6 143 747	6 334 799	
JPY	47 524	Casio Computer Co., Ltd.	745 719	513 845	
JPY	25 885	DAIDO METAL CO., LTD.	124 717	116 359	
JPY	99 405	DENSO Corp.	7 858 797	8 777 672	
JPY	3 601	DESCENTE LTD.	129 627	134 674	
JPY	26 601	Exedy Corp.	476 441	588 875	
JPY	12 193	Fast Retailing Co., Ltd.	3 758 832	4 099 040	
JPY	16 444	FUJIKURA COMPOSITES Inc.	137 391	147 236	
JPY	16 953	Fukoku Co., Ltd.	179 710	216 826	
JPY	8 337	Furukawa Battery Co., Ltd. (The)	84 476	79 533	
JPY	35 736	Futaba Industrial Co., Ltd.	137 112	172 419	
JPY	5 778	GLOBERIDE Inc.	134 622	119 446	
JPY	6 308	GSI Creos Corp.	93 712	118 101	
JPY	350 543	Honda Motor Co., Ltd.	12 680 351	13 931 567	
JPY	20 957	ICHIKOH INDUSTRIES LTD.	88 306	104 375	
JPY	20 052	IDOM Inc.	147 246	160 817	
JPY	169 738	Isuzu Motors Ltd.	2 639 827	2 703 941	
JPY	42 582	JTEKT Corp.	470 703	508 751	
JPY	34 455	JVCKENWOOD Corp.	122 365	155 829	
JPY	127 029	Mazda Motor Corp.	1 345 126	1 620 611	
JPY	7 376	Mizuno Corp.	203 974	250 532	
JPY	24 436	MORITO CO., LTD.	204 504	236 916	
JPY	82 878	NGK Spark Plug Co., Ltd.	2 046 670	2 187 524	
JPY	78 112	NHK Spring Co., Ltd.	712 621	749 817	
JPY	12 020	NIFCO Inc.	463 937	468 685	
JPY	56 137	Nikon Corp.	781 293	954 656	
JPY	238 940	Nissan Motor Co., Ltd.	1 114 760	1 286 716	
JPY	43 388	Nok Corp.	666 961	833 978	
JPY	349 847	Panasonic Holdings Corp.	4 716 544	5 616 332	
JPY	12 541	PIOLAX INC.	220 806	248 920	
JPY	8 826	Riken Corp.	207 935	252 512	
JPY	14 674	Rinnai Corp.	530 526	420 630	
JPY	31 308	ROUND ONE Corp.	181 403	163 093	
JPY	42 154	Ryohin Keikaku Co., Ltd.	740 408	548 984	
JPY	3 281	Saizeriya Co., Ltd.	93 469	109 790	
JPY	14 416	Sanoh Industrial Co., Ltd.	94 067	113 240	
JPY	3 819	Sanrio Co., Ltd.	171 292	215 622	
JPY	39 813	Sega Sammy Holdings Inc.	832 227	1 119 734	
JPY	66 791	Sekisui Chemical Co., Ltd.	1 363 818	1 267 000	
JPY	5 085	Shimano Inc.	1 288 953	1 115 441	
JPY	19 984	Stanley Electric Co., Ltd.	612 642	530 761	
JPY	98 094	Subaru Corp.	2 294 440	2 427 490	
JPY	131 837	Sumitomo Electric Industries Ltd.	2 256 751	2 120 694	
JPY	85 109	Sumitomo Forestry Co., Ltd.	2 137 495	2 713 925	
JPY	21 724	Sumitomo Riko Co. Ltd.	136 377	169 652	
JPY	51 310	Sumitomo Rubber Industries Ltd.	693 147	654 838	
JPY	23 868	SUNCALL CORP.	134 825	114 940	
JPY	48 342	Suzuki Motor Corp.	2 401 658	2 301 868	
JPY	5 444	T. RAD Co., Ltd.	119 271	91 907	
JPY	18 915	TACHI-S CO., LTD.	214 414	267 722	
JPY	7 537	Tamron Co., Ltd.	246 785	277 047	
JPY	26 406	TOKAI RIKA CO., LTD.	468 527	514 208	
JPY	17 877	Tomy Co., Ltd.	233 914	296 239	
JPY	11 742	Topre Corp.	138 908	170 496	
JPY	41 774	Toyo Tire & Rubber Co., Ltd.	740 096	728 376	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
JPY	18 502	Toyoda Gosei Co., Ltd.	458 944	461 079	
JPY	36 722	Toyota Boshoku Corp.	794 897	862 516	
JPY	1 514 531	Toyota Motor Corp.	29 369 676	32 009 356	
JPY	31 707	TS TECH CO., LTD.	539 710	526 576	
JPY	16 693	UNIPRES CORP.	141 661	176 669	
JPY	17 183	Wacoal Corp.	429 144	454 717	
JPY	74 657	Yamaha Motor Co., Ltd.	2 514 373	2 817 393	
JPY	25 619	Yokohama Rubber Co., Ltd. (The)	618 768	738 825	
JPY	7 563	YONEX CO., LTD.	100 570	95 899	
			109 479 623	118 010 327	17,0
SERVICES FINANCIERS					
JPY	185 003	Dai-ichi Life Holdings Inc.	4 525 165	4 637 470	
JPY	17 856	J Trust Co., Ltd.	85 815	70 295	
JPY	8 276	Japan Investment Adviser Co., Ltd.	93 016	84 027	
JPY	2 920 836	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	22 689 809	28 479 060	
JPY	628 008	Mizuho Financial Group Inc.	11 548 518	12 643 266	
JPY	145 090	MS&AD Insurance Group Holdings Inc.	6 058 110	6 769 176	
JPY	691 858	Nomura Holdings Inc.	3 285 800	3 466 027	
JPY	119 157	SBI Holdings Inc.	3 282 153	3 020 181	
JPY	99 704	Sompo Holdings Inc.	5 459 594	5 895 854	
JPY	358 857	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	17 485 245	20 234 874	
JPY	552 592	Tokio Marine Holdings Inc.	13 986 922	16 770 924	
			88 500 147	102 071 154	14,8
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
JPY	8 119	A&D Co., Ltd.	83 480	132 533	
JPY	18 719	Advantest Corp.	2 057 917	3 281 862	
JPY	31 922	Alps Alpine Co., Ltd.	387 424	367 362	
JPY	15 632	Amano Corp.	436 339	433 350	
JPY	19 779	Anritsu Corp.	338 045	222 096	
JPY	12 744	Azbil Corp.	494 288	528 651	
JPY	35 796	Brother Industries Ltd.	836 021	688 049	
JPY	226 525	Canon Inc.	6 908 732	7 860 030	
JPY	92 144	Citizen Watch Co., Ltd.	583 835	730 557	
JPY	14 574	Cybernet Systems Co., Ltd.	128 197	111 946	
JPY	17 032	DAISHINKU CORP.	121 646	101 356	
JPY	7 738	Daitron Co., Ltd.	188 916	214 655	
JPY	11 596	Dexerials Corp.	311 912	332 824	
JPY	21 762	Disco Corp.	3 168 722	4 504 725	
JPY	42 975	Fujifilm Holdings Corp.	3 320 808	3 360 419	
JPY	14 452	Fujitsu Ltd.	2 660 091	2 460 328	
JPY	1 692	FURUYA METAL CO., LTD.	147 475	184 493	
JPY	10 900	Hakuto Co., Ltd.	370 561	552 847	
JPY	14 029	Hamamatsu Photonics K.K.	963 804	902 410	
JPY	7 708	Hirose Electric Co., Ltd.	1 393 366	1 346 093	
JPY	8 503	Horiba Ltd.	587 120	640 757	
JPY	7 393	Ibiden Co., Ltd.	418 417	548 245	
JPY	6 803	I-PEX Inc.	85 411	83 521	
JPY	3 597	IRISO ELECTRONICS CO., LTD.	152 115	137 159	
JPY	16 347	Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	370 187	448 981	
JPY	10 019	KAGA ELECTRONICS CO., LTD.	418 899	584 296	
JPY	4 963	Keyence Corp.	2 979 744	3 082 925	
JPY	10 830	Koa Corp.	200 595	178 174	
JPY	51 500	Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	210 553	236 218	
JPY	15 243	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc.	510 951	828 945	
JPY	13 268	MARUBUN Corp.	129 116	159 006	
JPY	877	Maruwa Co., Ltd.	155 902	178 407	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
JPY	14 335	Maxell Holdings Ltd.	190 286	209 853	
JPY	3 697	Meiko Electronics Co., Ltd.	95 614	91 217	
JPY	12 080	MICRONICS JAPAN CO., LTD.	167 237	221 190	
JPY	2 533	Mitsui High-tec Inc.	195 395	226 568	
JPY	69 074	Murata Manufacturing Co., Ltd.	5 911 761	5 208 346	
JPY	29 625	NEC Corp.	1 760 246	1 889 071	
JPY	8 476	Nippon Ceramic Co., Ltd.	214 033	211 925	
JPY	38 507	Nippon Electric Glass Co., Ltd.	990 941	892 103	
JPY	8 263	Nissha Printing Co., Ltd.	140 899	126 940	
JPY	65 890	NTT Data Corp.	1 299 350	1 210 698	
JPY	9 221	OPTEX GROUP Co., Ltd.	176 208	170 529	
JPY	87 199	Ricoh Co., Ltd.	917 956	975 954	
JPY	4 777	Riken Keiki Co., Ltd.	213 511	251 036	
JPY	8 308	Riso Kagaku Corp.	185 349	184 297	
JPY	10 634	Rohm Co., Ltd.	1 175 526	1 316 262	
JPY	6 204	Roland DG Corp.	193 665	205 896	
JPY	1 142	RORZE CORP.	97 212	121 386	
JPY	1 221	Sanken Electric Co., Ltd.	78 841	150 128	
JPY	12 796	Sanshin Electronics Co., Ltd.	258 455	251 053	
JPY	14 868	SATORI ELECTRIC CO., LTD.	206 509	230 179	
JPY	9 555	SCREEN Holdings Co., Ltd.	953 397	1 420 645	
JPY	61 013	Seiko Epson Corp.	1 288 540	1 250 678	
JPY	2 849	SHIBAURA ELECTRONICS CO., LTD.	146 686	172 671	
JPY	1 123	Shibaura Mechatronics Corp.	119 558	228 554	
JPY	19 764	Shimadzu Corp.	869 772	801 219	
JPY	3 681	Shindengen Electric Manufacturing Co., Ltd.	122 337	109 695	
JPY	11 624	Shinko Electric Industries Co., Ltd.	476 103	622 772	
JPY	11 185	SIIX Corp.	142 632	160 258	
JPY	58 268	SUMCO Corp.	1 189 312	1 081 850	
JPY	8 014	Sumida Corp.	108 295	107 047	
JPY	15 105	Taiyo Yuden Co., Ltd.	737 079	565 190	
JPY	14 089	TAMURA CORP.	101 046	86 035	
JPY	42 015	TDK Corp.	2 087 584	2 141 384	
JPY	93 147	Tokyo Electron Ltd.	15 287 732	17 533 187	
JPY	16 500	TOKYO SEIMITSU CO., LTD.	816 249	1 197 915	
JPY	4 476	Tomen Devices Corp.	224 048	206 533	
JPY	4 563	TOSHIBA TEC CORP.	171 165	172 114	
JPY	5 080	Towa Corp.	95 854	119 108	
JPY	27 135	Trend Micro Inc.	1 760 438	1 725 325	
JPY	6 006	ULVAC Inc.	337 579	334 976	
JPY	20 477	Yokogawa Electric Corp.	480 790	496 893	
JPY	5 404	YOKOWO CO., LTD.	104 340	91 528	
			73 210 119	80 193 428	11,6
MATÉRIAUX					
JPY	22 358	ADEKA Corp.	521 972	559 936	
JPY	15 418	Aica Kogyo Co., Ltd.	545 238	445 627	
JPY	22 135	Asahi Holdings Inc.	476 259	393 345	
JPY	252 993	Asahi Kasei Corp.	2 881 641	2 251 353	
JPY	6 718	ASAHI YUKIZAI Corp.	180 691	268 468	
JPY	5 230	C. Uyemura & Co., Ltd.	345 683	392 631	
JPY	71 140	Daicel Corp.	725 627	837 575	
JPY	13 395	Daido Steel Co., Ltd.	638 396	732 985	
JPY	10 938	Dainichiseika Color & Chemicals Mfg. Co., Ltd.	189 159	209 593	
JPY	22 329	Denka Co., Ltd.	789 490	554 508	
JPY	21 935	DIC Corp.	611 084	524 340	
JPY	5 315	DKS Co., Ltd.	95 437	85 934	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		MATÉRIAUX (suite)			
JPY	11 480	DOWA HOLDINGS CO., LTD.	528 616	477 793	
JPY	22 920	Fujimi Inc.	502 237	741 776	
JPY	5 909	FUJIMORI KOGYO CO., LTD.	182 256	193 401	
JPY	5 298	FUSO CHEMICAL CO., LTD.	181 223	218 270	
JPY	17 470	Harima Chemicals Group Inc.	141 200	140 589	
JPY	17 027	Ishihara Sangyo Kaisha Ltd.	182 458	203 899	
JPY	5 859	JCU Corp.	178 385	182 378	
JPY	12 757	Kaneka Corp.	528 916	469 625	
JPY	21 341	Kansai Paint Co., Ltd.	504 647	413 134	
JPY	14 175	Kanto Denka Kogyo Co., Ltd.	132 641	127 439	
JPY	157 991	Kobe Steel Ltd.	1 217 772	1 910 028	
JPY	24 370	KUMIAI CHEMICAL INDUSTRY Co., Ltd.	221 376	249 886	
JPY	112 741	Kuraray Co., Ltd.	1 360 217	1 443 488	
JPY	30 685	Lintec Corp.	731 263	637 987	
JPY	26 305	Maruichi Steel Tube Ltd.	767 232	793 529	
JPY	3 549	MEC Co., Ltd.	92 137	114 534	
JPY	337 571	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	2 712 230	2 667 752	
JPY	47 016	Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	1 072 425	899 839	
JPY	23 287	Mitsubishi Materials Corp.	556 684	550 796	
JPY	45 311	Mitsui Chemicals Inc.	1 586 953	1 754 326	
JPY	18 842	Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	615 493	570 811	
JPY	32 185	Neturen Co., Ltd.	229 465	286 410	
JPY	20 635	Nihon Nohyaku Co., Ltd.	152 724	134 887	
JPY	47 662	Nihon Parkerizing Co., Ltd.	494 283	466 465	
JPY	60 396	Nippon Kayaku Co., Ltd.	726 265	679 009	
JPY	25 584	Nippon Light Metal Holdings Co., Ltd.	361 771	339 161	
JPY	34 521	Nippon Sanso Holdings Corp.	842 096	983 540	
JPY	12 327	Nippon Shokubai Co., Ltd.	681 586	606 039	
JPY	12 814	Nippon Soda Co., Ltd.	544 895	606 519	
JPY	372 272	Nippon Steel Corp.	8 907 405	10 238 331	
JPY	23 094	Nissan Chemical Corp.	1 465 613	1 304 316	
JPY	7 015	Nittetsu Mining Co., Ltd.	229 853	287 402	
JPY	32 337	Nitto Denko Corp.	2 916 188	3 147 037	
JPY	12 095	NOF Corp.	731 849	682 444	
JPY	149 509	Oji Holdings Corp.	939 308	735 860	
JPY	14 933	Shikoku Chemicals Corp.	196 107	205 756	
JPY	329 951	Shin-Etsu Chemicals Co., Ltd.	13 097 645	14 403 053	
JPY	28 196	Showa Denko K.K.	727 889	600 435	
JPY	4 628	STELLA CHEMIFA Corp.	120 313	132 407	
JPY	9 242	Sumitomo Bakelite Co., Ltd.	468 681	504 883	
JPY	426 507	Sumitomo Chemical Co., Ltd.	2 220 306	1 704 430	
JPY	93 743	Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	4 473 259	3 974 500	
JPY	23 186	Taiheiyo Cement Corp.	591 715	602 749	
JPY	17 398	Taiyo Ink Manufacturing Co.	457 488	424 329	
JPY	12 649	TAYCA CORP.	152 710	159 115	
JPY	43 518	Teijin Ltd.	714 163	574 318	
JPY	6 381	Toho Titanium Co., Ltd.	147 738	101 884	
JPY	39 096	Tokai Carbon Co., Ltd.	530 119	471 755	
JPY	9 563	TOKYO OHKA KOGYO CO., Ltd.	669 230	767 913	
JPY	35 967	Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	457 443	447 170	
JPY	191 594	Toray Industries Inc.	1 467 438	1 403 970	
JPY	135 601	Tosoh Corp.	2 359 691	2 109 236	
JPY	20 770	TOYO INK MFG. CO., LTD.	435 126	413 585	
JPY	68 109	Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	1 147 501	1 320 062	
JPY	12 655	UACJ Corp.	288 674	315 022	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
MATÉRIAUX (suite)					
JPY	31 432	UBE Corp.	713 419	710 928	
JPY	33 432	Zeon Corp.	495 620	425 295	
			73 152 614	74 287 790	10,7
SOINS DE SANTÉ					
JPY	246 693	Astellas Pharma Inc.	5 022 886	4 853 579	
JPY	281 256	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	10 752 292	10 521 291	
JPY	58 970	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	2 620 275	2 456 470	
JPY	15 494	EIKEN CHEMICAL Co., Ltd.	250 651	218 309	
JPY	27 957	Eisai Co., Ltd.	2 381 212	2 488 882	
JPY	11 811	Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	418 068	407 659	
JPY	13 913	Hoya Corp.	2 094 790	2 174 955	
JPY	4 026	JEOL Ltd.	185 558	187 759	
JPY	36 476	Kyowa Kirin Co., Ltd.	1 195 435	889 632	
JPY	13 211	M3 Inc.	622 636	376 032	
JPY	4 108	Menicon Co., Ltd.	105 109	94 344	
JPY	12 371	NAKANISHI Inc.	335 746	360 164	
JPY	6 027	Nippon Shinyaku Co., Ltd.	480 809	324 119	
JPY	27 495	Nipro Corp.	320 587	256 631	
JPY	29 878	Olympus Corp.	747 485	619 841	
JPY	69 318	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	2 057 202	1 653 824	
JPY	59 651	Otsuka Holdings Co., Ltd.	2 881 179	2 878 589	
JPY	35 861	PHC Holdings Corp.	522 504	505 934	
JPY	68 068	Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	711 646	763 704	
JPY	25 726	SEIKAGAKU CORP.	213 012	177 352	
JPY	27 804	Shionogi & Co.	1 830 498	1 545 129	
JPY	6 744	Shofu Inc.	149 177	142 688	
JPY	55 978	Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	707 358	327 482	
JPY	8 353	Taisho Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	438 853	414 181	
JPY	374 875	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	15 722 754	15 536 953	
JPY	30 289	Terumo Corp.	1 309 214	1 265 054	
JPY	10 619	Zeria Pharmaceutical Co., Ltd.	230 883	237 507	
			54 307 819	51 678 064	7,5
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
JPY	37 956	Ajinomoto Co., Inc.	1 554 315	1 989 065	
JPY	64 725	Asahi Group Holdings Ltd.	3 282 203	3 302 995	
JPY	12 235	Calbee Inc.	342 956	305 463	
JPY	611 099	Japan Tobacco Inc.	16 373 895	17 640 237	
JPY	6 125	Kameda Seika Co., Ltd.	266 906	242 528	
JPY	60 658	Kao Corp.	3 895 923	2 895 529	
JPY	8 436	Kikkoman Corp.	660 236	632 696	
JPY	134 984	Kirin Holdings Co., Ltd.	2 992 689	2 597 052	
JPY	2 906	KOSE Corp.	420 457	366 884	
JPY	23 073	Lion Corp.	320 526	283 588	
JPY	11 149	Mandom Corp.	163 425	147 595	
JPY	11 658	Nisshin Oilio Group Ltd. (The)	381 153	365 022	
JPY	37 221	Nisshin Seifun Group Inc.	663 074	606 394	
JPY	10 123	NISSIN FOODS HOLDINGS CO., LTD.	1 063 269	1 103 799	
JPY	26 732	Pigeon Corp.	666 636	485 681	
JPY	16 005	Riken Vitamin Co., Ltd.	305 527	313 133	
JPY	17 367	ROHTO Pharmaceutical Co., Ltd.	404 946	515 315	
JPY	80 618	Seven & I Holdings Co., Ltd.	4 459 647	4 579 760	
JPY	21 745	Shiseido Co., Ltd.	1 481 589	1 292 628	
JPY	23 505	Suntory Beverage & Food Ltd.	1 106 926	1 121 588	
JPY	41 461	Takara Holdings Inc.	471 411	443 545	
JPY	8 885	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	486 038	528 981	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
JPY	25 019	Uni-Charm Corp.	1 288 687	1 223 380	
JPY	11 887	Yakult Honsha Co., Ltd.	952 112	990 880	
			44 004 546	43 973 738	6,4
SERVICES DE COMMUNICATION					
JPY	19 276	Capcom Co., Ltd.	819 001	1 005 031	
JPY	41 788	Dentsu Group Inc.	1 837 829	1 803 092	
JPY	6 943	GungHo Online Entertainment	154 880	179 570	
JPY	51 219	Hakuhodo DY Holdings Inc.	668 743	709 009	
JPY	43 769	KOEI TECMO HOLDINGS CO., LTD.	1 090 177	995 977	
JPY	17 350	Konami Holdings Corp.	1 162 315	1 194 659	
JPY	10 175	Macromill Inc.	97 428	78 343	
JPY	17 869	Nexon Co., Ltd.	471 689	449 395	
JPY	215 402	Nintendo Co., Ltd.	12 883 169	12 901 171	
JPY	18 666	SQUARE ENIX HOLDINGS CO., LTD.	1 203 318	1 142 922	
JPY	1 021	TOEI CO., LTD.	179 826	171 339	
			20 568 375	20 630 508	3,0
ÉNERGIE					
JPY	1 102 609	ENEOS Holdings Inc.	5 447 007	4 990 785	
JPY	83 565	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	2 568 966	2 207 952	
JPY	270 751	Inpex Corp.	3 387 720	3 961 099	
			11 403 693	11 159 836	1,6
IMMOBILIER					
JPY	11 893	Relo Holdings Inc.	237 679	212 866	0,0
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			632 404 622	687 905 158	99,5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(379 149)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			632 025 473	687 905 158	99,5
Contrat(s) de change à terme				200 109	0,0
Total du portefeuille de placements			632 025 473	688 105 267	99,5
Autres actifs (passifs) nets				3 233 125	0,5
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				691 338 392	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie *	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	5 212 723	JPY	551 432 352	0,01	162 724
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	3 677 867	JPY	398 133 746	0,01	31 771
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 juillet 2023	CAD	283 592	JPY	30 353 699	0,01	5 614
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								200 109

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	200	-	-	200
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	200	-	-	200
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(41)	-	-	(41)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(41)	-	-	(41)

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	171	37
Paiements indirects [†]	60	16

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	100 000	100 000	16 150 000	15 100 000
Parts rachetables émises	150 000	-	9 020 000	500 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	(550 000)	(2 395 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	250 000	100 000	24 620 000	13 205 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,480
Parts non couvertes	0,480

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	49 649	37 665
Garanties (hors trésorerie)	52 170	42 489

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	310	182
Charges	(93)	(73)
Revenu tiré des prêts de titres	217	109
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	40,0

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Produits industriels	25,2
Biens de consommation discrétionnaire	16,4
Services Financiers	16,1
Matériaux	10,9
Technologies de l'information	10,8
Soins de santé	8,3
Biens de consommation de base	7,0
Services de communication	3,2
Énergie	1,8
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Immobilier	0,0
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions japonaises et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Japon.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Japan Hedged Equity	26 510 042

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree Japan Hedged Equity	28 155 721

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Yen japonais	690 164	(8 974)	681 190	98,5
Total	690 164	(8 974)	681 190	98,5

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Yen japonais	403 522	(2 947)	400 575	99,3
Total	403 522	(2 947)	400 575	99,3

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 68 119 000 \$ (40 058 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	687 905	-	-	687 905
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	200	-	200
Total	687 905	200	-	688 105

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions achetées à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	402 419	-	-	402 419
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(41)	-	(41)
Total	402 419	(41)	-	402 378

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	21 830	21 603
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	28	37
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	84	92
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	2	2
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	29	56
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	21 973	21 790
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	7
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	6	7
Comptes créditeurs et charges à payer	16	13
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	23	27
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	21 950	21 763

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Parts couvertes	15 360	15 162	28,39	28,02	541 082	541 082
Parts non couvertes	6 590	6 601	32,95	33,01	200 000	200 000

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

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	425	532
Intérêts aux fins des distributions	1	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	171	1 152
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(176)	(4 754)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	421	(3 070)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	2
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	1
Rabais sur frais	13	28
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	13	31
Total des revenus	434	(3 039)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	39	63
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	9
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	56	65
Taxe de vente harmonisée	2	4
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	102	142
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	332	(3 181)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts couvertes	403	(1 951)	0,75	(3,61)	541 082	541 082
Parts non couvertes	(71)	(1 230)	(0,32)	(2,01)	218 232	612 983

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

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	15 162	16 656	6 601	25 025	21 763	41 681
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	403	(1 951)	(71)	(1 230)	332	(3 181)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(103)	(324)	(21)	(506)	(124)	(830)
Profits nets réalisés	(102)	-	(72)	-	(174)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(205)	(324)	(93)	(506)	(298)	(830)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	1 744	-	1 744	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	246	-	379	-	625
Rachat de parts rachetables	-	-	(1 591)	(17 669)	(1 591)	(17 669)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	246	153	(17 290)	153	(17 044)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	198	(2 029)	(11)	(19 026)	187	(21 055)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	15 360	14 627	6 590	5 999	21 950	20 626

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

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	332	(3 181)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(171)	(1 152)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	9
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	176	4 754
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 051	1 172
Achat de placements et de dérivés	(1 120)	(1 184)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	26	32
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(6)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	301	443
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(298)	(205)
Produit de l'émission de parts rachetables	9	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(21)	(191)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(310)	(396)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9)	47
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	37	109
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	28	157
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	395	499
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		SERVICES FINANCIERS			
USD	95	Affiliated Managers Group Inc.	19 857	18 864	
USD	3 650	Ally Financial Inc.	181 824	130 602	
USD	419	American Financial Group Inc.	60 333	65 915	
USD	428	Ameris Bancorp	29 067	19 397	
USD	1 476	Ares Management Corp., catégorie A	115 401	188 396	
USD	1 579	Associated Banc-Corp.	48 751	33 950	
USD	322	Assurant Inc.	55 382	53 628	
USD	1 452	Bank OZK	67 961	77 249	
USD	5 228	Blue Owl Capital Inc.	88 084	80 685	
USD	402	BOK Financial Corp.	42 948	43 019	
USD	1 644	Cadence Bank	60 997	42 774	
USD	3 869	Carlyle Group Inc. (The)	158 285	163 758	
USD	645	CBOE Global Markets, Inc.	96 574	117 925	
USD	2 635	CNA Financial Corp.	144 138	134 811	
USD	1 369	Comerica Inc.	142 899	76 823	
USD	755	Commerce Bancshares Inc.	59 768	48 709	
USD	625	Cullen/Frost Bankers Inc.	91 862	89 031	
USD	1 685	CVB Financial Corp.	60 458	29 644	
USD	1 357	East West Bancorp Inc.	108 681	94 900	
USD	1 584	Enact Holdings Inc.	52 485	52 733	
USD	2 476	Equitable Holdings Inc.	100 491	89 087	
USD	203	Erie Indemnity Co., catégorie A	51 870	56 477	
USD	296	Evercore Inc., catégorie A	45 690	48 463	
USD	5 125	F.N.B. Corp. of Pennsylvania	91 581	77 670	
USD	3 275	Fidelity National Financial Inc.	176 368	156 188	
USD	1 107	First American Financial Corp.	81 698	83 620	
USD	35	First Citizens BancShares Inc.	33 467	59 509	
USD	1 144	First Financial Bankshares Inc.	58 049	43 177	
USD	1 278	First Interstate BancSystem Inc.	69 207	40 362	
USD	232	FirstCash Holdings Inc.	28 813	28 684	
USD	5 309	Franklin Resources Inc.	191 906	187 854	
USD	742	Glacier Bancorp Inc.	45 697	30 639	
USD	298	Globe Life Inc.	37 565	43 275	
USD	771	Hancock Whitney Corp.	49 520	39 201	
USD	313	Hanover Insurance Group Inc.	51 095	46 868	
USD	1 597	Home Bancshares Inc.	46 673	48 236	
USD	454	Houlihan Lokey Inc.	47 328	59 127	
USD	326	Independent Bank Corp. (Massachusetts)	38 724	19 222	
USD	270	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	23 902	29 713	
USD	304	Jack Henry & Associates Inc.	65 657	67 388	
USD	1 989	Jefferies Financial Group Inc.	74 781	87 401	
USD	457	Kemper Corp.	34 313	29 217	
USD	62	Kinsale Capital Group Inc.	21 891	30 735	
USD	621	Loews Corp.	46 840	48 850	
USD	111	MarketAxess Holdings Inc.	52 952	38 441	
USD	3 781	MGIC Investment Corp.	65 362	79 090	
USD	110	Morningstar Inc.	30 306	28 572	
USD	8 097	New York Community Bancorp Inc.	111 726	120 566	
USD	2 509	Old National Bancorp	61 034	46 334	
USD	4 466	Old Republic International Corp.	131 699	148 914	
USD	1 987	OneMain Holdings Inc.	124 626	115 004	
USD	295	Pinnacle Financial Partners Inc.	28 424	22 139	
USD	944	Popular Inc.	78 043	75 684	
USD	252	Primerica Inc.	46 484	66 020	
USD	751	Prosperity Bancshares Inc.	66 889	56 191	
USD	594	Reinsurance Group of America Inc.	93 847	109 135	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SERVICES FINANCIERS (suite)					
USD	182	RLI Corp.	23 939	32 904	
USD	522	SEI Investments Co.	40 586	41 228	
USD	350	Selective Insurance Group Inc.	34 264	44 488	
USD	337	ServisFirst Bancshares Inc.	34 071	18 268	
USD	1 960	SLM Corp.	37 517	42 375	
USD	516	SouthState Corp.	52 707	44 979	
USD	600	Stifel Financial Corp.	44 357	47 429	
USD	1 380	Synovus Financial Corp.	67 723	55 302	
USD	4 386	TFS Financial Corp.	100 033	73 036	
USD	273	Tradeweb Markets Inc., catégorie A	25 260	24 766	
USD	403	UMB Financial Corp.	41 738	32 513	
USD	1 277	United Bankshares Inc.	57 858	50 193	
USD	802	United Community Banks Inc.	38 135	26 551	
USD	2 407	Unum Group	91 921	152 100	
USD	5 127	Valley National Bancorp	76 393	52 638	
USD	395	Voya Financial Inc.	30 862	37 524	
USD	1 459	Webster Financial Corp.	90 969	72 964	
USD	705	Western Alliance Bancorp	65 234	34 061	
USD	308	Wintrust Financial Corp.	29 597	29 631	
USD	1 339	Zions Bancorporation NA	101 513	47 645	
			5 174 950	4 880 461	22,3
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	715	A. O. Smith Corp.	57 218	68 937	
USD	163	AAON Inc.	14 810	20 473	
USD	85	Acuity Brands Inc.	19 792	18 363	
USD	227	Advanced Drainage Systems Inc.	27 356	34 216	
USD	498	AECOM	57 044	55 872	
USD	192	AGCO Corp.	27 812	33 427	
USD	722	Air Lease Corp.	37 470	40 028	
USD	780	Allison Transmission Holdings Inc.	45 764	58 340	
USD	198	Applied Industrial Technologies Inc.	34 731	37 989	
USD	563	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	62 842	83 235	
USD	574	BWX Technologies Inc.	43 204	54 422	
USD	1 139	C.H. Robinson Worldwide Inc.	151 197	142 364	
USD	242	Carlisle Cos. Inc.	64 660	82 241	
USD	117	Comfort Systems USA Inc.	19 555	25 450	
USD	172	Concentrix Corp.	35 312	18 399	
USD	311	Crane Holdings Co.	36 630	23 253	
USD	97	Curtiss-Wright Corp.	17 504	23 600	
USD	785	Donaldson Co., Inc.	58 914	65 006	
USD	1 978	Dun & Bradstreet Holdings Inc.	34 710	30 318	
USD	127	EMCOR Group Inc.	21 123	31 088	
USD	230	Exponent Inc.	27 579	28 434	
USD	1 007	Flowserve Corp.	41 561	49 559	
USD	663	Fortune Brands Home & Security Inc.	50 619	63 194	
USD	240	Franklin Electric Co., Inc.	24 502	32 716	
USD	217	GATX Corp.	32 438	37 009	
USD	828	Graco Inc.	83 146	94 717	
USD	177	Herc Holdings Inc.	34 850	32 089	
USD	242	Hexcel Corp.	19 786	24 371	
USD	1 025	Howmet Aerospace Inc.	53 835	67 296	
USD	375	Hubbell Inc.	86 683	164 713	
USD	227	Huntington Ingalls Industries Inc.	58 792	68 443	
USD	294	Insperty Inc.	35 586	46 332	
USD	456	ITT Inc.	48 872	56 307	
USD	420	KBR Inc.	19 543	36 199	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	452	Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	27 947	33 269	
USD	129	Landstar System Inc.	24 803	32 904	
USD	486	Leidos Holdings Inc.	56 567	56 966	
USD	163	Lennox International Inc.	59 270	70 410	
USD	404	Lincoln Electric Holdings Inc.	64 364	106 307	
USD	635	ManpowerGroup Inc.	78 885	66 793	
USD	1 346	Masco Corp.	113 451	102 315	
USD	314	Maximus Inc.	31 528	35 154	
USD	1 620	MDU Resources Group Inc.	59 752	44 939	
USD	171	MSA Safety Inc.	31 017	39 408	
USD	707	MSC Industrial Direct Co., Inc., catégorie A	80 491	89 239	
USD	407	Mueller Industries Inc.	36 604	47 059	
USD	250	Nordson Corp.	82 893	82 194	
USD	337	Oshkosh Corp.	42 487	38 657	
USD	424	Owens Corning	46 011	73 301	
USD	236	Regal Rexnord Corp.	38 722	48 115	
USD	674	Robert Half International Inc.	65 565	67 163	
USD	584	Ryder System Inc.	53 934	65 598	
USD	313	Science Applications International Corp.	36 232	46 639	
USD	185	Simpson Manufacturing Co., Inc.	23 658	33 943	
USD	538	Snap-On Inc.	142 018	205 398	
USD	1 041	SS&C Technologies Holdings Inc.	74 537	83 571	
USD	157	Tetra Tech Inc.	24 956	34 056	
USD	542	Textron Inc.	52 855	48 559	
USD	543	Timken Co. (The)	50 009	65 841	
USD	465	Toro Co. (The)	57 478	62 617	
USD	351	UFP Industries Inc.	32 404	45 127	
USD	71	Valmont Industries Inc.	19 974	27 375	
USD	924	Vertiv Holdings Co.	18 117	30 320	
USD	431	Watsco Inc.	140 295	217 808	
USD	120	Watts Water Technologies Inc., catégorie A	22 599	29 208	
USD	182	Woodward Governor Co.	23 771	28 670	
USD	760	Zurn Elkay Water Solutions Corp.	27 662	27 073	
			3 226 296	3 834 396	17,5
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	317	Academy Sports + Outdoors Inc.	23 796	22 698	
USD	3 716	ADT Inc.	38 872	29 684	
USD	613	Advance Auto Parts Inc.	141 198	57 089	
USD	814	Aramark	36 716	46 423	
USD	1 140	Bath & Body Works Inc.	65 337	56 633	
USD	1 061	BorgWarner Inc.	60 475	68 746	
USD	492	Boyd Gaming Corp.	39 748	45 214	
USD	438	Brunswick Corp.	45 791	50 272	
USD	208	Choice Hotels International Inc.	36 846	32 382	
USD	191	Churchill Downs Inc.	24 104	35 214	
USD	272	Columbia Sportswear Co.	34 042	27 832	
USD	298	Dick's Sporting Goods Inc.	33 314	52 185	
USD	34	Dillard's Inc., catégorie A	12 596	14 696	
USD	163	Domino's Pizza Inc.	79 493	72 768	
USD	1 074	Foot Locker Inc.	62 252	38 572	
USD	3 869	The Gap Inc.	77 965	45 770	
USD	1 193	Gentex Corp.	45 905	46 243	
USD	1 675	H&R Block Inc.	51 274	70 718	
USD	609	Harley-Davidson Inc.	30 818	28 407	
USD	1 554	Hasbro Inc.	172 631	133 340	
USD	2 011	Kohl's Corp.	93 680	61 407	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
USD	369	Lear Corp.	78 407	70 172	
USD	1 776	Leggett & Platt Inc.	99 039	69 689	
USD	82	Lithia Motors Inc., catégorie A	26 876	33 035	
USD	1 415	LKQ Corp.	103 022	109 228	
USD	2 078	Macy's Inc.	67 362	44 183	
USD	204	Marriott Vacations Worldwide Corp.	40 537	33 165	
USD	64	Murphy USA Inc.	15 196	26 377	
USD	365	Penske Automotive Group Inc.	36 752	80 571	
USD	378	Polaris Inc.	55 822	60 556	
USD	137	Pool Corp.	62 348	67 994	
USD	894	PulteGroup Inc.	61 649	91 998	
USD	158	PVH Corp.	16 853	17 785	
USD	323	Ralph Lauren Corp.	48 701	52 759	
USD	664	Service Corp. International	44 802	56 816	
USD	2 023	Tapestry Inc.	110 371	114 703	
USD	727	Tempur Sealy International Inc.	41 706	38 591	
USD	522	Texas Roadhouse Inc., catégorie A	61 519	77 644	
USD	483	Thor Industries Inc.	58 410	66 225	
USD	601	Toll Brothers Inc.	39 209	62 954	
USD	318	Vail Resorts Inc.	118 628	106 059	
USD	1 382	Wendy's Co. (The)	38 116	39 820	
USD	493	Williams-Sonoma Inc.	78 020	81 729	
USD	83	Wingstop Inc.	16 900	22 008	
USD	653	Wyndham Hotels & Resorts Inc.	62 465	59 317	
			2 589 563	2 519 671	11,5
IMMOBILIER					
USD	224	Agree Realty Corp.	19 510	19 404	
USD	909	American Homes 4 Rent, catégorie A	40 167	42 689	
USD	697	Americold Realty Trust Inc.	30 930	29 824	
USD	1 164	Apartment Income REIT Corp.	67 769	55 651	
USD	1 454	Apple Hospitality REIT Inc.	33 280	29 105	
USD	2 525	Brixmor Property Group Inc.	66 772	73 590	
USD	352	Camden Property Trust	55 524	50 767	
USD	407	Cousins Properties Inc.	18 233	12 293	
USD	1 968	CubeSmart	107 533	116 433	
USD	154	EastGroup Properties Inc.	29 647	35 416	
USD	485	Equity Lifestyle Properties Inc.	41 699	42 977	
USD	378	Essex Property Trust Inc.	111 193	117 327	
USD	661	Federal Realty Investment Trust	104 265	84 739	
USD	339	First Industrial Realty Trust Inc.	20 317	23 640	
USD	2 255	Gaming and Leisure Properties Inc.	125 490	144 765	
USD	3 803	Healthpeak Properties Inc.	130 593	101 264	
USD	1 942	Host Hotels & Resorts Inc.	46 650	43 298	
USD	596	Independence Realty Trust	14 533	14 386	
USD	319	Kilroy Realty Corp.	26 241	12 716	
USD	3 658	Kimco Realty Corp.	94 545	95 562	
USD	573	Kite Realty Group Trust	15 299	16 958	
USD	995	Lamar Advertising Co., catégorie A	128 958	130 824	
USD	729	Life Storage Inc.	98 175	128 405	
USD	1 875	National Retail Properties Inc.	110 582	106 286	
USD	237	National Storage Affiliates Trust	18 858	10 935	
USD	3 791	Omega Healthcare Investors Inc.	142 174	154 129	
USD	300	Phillips Edison & Co., Inc.	13 321	13 544	
USD	211	PotlatchDeltic Corp.	13 509	14 773	
USD	380	Rayonier Inc.	16 401	15 807	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
IMMOBILIER (suite)					
USD	795	Regency Centers Corp.	72 284	65 055	
USD	505	Rexford Industrial Realty Inc.	35 905	34 935	
USD	147	Ryman Hospitality Properties Inc.	17 953	18 095	
USD	1 915	Spirit Realty Capital Inc.	108 430	99 903	
USD	462	STAG Industrial Inc.	20 711	21 960	
USD	197	Terreno Realty Corp. REIT	15 484	15 685	
USD	1 574	UDR Inc.	86 071	89 578	
			2 099 006	2 082 718	9,5
SERVICES PUBLICS					
USD	637	Allele Inc.	56 240	48 919	
USD	1 987	Alliant Energy Corp.	150 943	138 142	
USD	211	American States Water Co.	27 588	24 318	
USD	645	Black Hills Corp.	54 177	51 490	
USD	1 879	Clearway Energy Inc., catégorie C	73 297	71 092	
USD	1 624	Essential Utilities Inc.	93 184	85 862	
USD	2 405	Eergy Inc.	206 101	186 127	
USD	1 057	Hawaiian Electric Industries Inc.	53 827	50 689	
USD	413	IDACORP Inc.	52 271	56 135	
USD	1 087	National Fuel Gas Co.	72 668	73 959	
USD	1 234	New Jersey Resources Corp.	84 273	77 160	
USD	3 530	NiSource Inc.	115 074	127 899	
USD	2 034	NRG Energy Inc.	94 989	100 749	
USD	3 151	OGE Energy Corp.	139 645	149 899	
USD	742	ONE Gas Inc.	78 488	75 501	
USD	153	Ormat Technologies Inc.	15 901	16 308	
USD	1 277	Pinnacle West Capital Corp.	134 750	137 806	
USD	717	PNM Resources Inc.	47 809	42 838	
USD	1 479	Portland General Electric Co.	91 616	91 754	
USD	666	Southwest Gas Corp.	63 209	56 157	
USD	653	Spire Inc.	60 588	54 880	
USD	2 025	UGI Corp.	109 256	72 350	
USD	4 942	Vistra Corp.	159 520	171 857	
			2 035 414	1 961 891	8,9
MATÉRIAUX					
USD	519	Alcoa Corp.	33 784	23 328	
USD	283	AptarGroup Inc.	45 629	43 436	
USD	212	Ashland Global Holdings Inc.	23 030	24 408	
USD	95	Balchem Corp.	15 670	16 966	
USD	594	Berry Global Group Inc.	48 822	50 629	
USD	362	Cabot Corp.	35 532	32 078	
USD	725	Celanese Corp.	134 478	111 219	
USD	1 381	Chemours Co. (The)	54 543	67 490	
USD	679	Commercial Metals Co.	44 762	47 368	
USD	149	Eagle Materials Inc.	30 158	36 797	
USD	1 082	Eastman Chemical Co.	155 773	120 003	
USD	1 300	Element Solutions Inc.	33 787	33 066	
USD	2 241	Graphic Packaging Holding Co.	56 973	71 339	
USD	272	H.B. Fuller Co.	28 258	25 767	
USD	2 293	Huntsman Corp.	79 544	82 077	
USD	4 450	International Paper Co.	219 748	187 524	
USD	345	Louisiana Pacific Corp.	21 225	34 269	
USD	829	Olin Corp.	41 998	56 437	
USD	1 262	Packaging Corp. of America	220 966	220 951	
USD	382	Reliance Steel & Aluminum Co.	71 375	137 439	
USD	377	Royal Gold Inc.	54 589	57 325	
USD	564	RPM International Inc.	69 857	67 043	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
MATÉRIAUX (suite)					
USD	641	Sealed Air Corp.	41 563	33 967	
USD	591	Silgan Holdings Inc.	32 879	36 711	
USD	1 226	Sonoco Products Co.	96 960	95 857	
USD	687	United States Steel Corp.	20 866	22 762	
USD	836	Valvoline Inc.	30 086	41 542	
USD	464	Westlake Corp.	51 716	73 436	
USD	1 992	WestRock Co.	107 517	76 713	
			1 902 088	1 927 947	8,8
ÉNERGIE					
USD	7 788	Antero Midstream Corp.	93 599	119 679	
USD	1 812	APA Corp.	60 805	82 023	
USD	711	ChampionX Corp.	26 744	29 236	
USD	2 293	Chesapeake Energy Corp.	245 696	254 191	
USD	718	Chord Energy Corp.	129 238	146 290	
USD	1 453	Civitas Resources Inc.	108 217	133 528	
USD	3 248	Comstock Resources Inc.	60 901	49 912	
USD	1 767	CVR Energy Inc.	70 679	70 131	
USD	1 118	DT Midstream Inc.	68 632	73 417	
USD	1 586	EQT Corp.	76 541	86 416	
USD	7 148	Equitrans Midstream Corp.	83 850	90 527	
USD	671	Helmerich & Payne Inc.	40 643	31 512	
USD	1 579	HF Sinclair Corp.	71 881	93 314	
USD	1 376	Magnolia Oil & Gas Corp., catégorie A	41 668	38 098	
USD	383	Matador Resources Co.	21 929	26 546	
USD	1 399	Murphy Oil Corp.	62 090	70 982	
USD	1 200	NOV Inc.	22 846	25 499	
USD	1 273	Ovintiv Inc.	57 194	64 201	
USD	1 425	Patterson-UTI Energy Inc.	29 648	22 597	
USD	1 203	PBF Energy Inc.	55 519	65 245	
USD	542	PDC Energy Inc.	38 198	51 080	
USD	993	Range Resources Corp.	34 346	38 675	
USD	619	SM Energy Co.	28 958	25 937	
			1 529 822	1 689 036	7,7
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	887	Amkor Technology Inc.	25 058	34 958	
USD	1 003	Avnet Inc.	59 028	67 034	
USD	703	Bentley Systems Inc., catégorie B	39 379	50 504	
USD	440	Cognex Corp.	34 437	32 655	
USD	393	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	42 646	43 566	
USD	3 552	Gen Digital Inc.	106 115	87 287	
USD	351	Jabil Inc.	23 116	50 186	
USD	2 190	Juniper Networks Inc.	76 517	90 895	
USD	117	Littelfuse Inc.	35 326	45 152	
USD	240	MKS Instruments Inc.	33 415	34 369	
USD	1 019	National Instruments Corp.	56 462	77 485	
USD	1 696	NetApp Inc.	148 857	171 654	
USD	217	Power Integration Inc.	22 356	27 215	
USD	1 075	Skyworks Solutions Inc.	141 269	157 634	
USD	344	TD SYNNEX Corp.	46 616	42 837	
USD	395	Teradyne Inc.	50 317	58 256	
USD	169	Universal Display Corp.	32 219	32 268	
			973 133	1 103 955	5,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SOINS DE SANTÉ					
USD	375	Bruker Corp.	32 104	36 722	
USD	38	Chemed Corp.	24 519	27 268	
USD	123	Cooper Cos. Inc. (The)	52 547	62 478	
USD	1 051	Dentsply Sirona Inc.	58 574	55 720	
USD	364	Encompass Health Corp.	32 136	32 651	
USD	147	Ensign Group Inc. (The)	17 335	18 590	
USD	3 979	Organon & Co.	146 558	109 693	
USD	1 261	Premier Inc., catégorie A	56 462	46 206	
USD	118	Teleflex Inc.	43 678	37 834	
USD	169	Universal Health Services Inc., catégorie B	28 264	35 322	
USD	13 236	Viatis Inc.	195 282	174 993	
			687 459	637 477	2,9
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	3 222	Albertsons Cos. Inc., catégorie A	77 646	93 135	
USD	117	Casey's General Stores Inc.	30 447	37 800	
USD	22	Coca-Cola Consolidated Inc.	15 904	18 537	
USD	2 413	Flowers Foods Inc.	74 145	79 532	
USD	511	Ingredion Inc.	61 752	71 723	
USD	457	Lamb Weston Holdings Inc.	54 503	69 592	
USD	142	Lancaster Colony Corp.	31 983	37 828	
USD	1 445	Molson Coors Beverage Co.	103 619	126 035	
USD	1 666	Reynolds Consumer Products Inc.	63 493	62 349	
USD	3	Seaboard Corp.	15 497	14 151	
			528 989	610 682	2,8
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	31	Cable One Inc.	42 862	26 984	
USD	3 434	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	124 364	175 508	
USD	593	New York Times Co., (The), catégorie A	29 909	30 936	
USD	1 815	News Corp., catégorie A	45 923	46 886	
USD	304	Nexstar Media Group Inc.	50 942	67 074	
USD	7 907	Paramount Global, catégorie B	208 748	166 654	
USD	1 827	TEGNA Inc.	39 903	39 306	
USD	815	Warner Music Group Corp., catégorie A	39 998	28 169	
			582 649	581 517	2,6
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			21 329 369	21 829 751	99,5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(13 394)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			21 315 975	21 829 751	99,5
Contrat(s) de change à terme				83 093	0,4
Total du portefeuille de placements			21 315 975	21 912 844	99,9
Autres actifs (passifs) nets				37 282	0,1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				21 950 126	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	14 878 711	USD	11 171 527	1,33	80 927
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	363 095	USD	274 598	1,32	(637)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	USD	349 942	CAD	460 730	0,76	2 803
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								83 093

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	84	(1)	-	83
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	84	(1)	-	83
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	1	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	92	(7)	-	85
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	92	(7)	-	85
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(7)	7	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(7)	7	-	-

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

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	2	-
Paiements indirects [†]	1	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	541 082	541 082	200 000	750 000
Parts rachetables émises	-	-	50 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	(50 000)	(550 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	541 082	541 082	200 000	200 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,350
Parts non couvertes	0,350

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	1 119
Garanties (hors trésorerie)	-	1 180

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	1
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	1
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	29,8	38,0

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Services Financiers	23,0
Produits industriels	13,8
Biens de consommation discrétionnaire	11,0
Immobilier	10,7
Services publics	10,0
Matériaux	8,5
Énergie	8,0
Technologies de l'information	5,8
Soins de santé	3,1
Services de communication	2,7
Biens de consommation de base	2,6
Contrat(s) de change à terme	0,4
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermit ou affaibli de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend	2 167 902

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend	2 120 152

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	21 877	(14 698)	7 179	32,7
Total	21 877	(14 698)	7 179	32,7

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	21 680	(14 597)	7 083	32,5
Total	21 680	(14 597)	7 083	32,5

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 718 000 \$ (708 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	21 830	-	-	21 830
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	83	-	83
Total	21 830	83	-	21 913

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	21 603	-	-	21 603
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	85	-	85
Total	21 603	85	-	21 688

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	207 558	194 597
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	177	301
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	343	359
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	25	26
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	248	252
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	208 351	195 535
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	22
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	59	59
Comptes créditeurs et charges à payer	59	52
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	121	133
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	208 230	195 402

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts couvertes	61 506	59 532	38,78	35,31	1 585 990
Parts non couvertes	146 724	135 870	41,75	38,66	3 514 723	3 514 723

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 352	2 936
Intérêts aux fins des distributions	8	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	2 917	12 340
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	13 641	(46 404)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	18 918	(31 128)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(7)	3
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	5	5
Rabais sur frais	149	306
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	147	314
Total des revenus	19 065	(30 814)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	345	468
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	52
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	4
Retenues d'impôts	320	386
Taxe de vente harmonisée	20	22
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	696	933
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 369	(31 747)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts couvertes	6 207	(8 682)	3,71	(5,26)	1 674 112	1 649 735
Parts non couvertes	12 162	(23 065)	3,52	(4,11)	3 458 646	5 610 391

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	59 532	60 747	135 870	330 280	195 402	391 027
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 207	(8 682)	12 162	(23 065)	18 369	(31 747)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(185)	(475)	(651)	(2 275)	(836)	(2 750)
Profits nets réalisés	(296)	(2 052)	(372)	(2 319)	(668)	(4 371)
Remboursement de capital	(40)	-	(227)	-	(267)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(521)	(2 527)	(1 250)	(4 594)	(1 771)	(7 121)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 757	21 819	39 259	21 819	41 016
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	2 312	-	3 443	-	5 755
Acquisition des actifs de fonds clôturés	-	11 929	-	7 599	-	19 528
Rachat de parts rachetables	(3 712)	(7 037)	(21 877)	(239 039)	(25 589)	(246 076)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 712)	8 961	(58)	(188 738)	(3 770)	(179 777)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 974	(2 248)	10 854	(216 397)	12 828	(218 645)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	61 506	58 499	146 724	113 883	208 230	172 382

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 369	(31 747)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 917)	(12 340)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(6)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	10	52
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(13 641)	46 404
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 327	6 825
Achat de placements et de dérivés	(4 455)	(5 464)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	4	217
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(63)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	8	(14)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	1 705	3 864
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 772)	(1 367)
Produit de l'émission de parts rachetables	389	788
Montant versé au rachat de parts rachetables	(446)	(3 716)
Acquisition des actifs de fonds dissous	-	434
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(1 829)	(3 861)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	6
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(124)	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	301	683
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	177	692
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 036	2 767
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	8	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(4)
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	3 147	Amphenol Corp., catégorie A	289 928	354 156	
USD	49 899	Apple Inc.	9 185 739	12 822 134	
USD	4 203	Applied Materials Inc.	627 693	804 788	
USD	752	Bentley Systems Inc., catégorie B	41 027	54 025	
USD	6 259	Broadcom Inc.	4 747 690	7 192 390	
USD	855	CDW Corp. of Delaware	181 735	207 843	
USD	63 280	Cisco Systems Inc.	4 016 876	4 337 374	
USD	556	Cognex Corp.	46 018	41 262	
USD	4 591	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	424 253	397 028	
USD	429	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	47 873	47 557	
USD	6 901	Gen Digital Inc.	205 893	169 586	
USD	18 079	HP Inc.	813 009	735 509	
USD	1 109	Intuit Inc.	608 010	673 149	
USD	401	Jabil Inc.	39 749	57 335	
USD	4 188	Juniper Networks Inc.	184 414	173 821	
USD	950	KLA Corp.	397 028	610 404	
USD	1 041	Lam Research Corp.	729 157	886 546	
USD	4 628	Micron Technology Inc.	426 687	386 924	
USD	40 514	Microsoft Corp.	13 623 836	18 277 095	
USD	190	Monolithic Power Systems Inc.	96 340	135 977	
USD	1 097	Motorola Solutions Inc.	363 027	426 209	
USD	3 364	NetApp Inc.	322 586	340 473	
USD	6 474	NVIDIA Corp.	1 603 311	3 628 002	
USD	21 722	Oracle Corp.	2 129 558	3 426 960	
USD	13 631	QUALCOMM Inc.	2 362 128	2 149 585	
USD	333	Roper Technologies Inc.	196 274	212 101	
USD	2 120	Skyworks Solutions Inc.	361 835	310 870	
USD	585	TD SYNNEX Corp.	78 235	72 848	
USD	443	Teradyne Inc.	62 004	65 336	
USD	12 684	Texas Instruments Inc.	2 886 797	3 024 899	
USD	240	Universal Display Corp.	46 663	45 825	
			47 145 373	62 068 011	29,8
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	41 113	Altria Group Inc.	2 527 165	2 467 239	
USD	2 661	Brown-Forman Corp., catégorie B	246 376	235 410	
USD	4 165	Campbell Soup Co.	260 622	252 209	
USD	1 594	Church & Dwight Co., Inc.	183 190	211 651	
USD	59 948	Coca-Cola Co. (The)	4 410 919	4 782 438	
USD	27	Coca-Cola Consolidated Inc.	19 720	22 749	
USD	10 181	Colgate-Palmolive Co.	1 056 395	1 039 060	
USD	1 161	Constellation Brands Inc., catégorie A	338 689	378 556	
USD	1 631	Costco Wholesale Corp.	924 479	1 163 260	
USD	1 010	Dollar General Corp.	289 326	227 165	
USD	1 319	Estée Lauder Cos. Inc. (The), catégorie A	452 321	343 144	
USD	7 439	General Mills Inc.	868 278	755 864	
USD	1 306	Hershey Co. (The)	320 569	432 012	
USD	937	Ingredion Inc.	108 799	131 515	
USD	5 709	Kimberly-Clark Corp.	1 001 860	1 044 147	
USD	804	Lamb Weston Holdings Inc.	96 355	122 433	
USD	230	Lancaster Colony Corp.	62 929	61 271	
USD	2 488	McCormick & Co., Inc.	288 224	287 508	
USD	17 302	PepsiCo Inc.	3 504 784	4 245 395	
USD	34 703	Philip Morris International Inc.	4 248 194	4 487 865	
USD	29 044	Procter & Gamble Co. (The)	5 374 170	5 838 353	
USD	5 834	Sysco Corp.	578 433	573 461	
USD	6 417	Target Corp.	1 537 483	1 121 271	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
USD	4 291	Tyson Foods Inc., catégorie A	368 634	290 137	
USD	20 066	Walmart Inc.	3 979 952	4 178 227	
			33 047 866	34 692 340	16,7
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	12 979	3M Co.	2 688 620	1 720 940	
USD	1 274	A. O. Smith Corp.	103 262	122 833	
USD	201	AAON Inc.	18 167	25 246	
USD	279	Advanced Drainage Systems Inc.	33 270	42 054	
USD	887	Allison Transmission Holdings Inc.	51 903	66 344	
USD	720	AMETEK Inc.	118 439	154 404	
USD	208	Applied Industrial Technologies Inc.	36 314	39 908	
USD	3 922	Automatic Data Processing Inc.	1 027 712	1 141 956	
USD	1 059	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	120 715	156 565	
USD	1 177	Broadridge Financial Solutions Inc.	231 114	258 255	
USD	656	BWX Technologies Inc.	47 627	62 197	
USD	304	Carlisle Cos. Inc.	77 712	103 311	
USD	5 738	Carrier Global Corp.	336 903	377 866	
USD	5 371	Caterpillar Inc.	1 437 016	1 750 703	
USD	509	Cintas Corp.	252 590	335 180	
USD	124	Comfort Systems USA Inc.	20 703	26 973	
USD	519	Crane Holdings Co.	66 123	38 805	
USD	13 409	CSX Corp.	540 141	605 738	
USD	1 805	Cummins Inc.	529 300	586 220	
USD	117	Curtiss-Wright Corp.	19 759	28 467	
USD	1 563	Deere & Co.	702 981	838 980	
USD	950	Donaldson Co., Inc.	70 932	78 670	
USD	1 007	Dover Corp.	178 435	196 969	
USD	147	EMCOR Group Inc.	30 000	35 984	
USD	6 466	Emerson Electric Co.	740 996	774 266	
USD	495	Equifax Inc.	132 265	154 298	
USD	238	Exponent Inc.	28 496	29 423	
USD	6 978	Fastenal Co.	464 363	545 310	
USD	3 388	FedEx Corp.	969 175	1 112 638	
USD	1 673	FlowsERVE Corp.	68 917	82 336	
USD	2 758	General Dynamics Corp.	706 601	786 085	
USD	2 868	General Electric Co.	262 619	417 362	
USD	1 030	Graco Inc.	93 663	117 824	
USD	308	HEICO Corp.	62 881	72 196	
USD	265	Herc Holdings Inc.	50 459	48 042	
USD	315	Hexcel Corp.	25 613	31 723	
USD	6 421	Honeywell International Inc.	1 692 997	1 765 041	
USD	1 122	Howmet Aerospace Inc.	58 876	73 664	
USD	490	Hubbell Inc.	120 574	215 225	
USD	421	Huntington Ingalls Industries Inc.	110 198	126 937	
USD	384	Idex Corp.	102 400	109 504	
USD	3 590	Illinois Tool Works Inc.	994 227	1 189 724	
USD	336	Insperty Inc.	40 717	52 951	
USD	529	ITT Inc.	62 231	65 321	
USD	483	Jacobs Solutions Inc.	79 595	76 072	
USD	625	KBR Inc.	43 781	53 868	
USD	138	Landstar System Inc.	27 134	35 199	
USD	898	Leidos Holdings Inc.	114 066	105 258	
USD	291	Lennox International Inc.	110 551	125 701	
USD	505	Lincoln Electric Holdings Inc.	85 381	132 883	
USD	3 204	Lockheed Martin Corp.	1 618 130	1 954 082	
USD	470	Maximus Inc.	46 964	52 619	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	2 957	MDU Resources Group Inc.	122 455	82 028	
USD	261	MSA Safety Inc.	49 062	60 148	
USD	876	MSC Industrial Direct Co., Inc., catégorie A	99 752	110 571	
USD	313	Nordson Corp.	88 079	102 907	
USD	2 322	Norfolk Southern Corp.	734 038	697 530	
USD	303	Old Dominion Freight Line Inc.	110 565	148 417	
USD	553	Oshkosh Corp.	70 797	63 435	
USD	1 169	Parker-Hannifin Corp.	438 973	604 029	
USD	4 623	Paychex Inc.	643 902	685 128	
USD	369	Quanta Services Inc.	66 583	96 031	
USD	2 250	Republic Services Inc.	333 999	456 552	
USD	1 236	Robert Half International Inc.	133 524	123 165	
USD	1 032	Rockwell Automation Inc.	350 298	450 405	
USD	3 234	Rollins Inc.	148 305	183 494	
USD	719	Snap-On Inc.	194 161	274 500	
USD	180	Tetra Tech Inc.	30 818	39 045	
USD	555	Textron Inc.	53 337	49 724	
USD	633	Timken Co. (The)	53 994	76 754	
USD	571	Toro Co. (The)	72 581	76 891	
USD	7 571	Union Pacific Corp.	2 111 449	2 052 274	
USD	12 257	United Parcel Service Inc., catégorie B	2 959 776	2 910 565	
USD	80	Valmont Industries Inc.	23 458	30 845	
USD	533	Verisk Analytics Inc.	129 559	159 598	
USD	1 017	Vertiv Holdings Co.	20 044	33 372	
USD	298	W.W. Grainger Inc.	180 203	311 316	
USD	3 184	Waste Management Inc.	579 462	731 486	
USD	248	Woodward Governor Co.	34 271	39 066	
USD	966	Xylem Inc.	127 798	144 121	
			27 614 851	29 893 517	14,4
SOINS DE SANTÉ					
USD	881	Agilent Technologies Inc.	150 746	140 344	
USD	1 167	AmerisourceBergen Corp.	262 930	297 494	
USD	7 262	Amgen Inc.	2 255 740	2 135 907	
USD	407	Bruker Corp.	35 333	39 856	
USD	3 272	Cardinal Health Inc.	242 351	409 921	
USD	42	Chemed Corp.	27 098	30 138	
USD	2 094	Cigna Corp.	656 650	778 392	
USD	126	Cooper Cos. Inc. (The)	54 229	64 002	
USD	1 172	Elevance Health Inc.	614 060	689 808	
USD	5 043	Eli Lilly and Co.	1 660 365	3 133 121	
USD	526	Encompass Health Corp.	43 327	47 182	
USD	170	Ensign Group Inc. (The)	19 418	21 498	
USD	1 345	HCA Healthcare Inc.	426 514	540 737	
USD	367	Humana Inc.	215 676	217 387	
USD	33 053	Johnson & Johnson	6 995 230	7 247 617	
USD	406	McKesson Corp.	205 564	229 828	
USD	33 649	Merck & Co., Inc.	3 715 555	5 143 683	
USD	589	ResMed Inc.	168 536	170 491	
USD	2 212	Stryker Corp.	714 076	894 020	
USD	150	Teleflex Inc.	61 733	48 094	
USD	1 019	Thermo Fisher Scientific Inc.	776 970	704 321	
USD	5 765	UnitedHealth Group Inc.	3 187 673	3 670 736	
USD	224	Universal Health Services Inc., catégorie B	39 255	46 817	
USD	193	West Pharmaceutical Services Inc.	71 596	97 789	
USD	1 952	Zoetis Inc.	426 924	445 320	
			23 027 549	27 244 503	13,1

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SERVICES FINANCIERS					
USD	4 981	American Express Co.	1 049 957	1 149 473	
USD	7 731	American International Group Inc.	648 297	589 304	
USD	829	Ameriprise Financial Inc.	269 209	364 784	
USD	1 093	Arthur J. Gallagher & Co.	287 028	317 927	
USD	573	Assurant Inc.	108 918	95 432	
USD	13 580	Bank of New York Mellon Corp. (The)	828 375	800 919	
USD	1 107	Brown & Brown Inc.	87 337	100 954	
USD	9 835	The Charles Schwab Corp.	981 753	738 479	
USD	2 012	Cincinnati Financial Corp.	290 961	259 396	
USD	5 222	CNA Financial Corp.	293 341	267 167	
USD	378	Erie Indemnity Co., catégorie A	103 569	105 164	
USD	499	Evercore Inc., catégorie A	75 879	81 699	
USD	149	FactSet Research Systems Inc.	69 565	79 083	
USD	2 054	First American Financial Corp.	147 445	155 154	
USD	39	First Citizens BancShares Inc.	41 229	66 310	
USD	2 287	First Interstate BancSystem Inc.	121 948	72 228	
USD	335	FirstCash Holdings Inc.	41 832	41 419	
USD	351	Globe Life Inc.	44 423	50 972	
USD	4 558	Goldman Sachs Group Inc. (The)	2 211 017	1 947 564	
USD	377	Hanover Insurance Group Inc.	65 226	56 451	
USD	3 621	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	291 447	345 474	
USD	544	Houlihan Lokey Inc.	69 105	70 848	
USD	331	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	34 214	36 426	
USD	380	Jack Henry & Associates Inc.	82 510	84 235	
USD	3 807	Jefferies Financial Group Inc.	175 802	167 287	
USD	69	Kinsale Capital Group Inc.	23 947	34 205	
USD	230	LPL Financial Holdings Inc.	45 120	66 249	
USD	2 570	M&T Bank Corp.	520 128	421 354	
USD	187	MarketAxess Holdings Inc.	97 964	64 761	
USD	3 409	Marsh & McLennan Cos., Inc.	628 586	849 383	
USD	2 628	Mastercard Inc., catégorie A	1 188 437	1 369 252	
USD	882	Moody's Corp.	399 118	406 286	
USD	29 172	Morgan Stanley	3 548 656	3 300 335	
USD	140	Morningstar Inc.	42 398	36 364	
USD	398	MSCI Inc.	281 528	247 433	
USD	2 896	Nasdaq Inc.	245 757	191 248	
USD	290	Primerica Inc.	53 539	75 975	
USD	1 522	Progressive Corp. (The)	212 708	266 894	
USD	1 583	S&P Global Inc.	753 959	840 698	
USD	876	SEI Investments Co.	66 714	69 188	
USD	393	Selective Insurance Group Inc.	48 668	49 954	
USD	3 297	SLM Corp.	73 496	71 281	
USD	1 040	Stifel Financial Corp.	84 748	82 210	
USD	4 338	T. Rowe Price Group Inc.	810 971	643 753	
USD	2 330	Travelers Cos., Inc. (The)	586 352	536 031	
USD	32 480	U.S. Bancorp	1 876 337	1 421 641	
USD	6 887	Visa Inc., catégorie A	1 917 605	2 166 661	
USD	789	W.R. Berkley Corp.	77 727	62 254	
USD	52 391	Wells Fargo & Co.	3 016 819	2 962 204	
USD	1 265	Western Alliance Bancorp	113 582	61 117	
			25 135 251	24 340 880	11,7
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	326	Academy Sports + Outdoors Inc.	24 468	23 342	
USD	1 197	Advance Auto Parts Inc.	273 833	111 477	
USD	1 383	Aramark	76 865	78 873	
USD	4 694	Best Buy Co., Inc.	596 246	509 596	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
USD	1 902	BorgWarner Inc.	104 197	123 237	
USD	731	Brunswick Corp.	83 564	83 902	
USD	218	Churchill Downs Inc.	29 744	40 192	
USD	419	Columbia Sportswear Co.	50 353	42 874	
USD	2 031	D.R. Horton Inc.	220 860	327 415	
USD	2 064	Darden Restaurants Inc.	387 176	456 844	
USD	508	Dick's Sporting Goods Inc.	83 772	88 960	
USD	205	Domino's Pizza Inc.	118 975	91 518	
USD	5 434	eBay Inc.	375 577	321 710	
USD	2 018	Gentex Corp.	80 380	78 222	
USD	1 368	Genuine Parts Co.	335 655	306 688	
USD	3 011	Hasbro Inc.	306 362	258 356	
USD	729	Hilton Worldwide Holdings Inc.	136 780	140 564	
USD	12 109	Home Depot Inc. (The)	5 611 099	4 983 100	
USD	677	Lear Corp.	138 294	128 744	
USD	2 726	LKQ Corp.	198 900	210 429	
USD	6 160	Lowe's Cos., Inc.	1 559 273	1 841 816	
USD	1 564	Marriott International Inc., catégorie A	344 942	380 589	
USD	8 198	McDonald's Corp.	2 779 846	3 240 822	
USD	7 817	Nike Inc., catégorie B	1 289 857	1 142 944	
USD	672	Polaris Inc.	108 199	107 656	
USD	245	Pool Corp.	117 768	121 595	
USD	555	Ralph Lauren Corp.	81 697	90 655	
USD	1 833	Ross Stores Inc.	251 130	272 282	
USD	11 749	Starbucks Corp.	1 601 538	1 541 818	
USD	3 891	Tapestry Inc.	202 831	220 617	
USD	640	Texas Roadhouse Inc., catégorie A	72 994	95 195	
USD	8 579	The TJX Cos. Inc.	793 886	963 641	
USD	921	Tractor Supply Co.	240 797	269 763	
USD	617	Vail Resorts Inc.	224 081	205 781	
USD	2 310	Wendy's Co. (The)	65 769	66 559	
USD	916	Williams-Sonoma Inc.	157 042	151 854	
USD	2 454	Yum! Brands Inc.	408 495	450 417	
			19 533 245	19 570 047	9,4
MATÉRIAUX					
USD	2 284	Air Products and Chemicals Inc.	825 324	906 297	
USD	468	AptarGroup Inc.	74 879	71 831	
USD	636	Avery Dennison Corp.	147 058	144 749	
USD	1 023	Berry Global Group Inc.	83 489	87 195	
USD	1 400	Celanese Corp.	197 061	214 768	
USD	2 454	Chemours Co. (The)	102 480	119 927	
USD	3 352	Corteva Inc.	285 600	254 444	
USD	4 656	DuPont de Nemours Inc.	445 630	440 644	
USD	171	Eagle Materials Inc.	33 800	42 230	
USD	1 931	Ecolab Inc.	460 034	477 570	
USD	1 023	FMC Corp.	151 425	141 404	
USD	2 736	Graphic Packaging Holding Co.	67 445	87 097	
USD	296	H.B. Fuller Co.	30 667	28 041	
USD	516	Louisiana Pacific Corp.	45 066	51 254	
USD	238	Martin Marietta Materials Inc.	102 601	145 566	
USD	2 166	PPG Industries Inc.	403 252	425 533	
USD	449	Royal Gold Inc.	68 994	68 273	
USD	1 054	RPM International Inc.	120 084	125 289	
USD	1 091	Sealed Air Corp.	86 365	57 812	
USD	1 227	Sherwin-Williams Co. (The)	401 033	431 594	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
MATÉRIAUX (suite)					
USD	597	Vulcan Materials Co.	148 099	178 295	
			4 280 386	4 499 813	2,2
IMMOBILIER					
USD	2 562	Extra Space Storage Inc.	544 928	505 198	
USD	2 111	Lamar Advertising Co., catégorie A	273 754	277 557	
USD	2 427	Public Storage	1 070 322	938 443	
USD	523	SBA Communications Corp.	226 132	160 574	
USD	7 915	Ventas Inc.	490 513	495 645	
			2 605 649	2 377 417	1,1
ÉNERGIE					
USD	1 077	ChampionX Corp.	39 932	44 287	
USD	3 945	Comstock Resources Inc.	73 253	60 623	
USD	2 967	EQT Corp.	143 027	161 663	
USD	5 920	Halliburton Co.	228 066	258 725	
USD	1 758	Murphy Oil Corp.	73 548	89 197	
USD	1 934	NOV Inc.	50 539	41 096	
USD	2 413	Ovintiv Inc.	150 887	121 695	
USD	2 145	Patterson-UTI Energy Inc.	43 820	34 014	
USD	2 201	Targa Resources Corp.	207 365	221 890	
USD	24	Texas Pacific Land Corp.	40 695	41 857	
			1 051 132	1 075 047	0,5
SERVICES PUBLICS					
USD	7 441	AES Corp. (The)	229 421	204 345	
USD	308	American States Water Co.	40 312	35 498	
USD	4 457	CMS Energy Corp.	377 269	346 884	
USD	1 382	National Fuel Gas Co.	117 222	94 030	
USD	219	Ormat Technologies Inc.	22 350	23 343	
USD	1 200	Southwest Gas Corp.	113 549	101 184	
USD	3 908	UGI Corp.	201 307	139 627	
			1 101 430	944 911	0,4
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	2 417	Activision Blizzard Inc.	243 498	269 922	
USD	830	Electronic Arts Inc.	142 610	142 611	
USD	896	New York Times Co., (The), catégorie A	46 826	46 743	
USD	3 128	News Corp., catégorie A	77 011	80 804	
USD	378	Nexstar Media Group Inc.	71 686	83 401	
USD	30 462	Sirius XM Holdings Inc.	239 009	182 806	
USD	2 114	TEGNA Inc.	53 247	45 480	
			873 887	851 767	0,4
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			185 416 619	207 558 253	99,7
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(39 201)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			185 377 418	207 558 253	99,7
Contrat(s) de change à terme				339 973	0,2
Total du portefeuille de placements			185 377 418	207 898 226	99,9
Autres actifs (passifs) nets				331 952	0,1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				208 230 178	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	60 154 853	USD	45 166 653	1,33	327 192
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	1 615 380	USD	1 222 089	1,32	(3 396)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	USD	1 444 764	CAD	1 905 342	0,76	8 389
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	USD	972 333	CAD	1 280 162	0,76	7 788
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								339 973

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	343	(3)	-	340
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	343	(3)	-	340
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(3)	3	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	359	(22)	-	337
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	359	(22)	-	337
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(22)	22	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(22)	22	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	2	2
Paiements indirects [†]	1	1

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 685 990	1 568 008	3 514 723	8 413 865
Parts rachetables émises	-	50 000	550 000	1 050 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Émission de parts rachetables liée à l'acquisition des actifs de fonds clôturés	-	317 982	-	200 858
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(200 000)	(550 000)	(6 400 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 585 990	1 735 990	3 514 723	3 264 723

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,350
Parts non couvertes	0,350

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	2 967
Garanties (hors trésorerie)	-	3 144

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	9	10
Charges	(4)	(5)
Revenu tiré des prêts de titres	5	5
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	43,9	52,0

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Technologies de l'information	26,3
Biens de consommation de base	17,6
Soins de santé	14,5
Produits industriels	14,0
Services Financiers	11,3
Biens de consommation discrétionnaire	10,7
Matériaux	2,2
Immobilier	1,2
Services publics	0,7
Énergie	0,6
Services de communication	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,2
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth	20 362 741

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth	19 334 417

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	207 903	(58 245)	149 658	71,9
Total	207 903	(58 245)	149 658	71,9

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	194 914	(57 831)	137 083	70,2
Total	194 914	(57 831)	137 083	70,2

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 14 966 000 \$ (13 708 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)			
Actions	207 558	-	-	207 558
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	340	-	340
Total	207 558	340	-	207 898

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	194 597	-	-	194 597
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	337	-	337
Total	194 597	337	-	194 934

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	44 976	43 166
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	70	7
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	90	49
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	53	60
Intérêts à recevoir	-	-
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	45 189	43 282
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	9
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	16	17
Comptes créditeurs et charges à payer	7	6
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	24	32
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	45 165	43 250

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Parts à couverture variable	45 165	43 250	39,27	36,04	1 150 000	1 200 000

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	507	597
Intérêts aux fins des distributions	1	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	637	880
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3 082	(7 439)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	4 227	(5 962)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	1
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	1
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	(1)	2
Total des revenus	4 226	(5 960)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	90	107
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	18
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	69	82
Taxe de vente harmonisée	8	11
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	1
Total des charges	169	220
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 057	(6 180)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts à couverture variable	4 057	(6 180)	3,52	(4,39)	1 150 829	1 406 354

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts à couverture variable	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	43 250	53 084
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 057	(6 180)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(66)	(129)
Profits nets réalisés	(264)	(209)
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(330)	(338)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	5 369
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 812)	(5 303)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 812)	66
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 915	(6 452)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	45 165	46 632

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 057	(6 180)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(637)	(880)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	18
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3 082)	7 439
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 012	737
Achat de placements et de dérivés	(931)	(1 261)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	7	(13)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(2)	(3)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	426	(144)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(330)	(338)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	101
Montant versé au rachat de parts rachetables	(33)	(75)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(363)	(312)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	63	(456)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	7	721
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	70	266
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	445	502
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	682	Amphenol Corp., catégorie A	58 205	76 751	
USD	10 819	Apple Inc.	1 499 089	2 780 069	
USD	911	Applied Materials Inc.	96 616	174 438	
USD	163	Bentley Systems Inc., catégorie B	8 818	11 710	
USD	1 357	Broadcom Inc.	1 011 111	1 559 367	
USD	185	CDW Corp. of Delaware	30 607	44 972	
USD	13 721	Cisco Systems Inc.	812 552	940 473	
USD	119	Cognex Corp.	8 693	8 831	
USD	995	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	89 670	86 047	
USD	91	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	9 143	10 088	
USD	1 496	Gen Digital Inc.	41 709	36 763	
USD	3 920	HP Inc.	175 807	159 478	
USD	240	Intuit Inc.	111 189	145 677	
USD	87	Jabil Inc.	8 487	12 439	
USD	908	Juniper Networks Inc.	40 072	37 686	
USD	206	KLA Corp.	60 916	132 361	
USD	225	Lam Research Corp.	112 444	191 616	
USD	1 003	Micron Technology Inc.	94 626	83 856	
USD	8 784	Microsoft Corp.	2 519 702	3 962 729	
USD	41	Monolithic Power Systems Inc.	16 614	29 342	
USD	238	Motorola Solutions Inc.	77 929	92 468	
USD	729	NetApp Inc.	63 889	73 783	
USD	1 403	NVIDIA Corp.	313 450	786 235	
USD	4 710	Oracle Corp.	391 509	743 071	
USD	2 955	QUALCOMM Inc.	455 926	465 998	
USD	72	Roper Technologies Inc.	42 415	45 860	
USD	459	Skyworks Solutions Inc.	68 105	67 306	
USD	126	TD SYNNEX Corp.	16 966	15 690	
USD	94	Teradyne Inc.	11 286	13 864	
USD	2 750	Texas Instruments Inc.	508 118	655 824	
USD	52	Universal Display Corp.	9 716	9 929	
			8 765 379	13 454 721	29,8
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	8 914	Altria Group Inc.	557 132	534 940	
USD	577	Brown-Forman Corp., catégorie B	49 324	51 045	
USD	903	Campbell Soup Co.	57 872	54 681	
USD	345	Church & Dwight Co., Inc.	34 529	45 809	
USD	12 998	Coca-Cola Co. (The)	926 419	1 036 934	
USD	6	Coca-Cola Consolidated Inc.	4 311	5 055	
USD	2 207	Colgate-Palmolive Co.	231 407	225 244	
USD	251	Constellation Brands Inc., catégorie A	66 620	81 841	
USD	353	Costco Wholesale Corp.	159 760	251 766	
USD	219	Dollar General Corp.	51 266	49 257	
USD	286	Estée Lauder Cos. Inc. (The), catégorie A	94 881	74 404	
USD	1 613	General Mills Inc.	189 023	163 894	
USD	283	Hershey Co. (The)	57 687	93 614	
USD	203	Ingredion Inc.	23 412	28 492	
USD	1 238	Kimberly-Clark Corp.	218 405	226 424	
USD	173	Lamb Weston Holdings Inc.	20 208	26 344	
USD	50	Lancaster Colony Corp.	13 702	13 320	
USD	539	McCormick & Co., Inc.	62 774	62 286	
USD	3 751	PepsiCo Inc.	693 559	920 384	
USD	7 524	Philip Morris International Inc.	905 577	973 019	
USD	6 297	Procter & Gamble Co. (The)	1 043 379	1 265 808	
USD	1 265	Sysco Corp.	122 692	124 345	
USD	1 391	Target Corp.	266 416	243 056	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
USD	930	Tyson Foods Inc., catégorie A	80 741	62 882	
USD	4 351	Walmart Inc.	862 986	905 983	
			6 794 082	7 520 827	16,7
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	2 814	3M Co.	609 785	373 120	
USD	276	A. O. Smith Corp.	19 780	26 611	
USD	45	AAON Inc.	3 909	5 652	
USD	60	Advanced Drainage Systems Inc.	7 162	9 044	
USD	190	Allison Transmission Holdings Inc.	11 031	14 211	
USD	155	AMETEK Inc.	19 920	33 240	
USD	44	Applied Industrial Technologies Inc.	7 659	8 442	
USD	850	Automatic Data Processing Inc.	188 456	247 492	
USD	229	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	22 832	33 856	
USD	255	Broadridge Financial Solutions Inc.	44 134	55 952	
USD	142	BWX Technologies Inc.	9 632	13 463	
USD	66	Carlisle Cos. Inc.	13 569	22 429	
USD	1 244	Carrier Global Corp.	73 032	81 922	
USD	1 164	Caterpillar Inc.	247 950	379 411	
USD	110	Cintas Corp.	41 287	72 436	
USD	27	Comfort Systems USA Inc.	4 445	5 873	
USD	111	Crane Holdings Co.	14 142	8 299	
USD	2 907	CSX Corp.	98 750	131 321	
USD	391	Cummins Inc.	99 155	126 987	
USD	25	Curtiss-Wright Corp.	3 921	6 083	
USD	339	Deere & Co.	109 474	181 967	
USD	205	Donaldson Co., Inc.	13 762	16 976	
USD	218	Dover Corp.	31 064	42 641	
USD	32	EMCOR Group Inc.	6 488	7 833	
USD	1 402	Emerson Electric Co.	135 749	167 881	
USD	107	Equifax Inc.	24 434	33 353	
USD	52	Exponent Inc.	5 552	6 429	
USD	1 510	Fastenal Co.	82 554	118 002	
USD	734	FedEx Corp.	190 921	241 050	
USD	363	Flowserve Corp.	14 743	17 865	
USD	598	General Dynamics Corp.	142 904	170 442	
USD	621	General Electric Co.	56 165	90 370	
USD	223	Graco Inc.	16 995	25 509	
USD	66	HEICO Corp.	13 226	15 470	
USD	57	Herc Holdings Inc.	11 222	10 334	
USD	67	Hexcel Corp.	5 348	6 747	
USD	1 392	Honeywell International Inc.	324 337	382 641	
USD	240	Howmet Aerospace Inc.	12 450	15 757	
USD	106	Hubbell Inc.	21 476	46 559	
USD	91	Huntington Ingalls Industries Inc.	24 061	27 438	
USD	83	Ilex Corp.	18 908	23 669	
USD	778	Illinois Tool Works Inc.	184 934	257 829	
USD	71	Insperty Inc.	8 110	11 189	
USD	113	ITT Inc.	13 758	13 953	
USD	103	Jacobs Solutions Inc.	17 066	16 222	
USD	135	KBR Inc.	9 374	11 635	
USD	30	Landstar System Inc.	4 856	7 652	
USD	194	Leidos Holdings Inc.	24 437	22 739	
USD	63	Lennox International Inc.	24 689	27 214	
USD	109	Lincoln Electric Holdings Inc.	14 874	28 682	
USD	695	Lockheed Martin Corp.	328 663	423 872	
USD	101	Maximus Inc.	9 148	11 307	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	641	MDU Resources Group Inc.	26 750	17 782	
USD	56	MSA Safety Inc.	8 812	12 905	
USD	188	MSC Industrial Direct Co., Inc., catégorie A	21 367	23 730	
USD	68	Nordson Corp.	16 206	22 357	
USD	503	Norfolk Southern Corp.	133 779	151 101	
USD	66	Old Dominion Freight Line Inc.	20 941	32 329	
USD	118	Oshkosh Corp.	13 007	13 536	
USD	253	Parker-Hannifin Corp.	77 588	130 726	
USD	1 002	Paychex Inc.	115 026	148 496	
USD	80	Quanta Services Inc.	14 073	20 820	
USD	487	Republic Services Inc.	65 789	98 818	
USD	268	Robert Half International Inc.	24 632	26 706	
USD	224	Rockwell Automation Inc.	65 823	97 762	
USD	701	Rollins Inc.	28 924	39 774	
USD	156	Snap-On Inc.	35 548	59 558	
USD	38	Tetra Tech Inc.	5 125	8 243	
USD	120	Textron Inc.	11 646	10 751	
USD	135	Timken Co. (The)	11 250	16 369	
USD	122	Toro Co. (The)	12 876	16 429	
USD	1 641	Union Pacific Corp.	402 780	444 826	
USD	2 658	United Parcel Service Inc., catégorie B	547 421	631 172	
USD	17	Valmont Industries Inc.	4 306	6 555	
USD	115	Verisk Analytics Inc.	25 970	34 435	
USD	220	Vertiv Holdings Co.	4 349	7 219	
USD	64	W.W. Grainger Inc.	30 979	66 860	
USD	689	Waste Management Inc.	106 580	158 290	
USD	53	Woodward Governor Co.	6 721	8 349	
USD	208	Xylem Inc.	23 018	31 032	
			5 303 579	6 474 001	14,3
SOINS DE SANTÉ					
USD	191	Agilent Technologies Inc.	26 336	30 427	
USD	253	AmerisourceBergen Corp.	57 079	64 495	
USD	1 574	Amgen Inc.	482 946	462 946	
USD	87	Bruker Corp.	6 385	8 520	
USD	709	Cardinal Health Inc.	48 250	88 825	
USD	9	Chemed Corp.	5 580	6 458	
USD	454	Cigna Corp.	136 081	168 763	
USD	27	Cooper Cos. Inc. (The)	11 404	13 715	
USD	254	Elevance Health Inc.	111 549	149 498	
USD	1 093	Eli Lilly and Co.	263 127	679 060	
USD	112	Encompass Health Corp.	9 121	10 046	
USD	37	Ensign Group Inc. (The)	4 006	4 679	
USD	291	HCA Healthcare Inc.	89 851	116 992	
USD	79	Humana Inc.	40 204	46 795	
USD	7 167	Johnson & Johnson	1 473 252	1 571 527	
USD	88	McKesson Corp.	44 623	49 815	
USD	7 296	Merck & Co., Inc.	798 043	1 115 288	
USD	127	ResMed Inc.	27 562	36 761	
USD	479	Stryker Corp.	134 294	193 596	
USD	32	Teleflex Inc.	12 138	10 260	
USD	221	Thermo Fisher Scientific Inc.	168 936	152 753	
USD	1 250	UnitedHealth Group Inc.	573 807	795 910	
USD	48	Universal Health Services Inc., catégorie B	8 366	10 032	
USD	42	West Pharmaceutical Services Inc.	12 748	21 280	
USD	422	Zoetis Inc.	80 841	96 273	
			4 626 529	5 904 714	13,1

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
SERVICES FINANCIERS					
USD	1 080	American Express Co.	226 905	249 233	
USD	1 676	American International Group Inc.	142 687	127 755	
USD	180	Ameriprise Financial Inc.	50 621	79 205	
USD	237	Arthur J. Gallagher & Co.	62 127	68 937	
USD	123	Assurant Inc.	21 688	20 485	
USD	2 944	Bank of New York Mellon Corp. (The)	179 758	173 631	
USD	240	Brown & Brown Inc.	18 837	21 887	
USD	2 132	The Charles Schwab Corp.	219 451	160 085	
USD	436	Cincinnati Financial Corp.	63 012	56 211	
USD	1 132	CNA Financial Corp.	63 970	57 915	
USD	82	Erie Indemnity Co., catégorie A	20 062	22 813	
USD	107	Evercore Inc., catégorie A	15 040	17 519	
USD	32	FactSet Research Systems Inc.	12 278	16 984	
USD	445	First American Financial Corp.	31 740	33 614	
USD	8	First Citizens BancShares Inc.	8 365	13 602	
USD	494	First Interstate BancSystem Inc.	27 278	15 602	
USD	72	FirstCash Holdings Inc.	8 951	8 902	
USD	76	Globe Life Inc.	8 797	11 037	
USD	988	Goldman Sachs Group Inc. (The)	483 394	422 157	
USD	81	Hanover Insurance Group Inc.	13 847	12 129	
USD	785	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	54 510	74 896	
USD	117	Houlihan Lokey Inc.	14 942	15 238	
USD	72	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	7 416	7 923	
USD	82	Jack Henry & Associates Inc.	16 637	18 177	
USD	825	Jefferies Financial Group Inc.	38 415	36 252	
USD	15	Kinsale Capital Group Inc.	5 188	7 436	
USD	50	LPL Financial Holdings Inc.	6 949	14 402	
USD	556	M&T Bank Corp.	114 567	91 157	
USD	40	MarketAxess Holdings Inc.	17 976	13 853	
USD	739	Marsh & McLennan Cos., Inc.	111 574	184 128	
USD	570	Mastercard Inc., catégorie A	225 750	296 984	
USD	191	Moody's Corp.	88 154	87 983	
USD	6 325	Morgan Stanley	771 533	715 570	
USD	30	Morningstar Inc.	7 411	7 792	
USD	86	MSCI Inc.	61 700	53 466	
USD	628	Nasdaq Inc.	54 085	41 472	
USD	62	Primerica Inc.	10 844	16 243	
USD	330	Progressive Corp. (The)	43 924	57 868	
USD	343	S&P Global Inc.	141 759	182 160	
USD	188	SEI Investments Co.	13 892	14 849	
USD	84	Selective Insurance Group Inc.	10 331	10 677	
USD	707	SLM Corp.	16 007	15 285	
USD	224	Stifel Financial Corp.	18 287	17 707	
USD	940	T. Rowe Price Group Inc.	154 725	139 495	
USD	504	Travelers Cos., Inc. (The)	127 575	115 948	
USD	7 042	U.S. Bancorp	413 569	308 227	
USD	1 493	Visa Inc., catégorie A	368 685	469 700	
USD	168	W.R. Berkley Corp.	16 868	13 256	
USD	11 360	Wells Fargo & Co.	658 016	642 298	
USD	272	Western Alliance Bancorp	22 192	13 141	
			5 292 289	5 273 286	11,7
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	70	Academy Sports + Outdoors Inc.	5 205	5 012	
USD	259	Advance Auto Parts Inc.	60 521	24 121	
USD	296	Aramark	16 631	16 881	
USD	1 018	Best Buy Co., Inc.	113 336	110 517	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
USD	409	BorgWarner Inc.	20 503	26 501	
USD	157	Brunswick Corp.	18 472	18 020	
USD	48	Churchill Downs Inc.	5 755	8 850	
USD	90	Columbia Sportswear Co.	11 043	9 209	
USD	440	D.R. Horton Inc.	36 081	70 932	
USD	446	Darden Restaurants Inc.	83 939	98 717	
USD	109	Dick's Sporting Goods Inc.	17 718	19 088	
USD	44	Domino's Pizza Inc.	26 708	19 643	
USD	1 178	eBay Inc.	69 473	69 741	
USD	432	Gentex Corp.	14 950	16 745	
USD	296	Genuine Parts Co.	73 539	66 359	
USD	653	Hasbro Inc.	69 561	56 030	
USD	158	Hilton Worldwide Holdings Inc.	29 622	30 465	
USD	2 625	Home Depot Inc. (The)	1 266 461	1 080 241	
USD	145	Lear Corp.	30 759	27 574	
USD	591	LKQ Corp.	42 975	45 621	
USD	1 335	Lowe's Cos., Inc.	271 800	399 160	
USD	339	Marriott International Inc., catégorie A	74 648	82 493	
USD	1 777	McDonald's Corp.	600 623	702 481	
USD	1 695	Nike Inc., catégorie B	243 395	247 830	
USD	144	Polaris Inc.	17 953	23 069	
USD	53	Pool Corp.	20 664	26 304	
USD	120	Ralph Lauren Corp.	17 539	19 601	
USD	397	Ross Stores Inc.	54 203	58 972	
USD	2 547	Starbucks Corp.	357 107	334 242	
USD	844	Tapestry Inc.	44 189	47 854	
USD	137	Texas Roadhouse Inc., catégorie A	15 156	20 378	
USD	1 860	The TJX Cos. Inc.	172 416	208 926	
USD	199	Tractor Supply Co.	42 228	58 288	
USD	134	Vail Resorts Inc.	49 831	44 692	
USD	500	Wendy's Co. (The)	13 441	14 407	
USD	197	Williams-Sonoma Inc.	24 987	32 659	
USD	531	Yum! Brands Inc.	88 524	97 462	
			4 121 956	4 239 085	9,4
MATÉRIAUX					
USD	495	Air Products and Chemicals Inc.	152 260	196 417	
USD	100	AptarGroup Inc.	14 452	15 349	
USD	137	Avery Dennison Corp.	24 729	31 180	
USD	220	Berry Global Group Inc.	18 026	18 752	
USD	304	Celanese Corp.	42 508	46 635	
USD	531	Chemours Co. (The)	21 567	25 950	
USD	726	Corteva Inc.	62 333	55 109	
USD	1 007	DuPont de Nemours Inc.	97 277	95 303	
USD	36	Eagle Materials Inc.	7 198	8 891	
USD	419	Ecolab Inc.	94 796	103 626	
USD	222	FMC Corp.	29 419	30 686	
USD	593	Graphic Packaging Holding Co.	12 360	18 877	
USD	63	H.B. Fuller Co.	6 621	5 968	
USD	110	Louisiana Pacific Corp.	9 697	10 926	
USD	51	Martin Marietta Materials Inc.	17 619	31 193	
USD	468	PPG Industries Inc.	75 515	91 944	
USD	97	Royal Gold Inc.	14 640	14 749	
USD	228	RPM International Inc.	22 830	27 102	
USD	235	Sealed Air Corp.	19 018	12 453	
USD	266	Sherwin-Williams Co. (The)	74 004	93 565	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
MATÉRIAUX (suite)					
USD	129	Vulcan Materials Co.	32 135	38 526	
			849 004	973 201	2,1
IMMOBILIER					
USD	554	Extra Space Storage Inc.	118 326	109 243	
USD	458	Lamar Advertising Co., catégorie A	59 195	60 218	
USD	526	Public Storage	233 637	203 387	
USD	113	SBA Communications Corp.	49 888	34 694	
USD	1 712	Ventas Inc.	106 096	107 207	
			567 142	514 749	1,1
ÉNERGIE					
USD	232	ChampionX Corp.	8 577	9 540	
USD	852	Comstock Resources Inc.	16 256	13 093	
USD	643	EQT Corp.	31 257	35 035	
USD	1 283	Halliburton Co.	45 723	56 072	
USD	377	Murphy Oil Corp.	14 307	19 127	
USD	417	NOV Inc.	10 967	8 861	
USD	523	Ovintiv Inc.	33 244	26 377	
USD	462	Patterson-UTI Energy Inc.	9 653	7 326	
USD	477	Targa Resources Corp.	44 709	48 088	
USD	5	Texas Pacific Land Corp.	7 834	8 720	
			222 527	232 239	0,5
SERVICES PUBLICS					
USD	1 613	AES Corp. (The)	49 061	44 296	
USD	66	American States Water Co.	8 724	7 607	
USD	964	CMS Energy Corp.	81 937	75 027	
USD	299	National Fuel Gas Co.	25 686	20 344	
USD	48	Ormat Technologies Inc.	5 013	5 116	
USD	260	Southwest Gas Corp.	25 092	21 923	
USD	847	UGI Corp.	44 218	30 263	
			239 731	204 576	0,5
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	524	Activision Blizzard Inc.	46 674	58 518	
USD	180	Electronic Arts Inc.	31 573	30 928	
USD	192	New York Times Co., (The), catégorie A	10 100	10 016	
USD	674	News Corp., catégorie A	16 612	17 411	
USD	81	Nexstar Media Group Inc.	11 888	17 872	
USD	6 605	Sirius XM Holdings Inc.	53 107	39 637	
USD	454	TEGNA Inc.	11 372	9 767	
			181 326	184 149	0,4
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			36 963 544	44 975 548	99,6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(7 289)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			36 956 255	44 975 548	99,6
Contrat(s) de change à terme				88 674	0,2
Total du portefeuille de placements			36 956 255	45 064 222	99,8
Autres actifs (passifs) nets				100 648	0,2
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				45 164 870	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	16 038 419	USD	12 042 282	1,33	87 236
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	CAD	379 901	USD	287 407	1,32	(799)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	12 juillet 2023	USD	279 268	CAD	367 681	0,76	2 237
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								88 674

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2023

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	90	(1)	-	89
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	90	(1)	-	89
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1)	1	-	-

au 31 décembre 2022

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	49	(9)	-	40
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	49	(9)	-	40
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(9)	9	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(9)	9	-	-

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

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts à couverture variable	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 200 000	1 400 000
Parts rachetables émises	-	150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	(150 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 150 000	1 400 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts à couverture variable	0,430

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	861
Garanties (hors trésorerie)	-	912

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	2	2
Charges	(1)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	1	1
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	40,1	50,1

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Technologies de l'information	26,3
Biens de consommation de base	17,6
Soins de santé	14,5
Produits industriels	14,1
Services Financiers	11,3
Biens de consommation discrétionnaire	10,8
Matériaux	2,2
Immobilier	1,2
Services publics	0,7
Énergie	0,6
Services de communication	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Contrat(s) de change à terme	0,1
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Le ou les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période ou de l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Variably (couvert en \$ CA)	4 475 185

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Variably (couvert en \$ CA)	4 317 428

Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	45 060	(15 962)	29 098	64,4
Total	45 060	(15 962)	29 098	64,4

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	43 255	(7 109)	36 146	83,6
Total	43 255	(7 109)	36 146	83,6

~ Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 909 800 \$ (3 615 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	44 976	-	-	44 976
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	89	-	89
Total	44 976	89	-	45 065

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	43 166	-	-	43,166
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	40	-	40
Total	43,166	40	-	43,206

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	13 172	12 968
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	3	29
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	1	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	89	85
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	13 265	13 082
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	2	2
Comptes créditeurs et charges à payer	21	15
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	23	17
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 242	13 065

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts non couvertes	13 242	13 065	42,97	42,39	308 163

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	225	502
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(338)	(3 600)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	498	(2 700)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	385	(5 798)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	3
Rabais sur frais	3	3
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	1
Total des autres revenus	4	7
Total des revenus	389	(5 791)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	12	30
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	15
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	1	4
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	18	50
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	371	(5 841)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts non couvertes	371	(5 841)	1,20	(8,14)	308 163	717 390

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13 065	82 365
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	371	(5 841)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(191)	(274)
Profits nets réalisés	-	(96)
Remboursement de capital	(3)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(194)	(370)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(56 432)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	(56 432)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	177	(62 643)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 242	19 722

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	371	(5 841)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	338	3 600
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	15
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(498)	2 700
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	3 373	6 726
Achat de placements et de dérivés	(3 420)	(10 014)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(4)	296
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(10)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	5	(2)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	169	(2 530)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(195)	(370)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	2 917
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(195)	2 547
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(26)	17
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	29	21
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	3	38
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	221	798
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS				
10 000	407 International Inc., 1,8 %, 22 mai 2025	9 472	9 409	
8 000	407 International Inc., 3,43 %, 1 ^{er} juin 2033	7 758	7 277	
4 000	407 International Inc., 3,67 %, 8 mars 2049	4 570	3 420	
2 000	407 International Inc., 3,72 %, 11 mai 2048	1 750	1 731	
2 000	407 International Inc., 3,98 %, 11 septembre 2052	2 299	1 797	
4 000	407 International Inc., 4,19 %, 25 avril 2042	4 669	3 767	
2 000	407 International Inc., 4,22 %, 14 février 2028	1 967	1 950	
1 000	407 International Inc., 4,68 %, 7 octobre 2053	1 292	1 010	
23 000	407 International Inc., série 06D1, 5,75 %, 14 février 2036	28 404	24 594	
9 000	55 School Board Trust, série A, 5,9 %, 2 juin 2033	12 221	10 142	
4 000	Aéroports de Montréal, 3,44 %, 26 avril 2051	4 024	3 298	
3 000	Aéroports de Montréal, 5,17 %, 17 septembre 2035	3 725	3 129	
1 000	Aéroports de Montréal, série H, 5,67 %, 16 octobre 2037	1 305	1 107	
5 000	Aéroports de Montréal, série R, 3,03 %, 21 avril 2050	5 132	3 823	
11 815	Alberta PowerLine LP, 4,07 %, 1 ^{er} décembre 2053	13 568	10 492	
15 769	Alberta PowerLine LP, 4,07 %, 1 ^{er} mars 2054	16 543	13 924	
17 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	17 069	14 162	
1 000	Algonquin Power Co., 4,09 %, 17 février 2027	1 056	948	
11 000	Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	11 380	10 650	
19 000	FPI Allied Properties, 3,1 %, 6 février 2032	19 046	14 825	
3 000	FPI Allied Properties, série E, 3,11 %, 8 avril 2027	3 205	2 693	
16 000	FPI Allied Properties, série F, 3,12 %, 21 février 2030	16 252	13 238	
7 000	FPI Allied Properties, série G, 3,13 %, 15 mai 2028	7 158	6 081	
21 000	AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	20 360	18 138	
5 000	AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	4 782	4 685	
2 000	AltaGas Ltd., 4,5 %, 15 août 2044	2 280	1 711	
13 000	AltaGas Ltd., 4,99 %, 4 octobre 2047	15 988	11 827	
7 000	AltaLink LP, 3,72 %, 3 décembre 2046	7 468	6 146	
3 000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc., 4,32 %, 15 mai 2047	3 326	2 711	
21 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	20 982	20 368	
16 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	13 825	14 051	
6 000	AT&T Inc., 4 %, 25 novembre 2025	6 294	5 799	
18 000	AT&T Inc., 4,85 %, 25 mai 2047	19 448	16 105	
29 000	AT&T Inc., 5,1 %, 25 novembre 2048	32 474	26 881	
10 000	ATCO Ltd., série 18-1, convertibles, taux variable, 1 ^{er} novembre 2078	9 957	9 438	
19 000	Aviva PLC, 4 %, 2 octobre 2030	19 642	16 969	
10 000	Bank of America Corp., taux flottant, 24 mars 2026	9 695	9 625	
10 000	Bank of America Corp., taux variable, 15 septembre 2027	9 555	8 962	
12 000	Bank of America Corp., taux variable, 16 mars 2028	11 636	11 233	
8 000	Banque de Montréal, 1,55 %, 28 mai 2026	7 405	7 204	
15 000	Banque de Montréal, 1,76 %, 10 mars 2026	13 778	13 685	
15 000	Banque de Montréal, 2,28 %, 29 juillet 2024	14 555	14 491	
10 000	Banque de Montréal, 2,37 %, 17 janvier 2025	9 618	9 508	
15 000	Banque de Montréal, 2,7 %, 11 septembre 2024	15 020	14 545	
26 000	Banque de Montréal, 3,19 %, 1 ^{er} mars 2028	24 741	24 319	
7 000	Banque de Montréal, 3,65 %, 1 ^{er} avril 2027	6 652	6 625	
17 000	Banque de Montréal, 4,31 %, 1 ^{er} juin 2027	16 674	16 459	
5 000	Banque de Montréal, 4,61 %, 10 septembre 2025	5 248	4 939	
13 000	Banque de Montréal, 4,71 %, 7 décembre 2027	13 029	12 749	
8 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 septembre 2029	8 086	7 705	
6 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	5 692	5 576	
40 000	Banque de Montréal, taux variable, 27 octobre 2032	41 806	41 160	
20 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,85 %, 2 novembre 2026	18 126	17 972	
19 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janvier 2025	18 478	17 990	
10 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	9 684	9 476	
41 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,29 %, 28 juin 2024	40 040	39 809	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
10 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,49 %, 23 septembre 2024	10 001	9 634	
11 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,62 %, 2 décembre 2026	10 477	10 220	
25 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,95 %, 8 mars 2027	24 066	23 126	
10 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 3,1 %, 2 février 2028	9 343	9 328	
14 000	Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 3 juillet 2029	13 631	13 568	
10 000	Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 3 mai 2032	9 196	9 347	
17 000	Bell Canada, 2,2 %, 29 mai 2028	16 918	14 975	
25 000	Bell Canada, 2,5 %, 14 mai 2030	21 849	21 352	
5 000	Bell Canada, 2,9 %, 12 août 2026	5 029	4 678	
21 000	Bell Canada, 2,9 %, 10 septembre 2029	19 845	18 701	
28 000	Bell Canada, 3 %, 17 mars 2031	27 841	24 320	
7 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	7 179	6 761	
41 000	Bell Canada, 3,5 %, 30 septembre 2050	41 985	30 675	
8 000	Bell Canada, 3,55 %, 2 mars 2026	7 767	7 650	
5 000	Bell Canada, 3,6 %, 29 septembre 2027	5 435	4 720	
26 000	Bell Canada, 3,8 %, 21 août 2028	27 531	24 602	
18 000	Bell Canada, 4,05 %, 17 mars 2051	18 514	14 865	
33 000	Bell Canada, 4,35 %, 18 décembre 2045	39 191	28 958	
27 000	Bell Canada, 4,45 %, 27 février 2047	30 968	24 023	
30 000	Bell Canada, 4,55 %, 9 février 2030	29 185	29 216	
15 000	Bell Canada, 5,15 %, 9 février 2053	14 258	14 776	
17 000	Bell Canada, 7,3 %, 23 février 2032	22 918	19 184	
22 000	Bell Canada, 7,85 %, 2 avril 2031	30 843	25 379	
12 000	Bell Canada, série 2, 7,65 %, 30 décembre 2031	15 768	13 584	
19 000	Bell Canada, série M-17, 6,1 %, 16 mars 2035	23 819	20 328	
9 000	BMW Canada Inc., 4,41 %, 10 février 2027	8 959	8 816	
14 000	Bridging North America G.P., série B, 4,34 %, 31 août 2053	16 399	11 869	
1 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 19-1, 2,79 %, 15 octobre 2049	1 010	735	
11 000	Brookfield Asset Management Inc., 4,82 %, 28 janvier 2026	10 989	10 782	
18 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 2,86 %, 1 ^{er} septembre 2032	14 865	14 565	
22 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,41 %, 9 octobre 2029	22 670	19 723	
23 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 4,19 %, 11 septembre 2028	23 512	21 782	
20 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,44 %, 25 avril 2034	20 184	19 795	
6 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,62 %, 14 novembre 2027	6 145	6 032	
10 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,79 %, 25 avril 2052	10 049	10 175	
20 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,33 %, 13 août 2050	20 323	14 299	
7 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,63 %, 15 janvier 2027	6 723	6 599	
6 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,75 %, 2 juin 2025	5 855	5 796	
17 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 4,25 %, 15 janvier 2029	17 965	16 241	
30 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 5,29 %, 28 octobre 2033	30 254	29 930	
12 000	Brookfield Renewable Partners ULC, série 12, 3,38 %, 15 janvier 2030	12 157	10 839	
7 000	Bruce Power LP, 3,97 %, 23 juin 2026	6 878	6 762	
19 000	Bruce Power LP, 4,99 %, 21 décembre 2032	19 180	18 879	
2 000	Bruce Power LP, série 17-1, 3 %, 21 juin 2024	2 035	1 952	
20 000	Bruce Power LP, série 17-2, 4,01 %, 21 juin 2029	21 283	19 025	
26 000	Bruce Power LP, série 18-1, 4,13 %, 21 juin 2033	28 615	24 041	
14 000	Bruce Power LP, série 19, 4,75 %, 21 juin 2049	18 034	13 124	
13 000	Bruce Power LP, série 21-1, 2,68 %, 21 décembre 2028	13 120	11 571	
1 000	Administration aéroportuaire de Calgary, série C, 3,45 %, 7 octobre 2041	1 035	851	
7 000	Administration aéroportuaire de Calgary, série D, 3,55 %, 7 octobre 2051	7 365	5 844	
5 000	Corporation Cameco, série H, 2,95 %, 21 octobre 2027	5 003	4 531	
10 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,1 %, 19 janvier 2026	9 415	8 992	
10 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,7 %, 15 juillet 2026	9 075	9 005	
22 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2 %, 17 avril 2025	21 230	20 666	
17 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	15 578	15 379	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
10 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	9 520	9 637	
20 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,75 %, 7 mars 2025	19 266	19 090	
12 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,3 %, 26 mai 2025	11 557	11 585	
12 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,05 %, 7 octobre 2027	11 887	11 915	
31 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 19 juin 2029	30 452	30 113	
10 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 juillet 2030	9 437	9 251	
1 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 avril 2031	965	897	
10 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 7 avril 2032	9 795	9 448	
9 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,05 %, 8 février 2050	9 786	6 866	
4 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 1 ^{er} août 2047	4 094	3 399	
6 000	Canadian Natural Resources Ltd., 2,5 %, 17 janvier 2028	6 091	5 385	
7 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,55 %, 3 juin 2024	7 193	6 877	
22 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 2,54 %, 28 février 2028	22 162	19 921	
15 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,05 %, 9 mars 2050	15 981	11 100	
9 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 6,45 %, 17 novembre 2039	13 646	10 621	
10 000	La Société Canadian Tire Limitée, 6,5 %, 13 avril 2028	11 973	10 494	
13 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 2,6 %, 6 septembre 2024	12 415	12 484	
10 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 3,86 %, 21 avril 2025	9 900	9 624	
10 897	Capital City Link G.P., série A, 4,39 %, 31 mars 2046	11 616	10 136	
17 000	Capital Power Corp., 3,15 %, 1 ^{er} octobre 2032	17 014	14 106	
2 000	Capital Power Corp., 4,28 %, 18 septembre 2024	2 089	1 958	
6 000	Capital Power Corp., 4,99 %, 23 janvier 2026	5 973	5 872	
13 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	13 017	12 176	
6 000	Cenovus Energy Inc., 3,6 %, 10 mars 2027	6 263	5 710	
16 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	15 812	13 884	
18 000	FPI Choice Properties, 5,4 %, 1 ^{er} mars 2033	17 880	17 954	
2 000	FPI Propriétés de Choix, série J, 3,55 %, 10 janvier 2025	2 059	1 935	
21 000	FPI Propriétés de Choix, série L, 4,18 %, 8 mars 2028	22 587	19 939	
24 000	FPI Propriétés de Choix, série M, 3,53 %, 11 juin 2029	25 114	21 853	
13 000	FPI Propriétés de Choix, série N, 2,98 %, 4 mars 2030	13 871	11 261	
13 000	FPI Propriétés de Choix, série P, 2,85 %, 21 mai 2027	11 908	11 870	
15 000	Cogeco Communications Inc., 2,99 %, 22 septembre 2031	13 027	12 651	
9 000	Cogeco Communications Inc., 5,3 %, 16 février 2033	8 809	8 906	
21 435	Comber Wind LP, 5,13 %, 15 novembre 2030	23 051	20 832	
12 000	Services financiers Co-operators limitée, 3,33 %, 13 mai 2030	11 840	10 193	
28 000	CPPIB Capital Inc., 3 %, 15 juin 2028	27 992	26 721	
13 000	CPPIB Capital Inc., 3,95 %, 2 juin 2032	13 226	12 963	
1 000	FPI Crombie, série F, 3,68 %, 26 août 2026	1 027	938	
6 000	FPI Crombie, série G, 3,92 %, 21 juin 2027	6 522	5 609	
5 000	FPI Crombie, série H, 2,69 %, 31 mars 2028	5 026	4 370	
2 000	FPI Crombie, série I, 3,21 %, 9 octobre 2030	2 010	1 689	
9 000	FPI Crombie, série J, 3,13 %, 12 août 2031	9 069	7 413	
4 020	CSS FSCC Partnership, 6,92 %, 31 juillet 2042	5 261	4 537	
10 000	FPI CT, série F, 3,87 %, 7 décembre 2027	10 188	9 303	
7 000	FPI CT, série G, 2,37 %, 6 janvier 2031	7 024	5 557	
5 000	CU Inc., 3,17 %, 5 septembre 2051	4 877	3 874	
1 000	CU Inc., 4,21 %, 29 octobre 2055	1 300	920	
5 000	CU Inc., 4,56 %, 7 novembre 2053	6 001	4 914	
5 000	CU Inc., 4,77 %, 14 septembre 2052	4 956	5 094	
2 000	CU Inc., 5,03 %, 20 novembre 2036	2 442	2 055	
3 000	CU Inc., 5,18 %, 21 novembre 2035	3 950	3 132	
3 000	CU Inc., 5,9 %, 20 novembre 2034	4 026	3 310	
7 000	Daimler Canada Finance Inc., 1,65 %, 22 septembre 2025	6 367	6 473	
4 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	3 974	3 797	
10 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 5,18 %, 19 septembre 2025	9 999	9 886	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
14 000	Dollarama Inc., 2,44 %, 9 juillet 2029	14 065	12 197	
10 000	Dollarama Inc., 5,17 %, 26 avril 2030	10 348	10 081	
6 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	5 305	5 420	
10 000	Summit Industrial Income LP, série D, 2,44 %, 14 juillet 2028	8 739	8 607	
16 000	Emera Inc., 4,84 %, 2 mai 2030	15 682	15 597	
4 000	Enbridge Gas Distribution Inc., 6,16 %, 16 décembre 2033	5 095	4 414	
5 000	Enbridge Gas Inc., 3,01 %, 9 août 2049	5 117	3 747	
5 000	Enbridge Gas Inc., 3,31 %, 11 septembre 2025	5 018	4 800	
3 000	Enbridge Gas Inc., 3,51 %, 29 novembre 2047	3 095	2 484	
4 000	Enbridge Gas Inc., 4,5 %, 23 novembre 2043	4 846	3 882	
6 000	Enbridge Gas Inc., 4,55 %, 17 août 2052	5 891	5 863	
5 000	Enbridge Inc., 2,44 %, 2 juin 2025	4 988	4 728	
17 000	Enbridge Inc., 2,99 %, 3 octobre 2029	17 518	15 112	
32 000	Enbridge Inc., 3,1 %, 21 septembre 2033	30 618	26 564	
6 000	Enbridge Inc., 3,2 %, 8 juin 2027	6 535	5 592	
18 000	Enbridge Inc., 4,1 %, 21 septembre 2051	17 758	14 375	
26 000	Enbridge Inc., 4,24 %, 27 août 2042	27 085	22 039	
10 000	Enbridge Inc., 4,57 %, 11 mars 2044	11 520	8 813	
23 000	Enbridge Inc., 4,87 %, 21 novembre 2044	27 221	21 113	
12 000	Enbridge Inc., 5,36 %, 26 mai 2033	12 038	12 051	
7 000	Enbridge Inc., 5,57 %, 14 novembre 2035	8 247	6 969	
10 000	Enbridge Inc., 5,7 %, 9 novembre 2027	10 472	10 189	
17 000	Enbridge Inc., 5,76 %, 26 mai 2053	17 268	17 632	
22 000	Enbridge Inc., 6,1 %, 9 novembre 2032	23 102	23 268	
20 000	Enbridge Inc., 6,51 %, 9 novembre 2052	21 899	22 839	
17 000	Enbridge Inc., 7,2 %, 18 juin 2032	22 627	18 480	
5 000	Enbridge Inc., 7,22 %, 24 juillet 2030	6 930	5 387	
34 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,52 %, 22 février 2029	37 382	31 520	
23 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,13 %, 9 août 2046	25 633	19 048	
22 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,2 %, 12 mai 2051	22 656	18 090	
13 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 17 août 2043	14 992	11 566	
22 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 29 septembre 2045	25 580	19 441	
2 000	Pipelines Enbridge Inc., 5,08 %, 19 décembre 2036	2 300	1 925	
7 000	Pipelines Enbridge Inc., 5,33 %, 6 avril 2040	8 593	6 902	
4 000	Énergir Inc., 5,7 %, 10 juillet 2036	5 592	4 370	
4 000	Énergir Inc., série U, 3,53 %, 16 mai 2047	3 933	3 341	
2 000	ENMAX Corp., 3,81 %, 5 décembre 2024	1 942	1 935	
8 000	ENMAX Corp., série 4, 3,84 %, 5 juin 2028	7 845	7 496	
3 000	EPCOR Utilities Inc., 2,9 %, 19 mai 2050	3 232	2 206	
3 000	EPCOR Utilities Inc., 3,11 %, 8 juillet 2049	3 018	2 313	
2 000	EPCOR Utilities Inc., 3,55 %, 27 novembre 2047	2 123	1 684	
2 000	EPCOR Utilities Inc., 4,55 %, 28 février 2042	2 490	1 972	
4 000	EPCOR Utilities Inc., 5,75 %, 24 novembre 2039	5 466	4 485	
10 000	Banque Équitable, 1,88 %, 26 novembre 2025	9 059	9 007	
1 000	Banque Équitable, 1,94 %, 10 mars 2025	980	929	
21 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,95 %, 3 mars 2031	21 223	18 250	
18 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,23 %, 14 juin 2029	18 099	16 673	
20 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 décembre 2027	20 129	18 828	
10 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 1,09 %, 21 janvier 2026	9 408	8 988	
10 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 2,42 %, 4 octobre 2024	9 757	9 614	
15 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 4,41 %, 19 mai 2027	15 022	14 566	
12 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,2 %, 1 ^{er} octobre 2025	12 098	11 928	
10 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, taux flottant, 26 mai 2030	9 708	9 437	
6 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, taux variable, 28 mai 2031	5 736	5 361	
9 000	Finning International Inc., 5,08 %, 13 juin 2042	10 212	8 616	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
10 000	FPI First Capital, série U, 3,75 %, 12 juillet 2027	10 393	9 096	
19 000	Fortis Inc., 2,18 %, 15 mai 2028	19 157	16 842	
13 000	Fortis Inc., 4,43 %, 31 mai 2029	12 816	12 696	
3 000	FortisAlberta Inc., 3,67 %, 9 septembre 2047	3 627	2 566	
3 000	FortisAlberta Inc., 3,73 %, 18 septembre 2048	2 996	2 589	
3 000	FortisAlberta Inc., 4,85 %, 11 septembre 2043	3 694	3 055	
4 000	FortisAlberta Inc., série 04-2, 6,22 %, 31 octobre 2034	5 672	4 530	
3 000	FortisBC Energy Inc., 2,54 %, 13 juillet 2050	3 027	2 047	
5 000	FortisBC Energy Inc., 3,38 %, 13 avril 2045	5 705	4 139	
3 000	FortisBC Energy Inc., 3,67 %, 9 avril 2046	3 340	2 598	
2 000	FortisBC Energy Inc., 6 %, 2 octobre 2037	2 694	2 276	
10 000	FortisBC Inc., 4 %, 28 octobre 2044	12 198	8 782	
10 000	Société de financement GE Capital Canada, 5,73 %, 22 octobre 2037	11 840	10 207	
10 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,7 %, 9 juillet 2025	8 984	9 199	
1 000	Genworth MI Canada Inc., 2,96 %, 1 ^{er} mars 2027	1 027	887	
11 000	Gibson Energy Inc., 3,6 %, 17 septembre 2029	11 302	9 966	
10 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 30 novembre 2027	9 775	9 070	
23 000	Société en commandite Holding FPI Granite, 2,19 %, 30 août 2028	23 151	19 705	
9 000	Société en commandite Holding FPI Granite, 2,38 %, 18 décembre 2030	9 097	7 317	
1 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 11-1, 5,3 %, 25 février 2041	1 363	1 089	
2 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 21-1, 3,15 %, 5 octobre 2051	1 948	1 574	
2 000	Great-West Lifeco Inc., 2,98 %, 8 juillet 2050	2 206	1 467	
5 000	FPI H&R, série R, 2,91 %, 2 juin 2026	4 987	4 565	
2 000	FPI H&R, série S, 2,63 %, 19 février 2027	1 985	1 773	
3 000	Administration de l'aéroport international d'Halifax, 5,5 %, 19 juillet 2041	4 335	3 192	
29 000	Heathrow Funding Ltd., 2,69 %, 13 octobre 2029	29 546	26 234	
19 000	Heathrow Funding Ltd., 3,66 %, 13 janvier 2033	19 787	17 077	
12 000	Heathrow Funding Ltd., 3,73 %, 13 avril 2035	12 427	10 425	
15 000	Heathrow Funding Ltd., 3,78 %, 4 septembre 2032	16 305	13 661	
5 000	Honda Canada Finance Inc., 1,34 %, 17 mars 2026	4 537	4 507	
10 000	Honda Canada Finance Inc., 2,5 %, 4 juin 2024	9 849	9 737	
5 000	Honda Canada Finance Inc., 3,44 %, 23 mai 2025	4 925	4 825	
7 000	Hospital for Sick Children (The), série B, 3,42 %, 7 décembre 2057	7 970	5 701	
25 235	Hospital Infrastructure Partners (NOH) Partnership, série A, 5,44 %, 31 janvier 2045	32 296	25 714	
10 000	Banque HSBC Canada, 1,78 %, 20 mai 2026	9 679	9 093	
17 000	Banque HSBC Canada, 3,4 %, 24 mars 2025	16 726	16 414	
8 000	Hydro One Inc., 1,76 %, 28 février 2025	7 719	7 577	
5 000	Hydro One Inc., 2,71 %, 28 février 2050	5 114	3 573	
3 000	Hydro One Inc., 3,63 %, 25 juin 2049	3 243	2 568	
2 000	Hydro One Inc., 3,91 %, 23 février 2046	2 288	1 803	
2 000	Hydro One Inc., 4 %, 22 décembre 2051	2 331	1 818	
3 000	Hydro One Inc., 4,17 %, 6 juin 2044	2 872	2 820	
2 000	Hydro One Inc., 4,59 %, 9 octobre 2043	2 514	1 990	
4 000	Hydro One Inc., 4,89 %, 13 mars 2037	4 259	4 105	
4 000	Hydro One Inc., 5,36 %, 20 mai 2036	4 993	4 283	
8 000	Hydro One Inc., 6,35 %, 31 janvier 2034	9 805	9 094	
3 000	Hydro One Inc., série 17, 6,03 %, 3 mars 2039	4 242	3 468	
7 000	Hydro One Ltd., 1,41 %, 15 octobre 2027	6 191	6 120	
10 000	iA Société financière Inc., taux variable, 21 février 2030	9 450	9 446	
3 000	iA Société financière Inc., taux variable, 24 septembre 2031	2 839	2 768	
2 000	Société financière IGM Inc., 4,17 %, 13 juillet 2048	2 071	1 745	
13 438	InPower BC G.P., 4,47 %, 31 mars 2033	13 967	12 871	
5 000	Intact Corporation financière, 2,85 %, 7 juin 2027	4 608	4 620	
6 000	Intact Corporation financière, 2,95 %, 16 décembre 2050	6 121	4 368	
4 290	Integrated Team Solutions PCH Partnership, 4,88 %, 31 mai 2046	4 824	4 145	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
9 000	Inter Pipeline Ltd., 3,17 %, 24 mars 2025	8 643	8 612	
11 000	Inter Pipeline Ltd., 4,64 %, 30 mai 2044	11 527	9 205	
20 000	Inter Pipeline Ltd., 5,76 %, 17 février 2028	20 415	20 093	
25 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	23 592	21 982	
13 000	Inter Pipeline Ltd., série 13, 5,09 %, 27 novembre 2051	13 470	11 373	
12 000	Inter Pipeline Ltd., série 14, 5,85 %, 18 mai 2032	12 012	12 003	
11 000	John Deere Financial Inc., 1,09 %, 17 juillet 2024	10 682	10 527	
5 000	John Deere Financial Inc., 2,41 %, 14 janvier 2025	4 831	4 783	
8 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	7 310	7 043	
10 000	Keyera Corp., 3,93 %, 21 juin 2028	10 129	9 402	
20 000	Keyera Corp., 3,96 %, 29 mai 2030	21 333	18 365	
2 000	Keyera Corp., 5,02 %, 28 mars 2032	1 972	1 932	
3 000	Labrador-Island Link Funding Trust, série B, 3,86 %, 1 ^{er} décembre 2045	4 001	2 914	
2 000	Banque Laurentienne du Canada, 1,15 %, 3 juin 2024	1 953	1 915	
21 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 4,49 %, 11 décembre 2028	23 789	20 607	
20 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,01 %, 13 septembre 2032	20 074	20 118	
10 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,34 %, 13 septembre 2052	10 281	10 468	
9 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 6,5 %, 22 janvier 2029	10 768	9 569	
7 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 7 %, 7 juin 2040	10 538	8 108	
1 000	Lower Mattagami Energy LP, 4,18 %, 23 avril 2052	1 083	935	
6 000	Lower Mattagami Energy LP, série 2014-1, 3,42 %, 20 juin 2024	6 251	5 884	
10 000	Banque Manuvie du Canada, 1,34 %, 26 février 2026	9 081	9 022	
2 000	Banque Manuvie du Canada, 2,38 %, 19 novembre 2024	1 997	1 913	
10 000	Banque Manuvie du Canada, 2,86 %, 16 février 2027	10 021	9 233	
10 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 20 août 2029	10 112	9 685	
8 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 12 mai 2030	7 674	7 509	
9 077	Maritime Link Financing Trust, série A, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2052	9 582	8 524	
9 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	8 762	8 692	
2 000	Université McGill, série A, 6,15 %, 22 septembre 2042	2 795	2 359	
5 000	Université McGill, série B, 3,98 %, 29 janvier 2056	6 705	4 443	
12 000	Metro Inc., 3,39 %, 6 décembre 2027	12 631	11 277	
7 000	Metro Inc., 3,41 %, 28 février 2050	7 350	5 351	
10 000	Metro Inc., 4,27 %, 4 décembre 2047	11 822	8 902	
16 000	Metro Inc., 5,97 %, 15 octobre 2035	20 365	17 401	
22 000	Metro Inc., série D, 5,03 %, 1 ^{er} décembre 2044	24 367	21 879	
3 000	Mondeléz International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	3 081	2 889	
10 000	Morgan Stanley, taux variable, 4 août 2027	9 496	8 923	
10 000	Banque Nationale du Canada, 1,53 %, 15 juin 2026	9 034	8 996	
10 000	Banque Nationale du Canada, 2,24 %, 4 novembre 2026	9 207	9 090	
10 000	Banque Nationale du Canada, 2,55 %, 12 juillet 2024	10 021	9 694	
10 000	Banque Nationale du Canada, 2,58 %, 3 février 2025	9 998	9 540	
10 000	Banque nationale du Canada, taux variable, 18 août 2026	9 224	9 215	
36 000	National Grid Electricity Transmission PLC, 2,3 %, 22 juin 2029	35 937	30 932	
5 000	NAV Canada, 2,92 %, 29 septembre 2051	5 227	3 780	
4 000	NAV Canada, 3,21 %, 29 septembre 2050	4 221	3 213	
1 000	NAV Canada, 3,29 %, 30 mars 2048	1 117	825	
8 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série A, 3,2 %, 22 juillet 2024	7 770	7 800	
6 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série I, 4,35 %, 14 septembre 2028	6 705	5 620	
10 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série J, 2,8 %, 1 ^{er} juin 2027	9 250	9 245	
8 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série K, 3,65 %, 1 ^{er} juin 2035	8 297	7 087	
4 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série M, 2 %, 1 ^{er} décembre 2026	3 872	3 622	
27 434	Northern Courier Pipeline LP, 3,37 %, 30 juin 2042	28 796	23 975	
14 936	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série A, 4,12 %, 30 juin 2042	14 990	13 209	
11 964	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série B, 4,11 %, 31 mars 2042	12 106	10 562	
20 201	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série D, 3,74 %, 31 décembre 2032	19 735	18 630	
8 000	Nova Scotia Power Inc., 3,31 %, 25 avril 2050	5 610	5 909	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
9 000	Nova Scotia Power Inc., 3,61 %, 1 ^{er} mai 2045	10 445	7 229	
14 500	Nova Scotia Power Inc., 4,15 %, 6 mars 2042	15 704	12 740	
27 000	Nova Scotia Power Inc., 4,5 %, 20 juillet 2043	24 478	24 816	
9 000	Nova Scotia Power Inc., 4,95 %, 15 novembre 2032	9 197	8 912	
5 000	Nova Scotia Power Inc., 5,67 %, 14 novembre 2035	5 246	5 227	
8 000	Nova Scotia Power Inc., 6,95 %, 25 août 2033	11 273	9 012	
8 000	Nova Scotia Power Inc., série X, 5,61 %, 15 juin 2040	10 975	8 394	
14 000	OMERS Realty Corp., 3,33 %, 12 novembre 2024	13 669	13 583	
1 000	Ontario Infrastructure Projects Corp., série 07-A1, 4,7 %, 1 ^{er} juin 2037	1 182	1 033	
1 000	Ontario Power Generation Inc., 1,17 %, 22 avril 2026	979	897	
4 000	Ontario Power Generation Inc., 2,95 %, 21 février 2051	3 740	2 874	
7 000	Ontario Power Generation Inc., 3,22 %, 8 avril 2030	7 512	6 399	
5 000	Ontario Power Generation Inc., 3,32 %, 4 octobre 2027	5 158	4 712	
5 000	Ontario Power Generation Inc. (OPG), 4,92 %, 19 juillet 2032	5 294	5 056	
2 000	Ontario Power Generation Inc., série 5, 3,65 %, 13 septembre 2050	2 130	1 653	
6 000	Pembina Pipeline Corp., 3,53 %, 10 décembre 2031	5 342	5 247	
20 000	Pembina Pipeline Corp., 3,62 %, 3 avril 2029	20 753	18 435	
5 000	Pembina Pipeline Corp., 4,24 %, 15 juin 2027	5 334	4 824	
16 000	Pembina Pipeline Corp., 4,49 %, 10 décembre 2051	16 906	13 355	
13 000	Pembina Pipeline Corp., 4,67 %, 28 mai 2050	13 921	11 228	
16 000	Pembina Pipeline Corp., 4,75 %, 30 avril 2043	16 363	14 264	
29 000	Pembina Pipeline Corp., série 4, 4,81 %, 25 mars 2044	31 861	25 948	
7 000	Pembina Pipeline Corp., série 5, 3,54 %, 3 février 2025	6 734	6 777	
41 000	Pembina Pipeline Corp., série 11, 4,75 %, 26 mars 2048	40 589	36 007	
23 000	Pembina Pipeline Corp., série 15, 3,31 %, 1 ^{er} février 2030	24 472	20 509	
2 379	Plenary Health Care Partnerships Humber LP, 4,90 %, 31 mai 2039	2 659	2 312	
16 353	Plenary Properties LTAP LP, 6,29 %, 31 janvier 2044	22 014	17 990	
18 000	PSP Capital Inc., 1,5 %, 15 mars 2028	18 151	16 053	
7 000	PSP Capital Inc., 2,6 %, 1 ^{er} mars 2032	6 711	6 298	
15 000	PSP Capital Inc., série 12, 2,05 %, 15 janvier 2030	13 372	13 364	
11 000	Reliance LP, 2,67 %, 1 ^{er} août 2028	11 019	9 578	
7 000	Reliance LP, 2,68 %, 1 ^{er} décembre 2027	7 305	6 198	
10 000	RioCan FPI, 5,61 %, 6 octobre 2027	10 003	9 870	
2 000	FPI RioCan, série AD, 1,97 %, 15 juin 2026	1 925	1 790	
19 000	FPI RioCan, série AE, 2,83 %, 8 novembre 2028	18 991	16 339	
12 000	Rogers Communications Inc., 2,9 %, 9 décembre 2030	12 813	10 158	
29 000	Rogers Communications Inc., 3,25 %, 1 ^{er} mai 2029	28 784	26 074	
7 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	7 825	6 579	
6 000	Rogers Communications Inc., 3,8 %, 1 ^{er} mars 2027	6 191	5 674	
13 000	Rogers Communications Inc., 4,4 %, 2 novembre 2028	13 890	12 437	
33 000	Rogers Communications Inc., 6,11 %, 25 août 2040	44 305	34 429	
7 000	Rogers Communications Inc., 6,56 %, 22 mars 2041	10 113	7 653	
6 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,1 %, 15 avril 2025	5 909	5 739	
28 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,75 %, 15 avril 2029	27 373	25 877	
32 000	Rogers Communications Inc., restreint, 4,25 %, 15 avril 2032	30 915	29 351	
33 000	Rogers Communications Inc., restreint, 5,25 %, 15 avril 2052	33 273	31 077	
10 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	9 567	9 034	
20 000	Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 ^{er} mai 2025	18 881	18 767	
15 000	Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28 janvier 2027	13 829	13 608	
17 000	Banque Royale du Canada, 2,35 %, 2 juillet 2024	16 837	16 475	
26 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	24 768	25 003	
35 000	Banque Royale du Canada, 3,37 %, 24 mars 2025	34 498	33 468	
21 000	Banque Royale du Canada, 4,61 %, 26 juillet 2027	20 666	20 578	
10 000	Banque Royale du Canada, 4,93 %, 16 juillet 2025	10 590	9 951	
12 000	Banque Royale du Canada, 5,24 %, 2 novembre 2026	12 018	11 999	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
20 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 25 juillet 2029	19 687	19 331	
15 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 23 décembre 2029	14 686	14 339	
15 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 novembre 2031	13 581	13 336	
10 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 mai 2032	9 217	9 013	
24 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 28 janvier 2033	20 234	20 103	
10 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 1 ^{er} février 2033	9 828	9 703	
12 000	Sagen MI Canada Inc., 3,26 %, 5 mars 2031	11 952	9 784	
14 000	Saputo Inc., 1,42 %, 19 juin 2026	12 651	12 548	
13 000	Saputo Inc., 2,3 %, 22 juin 2028	12 989	11 422	
8 000	Saputo Inc., 5,25 %, 29 novembre 2029	8 284	8 065	
24 000	Fiducie de Capital Banque Scotia, série 06-1, convertibles, taux variable, 31 décembre 2056	30 741	24 836	
1 518	SEC LP and Arci Ltd., 5,19 %, 29 août 2033	1 590	1 446	
10 247	SGTP Highway Bypass LP, série A, 4,11 %, 31 janvier 2045	11 266	9 251	
18 000	Shaw Communications Inc., 3,3 %, 10 décembre 2029	16 924	16 012	
8 000	Shaw Communications Inc., 4,25 %, 9 décembre 2049	8 845	6 447	
49 000	Shaw Communications Inc., 6,75 %, 9 novembre 2039	68 797	54 282	
9 000	SmartCentres REIT, série S, 3,83 %, 21 décembre 2027	8 590	8 289	
10 000	SmartCentres REIT, série U, 3,53 %, 20 décembre 2029	8 920	8 749	
10 000	SmartCentres REIT, série W, 3,65 %, 11 décembre 2030	8 778	8 633	
13 000	SmartCentres REIT, série Y, 2,31 %, 18 décembre 2028	13 032	10 869	
8 000	Sobeys Inc., 6,64 %, 7 juin 2040	11 203	8 809	
6 000	Sobeys Inc., série D, 6,06 %, 29 octobre 2035	7 562	6 191	
12 045	SSL Finance Inc./SSL Financement Inc., série A, 4,1 %, 31 octobre 2045	13 614	10 848	
12 000	Stantec Inc., 2,05 %, 8 octobre 2027	12 001	10 537	
5 000	Sun Life Capital Trust, série B, convertibles, 7,09 %, 30 juin 2032	7 172	5 436	
10 000	Financière Sun Life Inc., taux flottant, 13 août 2029	9 755	9 619	
5 000	Financière Sun Life Inc., taux variable, 18 novembre 2031	4 883	4 524	
16 000	Suncor Énergie Inc., 3,95 %, 4 mars 2051	14 667	12 712	
48 000	Suncor Énergie Inc., 5,39 %, 26 mars 2037	48 893	48 313	
10 000	Suncor Énergie Inc., série 5, 4,34 %, 13 septembre 2046	11 566	8 594	
22 000	TELUS Corp., 2,05 %, 7 octobre 2030	19 671	17 915	
9 000	TELUS Corp., 2,35 %, 27 janvier 2028	8 730	8 009	
32 000	TELUS Corp., 2,85 %, 13 novembre 2031	31 246	27 009	
24 000	TELUS Corp., 3,63 %, 1 ^{er} mars 2028	23 863	22 548	
4 000	TELUS Corp., 3,75 %, 17 janvier 2025	4 144	3 897	
28 000	TELUS Corp., 4,4 %, 1 ^{er} avril 2043	30 377	24 472	
26 000	TELUS Corp., 4,4 %, 29 janvier 2046	22 287	22 486	
10 000	TELUS Corp., 4,75 %, 17 janvier 2045	11 157	9 115	
15 000	TELUS Corp., 5 %, 13 septembre 2029	14 872	14 942	
20 000	TELUS Corp., 5,15 %, 26 novembre 2043	24 258	19 264	
14 000	TELUS Corp., 5,25 %, 15 novembre 2032	13 852	14 053	
18 000	TELUS Corp., 5,65 %, 13 septembre 2052	17 922	18 614	
21 000	TELUS Corp., série CAA, 3,15 %, 19 février 2030	21 240	18 708	
26 000	TELUS Corp., série CAB, 3,95 %, 16 février 2050	28 011	20 643	
2 000	TELUS Corp., série CAE, 4,1 %, 5 avril 2051	2 020	1 625	
24 000	TELUS Corp., série CP, 4,85 %, 5 avril 2044	28 422	22 221	
19 000	TELUS Corp., série CW, 4,7 %, 6 mars 2048	23 436	17 110	
24 000	TELUS Corp., série CY, 3,3 %, 2 mai 2029	25 086	21 915	
6 000	TELUS Corp., série CZ, 2,75 %, 8 juillet 2026	6 003	5 599	
14 000	Teranet Holdings LP, 6,1 %, 17 juin 2041	17 863	14 209	
1 000	Terasen Gas (Vancouver Island) Inc., 6,05 %, 15 février 2038	1 450	1 144	
7 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	6 962	6 605	
6 000	Groupe TMX Limitée, série D, 3 %, 11 décembre 2024	5 888	5 797	
3 000	Toronto Hydro Corp., 2,47 %, 20 octobre 2031	2 976	2 582	
6 000	Toronto Hydro Corp., 4,08 %, 16 septembre 2044	7 378	5 636	
2 000	Toronto Hydro Corp., 5,54 %, 21 mai 2040	2 529	2 233	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
5 000	Toronto Hydro Corp., série 14, 2,43 %, 11 décembre 2029	5 168	4 452	
1 000	Toronto Hydro Corp., série 16, 1,5 %, 15 octobre 2030	994	817	
15 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,13 %, 9 décembre 2025	13 811	13 564	
21 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,94 %, 13 mars 2025	20 145	19 786	
13 000	Banque Toronto Dominion (La), 2,26 %, 7 janvier 2027	12 256	11 780	
29 000	Banque Toronto Dominion (La), 2,67 %, 6 avril 2033	27 454	27 348	
23 000	Banque Toronto-Dominion (La), 3,23 %, 24 juillet 2024	23 160	22 497	
17 000	Banque Toronto-Dominion (La), 4,21 %, 1 ^{er} juin 2027	16 619	16 421	
15 000	Banque Toronto Dominion (La), 4,34 %, 27 janvier 2026	15 148	14 633	
47 000	Banque Toronto-Dominion (La), 5,38 %, 21 octobre 2027	48 084	47 353	
11 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux flottant, 26 janvier 2032	10 331	10 044	
21 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 25 juillet 2029	20 880	20 397	
30 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	29 445	28 541	
10 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 4 mars 2031	10 691	9 774	
7 000	Tourmaline Oil Corp., série 1, 2,08 %, 25 janvier 2028	7 025	6 124	
5 000	Tourmaline Oil Corp. série 2, 2,53 %, 12 février 2029	5 061	4 371	
5 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,27 %, 22 juillet 2024	4 789	4 792	
10 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,66 %, 20 juillet 2026	9 089	9 048	
9 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,11 %, 26 février 2025	8 590	8 544	
5 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,31 %, 23 octobre 2024	4 979	4 801	
18 000	TransCanada PipeLines Ltd., 2,97 %, 9 juin 2031	18 403	15 322	
19 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3 %, 18 septembre 2029	19 330	16 856	
6 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,3 %, 17 juillet 2025	6 147	5 750	
18 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	18 881	16 670	
10 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,8 %, 5 avril 2027	10 719	9 522	
52 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,18 %, 3 juillet 2048	56 166	42 653	
42 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,33 %, 16 septembre 2047	46 757	35 382	
33 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,34 %, 15 octobre 2049	31 815	27 659	
35 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,35 %, 6 juin 2046	38 550	29 726	
36 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,28 %, 15 juillet 2030	37 217	36 117	
20 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,33 %, 12 mai 2032	20 247	19 989	
8 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,42 %, 10 mars 2026	8 016	7 946	
15 000	TransCanada PipeLines Ltd., 5,92 %, 12 mai 2052	15 523	15 874	
3 000	TransCanada PipeLines Ltd., 6,28 %, 26 mai 2028	3 575	3 095	
10 000	TransCanada PipeLines Ltd., 8,05 %, 17 février 2039	15 415	12 602	
18 000	Transurban Finance Co., PTY Ltd., 4,56 %, 14 novembre 2028	19 245	17 256	
17 219	Trillium Windpower LP, série 1, 5,8 %, 15 février 2033	19 162	17 267	
12 000	TriSummit Utilities Inc., 4,26 %, 5 décembre 2028	12 919	11 428	
14 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	13 472	13 526	
1 000	Union Gas Ltd., 4,2 %, 2 juin 2044	1 077	931	
6 000	Union Gas Ltd., 4,88 %, 21 juin 2041	7 452	6 108	
6 000	Union Gas Ltd., série 6, 5,46 %, 11 septembre 2036	7 385	6 414	
3 000	Université d'Ottawa, 6,28 %, 15 avril 2043	4 874	3 603	
2 000	Université de Toronto, série B, 5,84 %, 15 décembre 2043	3 041	2 316	
4 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série G, 3,66 %, 23 novembre 2048	4 205	3 490	
1 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série H, 2,87 %, 18 octobre 2049	931	753	
3 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série J, 2,8 %, 21 septembre 2050	2 847	2 211	
12 000	Ventas Canada Finance Ltd., série H, 3,3 %, 1 ^{er} décembre 2031	12 120	10 066	
28 000	Verizon Communications Inc., 2,38 %, 22 mars 2028	27 306	24 899	
2 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	2 129	1 708	
25 000	Verizon Communications Inc., 4,05 %, 22 mars 2051	26 199	20 652	
10 000	Crédit VW Canada Inc., 2,05 %, 10 décembre 2024	9 421	9 485	
6 000	Crédit VW Canada Inc., 2,85 %, 26 septembre 2024	6 041	5 790	
7 000	Crédit VW Canada Inc., 5,86 %, 15 novembre 2027	7 236	7 119	
12 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	11 479	11 148	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
10 000	Wells Fargo & Co., 2,98 %, 19 mai 2026	10 035	9 306	
10 000	Wells Fargo & Co., 3,87 %, 21 mai 2025	10 297	9 619	
7 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 28 avril 2026	6 893	6 787	
10 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 ^{er} mai 2026	9 672	9 413	
1 000	Westcoast Energy Inc., 3,77 %, 8 décembre 2025	1 045	961	
10 000	Westcoast Energy Inc., 4,79 %, 28 octobre 2041	11 999	9 223	
5 000	Westcoast Energy Inc., 7,15 %, 20 mars 2031	6 451	5 474	
19 000	WSP Global Inc., 2,41 %, 19 avril 2028	19 099	16 836	
6 000	Université York, 6,48 %, 7 mars 2042	8 640	7 291	
		6 419 777	5 743 287	43,4
OBLIGATIONS PROVINCIALES				
12 000	Financement-Québec, 5,25 %, 1 ^{er} juin 2034	15 473	13 247	
11 000	Autorité Financière des Premières Nations, 1,71 %, 16 juin 2030	11 225	9 451	
11 000	Hydro-Québec, 2 %, 1 ^{er} septembre 2028	10 413	9 968	
42 000	Hydro-Québec, 2,1 %, 15 février 2060	34 883	26 893	
41 000	Hydro-Québec, 4 %, 15 février 2055	40 167	40 952	
9 000	Hydro-Québec, 4 %, 15 février 2063	9 046	9 047	
40 000	Hydro-Québec, 6 %, 15 février 2040	51 272	48 734	
5 000	Hydro-Québec, 6,5 %, 16 janvier 2035	7 549	6 086	
23 000	Hydro-Québec, série 19, 6,5 %, 15 février 2035	35 065	28 185	
7 000	Hydro-Québec, série JG, 6 %, 15 août 2031	10 037	7 956	
16 000	Hydro-Québec, série JM, 5 %, 15 février 2045	20 489	17 930	
43 000	Hydro-Québec, série JN, 5 %, 15 février 2050	60 732	49 713	
2 000	Newfoundland & Labrador Hydro, 3,6 %, 1 ^{er} décembre 2045	2 283	1 747	
2 000	Newfoundland & Labrador Hydro, série AB, 6,65 %, 27 août 2031	2 700	2 332	
5 000	OPB Finance Trust, série E, 2,95 %, 2 février 2026	4 912	4 775	
4 000	OPB Finance Trust, série F, 2,98 %, 25 janvier 2027	4 234	3 795	
54 000	Province de l'Alberta, 1,65 %, 1 ^{er} juin 2031	52 146	45 484	
86 000	Province de l'Alberta, 2,05 %, 1 ^{er} juin 2030	87 269	76 080	
19 000	Province de l'Alberta, 2,2 %, 1 ^{er} juin 2026	18 171	17 857	
14 000	Province de l'Alberta, 2,35 %, 1 ^{er} juin 2025	14 119	13 399	
20 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 1 ^{er} juin 2027	21 144	18 842	
22 000	Province de l'Alberta, 2,95 %, 1 ^{er} juin 2052	18 646	17 817	
43 000	Province de l'Alberta, 3,05 %, 1 ^{er} décembre 2048	42 459	35 605	
18 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 ^{er} juin 2024	18 853	17 686	
56 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 ^{er} juin 2050	49 305	46 820	
32 000	Province de l'Alberta, 3,3 %, 1 ^{er} décembre 2046	31 131	27 809	
15 000	Province de l'Alberta, 3,45 %, 1 ^{er} décembre 2043	14 686	13 467	
5 000	Province de l'Alberta, 4,5 %, 1 ^{er} décembre 2040	5 802	5 175	
61 000	Province de la Colombie-Britannique, 1,55 %, 18 juin 2031	56 230	51 013	
35 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,2 %, 18 juin 2030	34 768	31 294	
5 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,3 %, 18 juin 2026	4 930	4 713	
17 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	16 240	16 022	
34 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,75 %, 18 juin 2052	30 432	26 731	
18 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	18 028	17 381	
5 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 décembre 2028	5 251	4 746	
37 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 juin 2050	30 658	30 350	
22 000	Province de la Colombie-Britannique, 3,2 %, 18 juin 2044	19 652	19 139	
20 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,3 %, 18 juin 2042	20 000	20 401	
23 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,7 %, 18 juin 2037	24 793	24 435	
11 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,9 %, 18 juin 2048	16 971	12 375	
15 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,95 %, 18 juin 2040	18 347	16 433	
18 000	Province de la Colombie-Britannique, 5,7 %, 18 juin 2029	23 546	19 649	
26 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD-35, 2,8 %, 18 juin 2048	20 238	20 786	
8 000	Province de la Colombie-Britannique, série CD14, 5,15 %, 18 juin 2029	8 684	8 483	
3 000	Province de la Colombie-Britannique, taux échelonné, 17 août 2028	3 649	3 216	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)				
15 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2030	15 602	13 252	
14 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2031	13 976	12 152	
7 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 5 septembre 2052	6 759	4 534	
23 000	Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	22 276	22 050	
18 000	Province du Manitoba, 2,6 %, 2 juin 2027	17 772	16 984	
22 000	Province du Manitoba, 2,75 %, 2 juin 2029	23 122	20 572	
12 000	Province du Manitoba, 2,85 %, 5 septembre 2046	9 628	9 547	
13 000	Province du Manitoba, 3 %, 2 juin 2028	13 027	12 406	
8 000	Province du Manitoba, 3,15 %, 5 septembre 2052	7 512	6 657	
12 000	Province du Manitoba, 3,2 %, 5 mars 2050	14 303	10 127	
13 000	Province du Manitoba, 3,4 %, 5 septembre 2048	12 076	11 371	
10 000	Province du Manitoba, 4,05 %, 5 septembre 2045	9 848	9 704	
13 000	Province du Manitoba, 4,1 %, 5 mars 2041	15 850	12 729	
3 000	Province du Manitoba, 4,6 %, 5 mars 2038	4 112	3 115	
15 000	Province du Manitoba, 4,63 %, 5 mars 2063	16 492	16 373	
11 000	Province du Manitoba, 4,65 %, 5 mars 2040	12 128	11 490	
4 000	Province du Manitoba, 5,7 %, 5 mars 2037	4 703	4 611	
5 000	Province du Manitoba, 6,3 %, 5 mars 2031	6 713	5 744	
25 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,55 %, 14 août 2031	22 122	22 467	
7 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,6 %, 14 août 2026	7 106	6 644	
8 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,05 %, 14 août 2050	7 577	6 580	
14 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,1 %, 14 août 2028	14 375	13 387	
7 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,1 %, 14 août 2048	8 068	5 821	
8 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2043	9 087	7 264	
3 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2055	3 289	2 666	
4 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,65 %, 3 juin 2024	4 421	3 948	
11 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,8 %, 14 août 2045	13 946	10 322	
5 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,55 %, 26 mars 2037	5 292	5 183	
4 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,65 %, 26 septembre 2035	4 291	4 201	
7 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,8 %, 26 septembre 2039	9 011	7 449	
5 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,8 %, 3 juin 2041	5 976	5 349	
5 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,25 %, 2 juin 2027	4 760	4 466	
10 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,75 %, 2 juin 2030	10 054	8 585	
10 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,05 %, 2 juin 2031	9 843	8 583	
8 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,3 %, 2 juin 2025	7 745	7 640	
10 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2028	9 527	9 434	
11 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2029	11 889	10 284	
4 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,15 %, 2 décembre 2052	3 401	3 182	
7 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,7 %, 17 octobre 2048	7 787	6 187	
2 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,5 %, 17 avril 2037	2 293	2 012	
6 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,65 %, 17 octobre 2040	8 225	6 107	
2 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 5,7 %, 17 octobre 2035	2 307	2 255	
5 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 6,55 %, 17 octobre 2030	6 746	5 742	
12 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6X, 3,3 %, 17 octobre 2046	11 231	9 928	
4 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6Z, 3 %, 2 juin 2026	4 240	3 840	
11 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 7H, 2,65 %, 17 octobre 2050	10 110	7 914	
9 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 1,1 %, 1 ^{er} juin 2028	8 636	7 836	
21 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 2 %, 1 ^{er} septembre 2030	20 923	18 412	
2 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 2,1 %, 1 ^{er} juin 2027	1 883	1 852	
19 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 3,15 %, 1 ^{er} décembre 2051	19 178	15 982	
7 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 3,5 %, 2 juin 2062	8 615	6 212	
9 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,4 %, 1 ^{er} juin 2042	11 718	9 191	
5 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,5 %, 1 ^{er} juin 2037	5 509	5 165	
4 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,7 %, 1 ^{er} juin 2041	4 947	4 231	
2 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 5,8 %, 1 ^{er} juin 2033	2 687	2 284	
2 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 6,6 %, 1 ^{er} juin 2027	2 592	2 174	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)				
2 000	Province de la Nouvelle-Écosse, série D8, 2,15 %, 1 ^{er} juin 2025	1 956	1 907	
20 000	Province de l'Ontario, 1,05 %, 8 septembre 2027	18 002	17 670	
79 000	Province de l'Ontario, 1,35 %, 2 décembre 2030	78 851	65 829	
52 000	Province de l'Ontario, 1,55 %, 1 ^{er} novembre 2029	51 819	45 038	
47 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	49 030	44 179	
50 000	Province de l'Ontario, 1,85 %, 1 ^{er} février 2027	46 054	46 110	
67 000	Province de l'Ontario, 1,9 %, 2 décembre 2051	43 641	43 234	
67 000	Province de l'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	67 507	59 324	
37 000	Province de l'Ontario, 2,15 %, 2 juin 2031	35 294	32 446	
42 000	Province de l'Ontario, 2,25 %, 2 décembre 2031	38 767	36 863	
16 000	Province de l'Ontario, 2,3 %, 8 septembre 2024	16 373	15 506	
31 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	30 767	29 313	
44 000	Province de l'Ontario, 2,55 %, 2 décembre 2052	31 554	32 998	
74 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	72 175	71 161	
50 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2027	47 607	47 222	
15 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 5 février 2025	14 637	14 499	
103 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 2 décembre 2050	98 532	79 415	
89 000	Province de l'Ontario, 2,7 %, 2 juin 2029	87 845	83 107	
162 000	Province de l'Ontario, 2,8 %, 2 juin 2048	139 582	129 710	
81 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2028	82 494	77 013	
88 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 décembre 2046	75 901	72 044	
87 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2049	71 360	70 727	
99 000	Province de l'Ontario, 3,45 %, 2 juin 2045	90 856	89 420	
53 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	52 662	52 256	
124 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2043	123 253	113 373	
36 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	36 493	35 332	
65 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	63 382	63 892	
30 000	Province de l'Ontario, 3,75 %, 2 décembre 2053	27 765	28 767	
31 000	Province de l'Ontario, 4,6 %, 2 juin 2039	37 922	32 634	
58 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	65 703	61 699	
70 000	Province de l'Ontario, 4,7 %, 2 juin 2037	82 650	74 370	
29 000	Province de l'Ontario, 5,6 %, 2 juin 2035	38 077	33 278	
34 000	Province de l'Ontario, 5,85 %, 8 mars 2033	42 177	38 932	
20 000	Province de l'Ontario, 6,2 %, 2 juin 2031	26 573	22 996	
14 000	Province de l'Ontario, 8 %, 2 juin 2026	19 824	15 357	
2 000	Province de l'Ontario, 8 %, 2 décembre 2026	2 777	2 232	
3 000	Province de l'Ontario, 8,5 %, 2 décembre 2025	4 205	3 258	
15 000	Province de l'Ontario, série KJ, 7,6 %, 2 juin 2027	20 648	16 842	
2 000	Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 3,6 %, 17 janvier 2053	2 087	1 795	
7 000	Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 4,6 %, 19 mai 2041	9 074	7 247	
74 000	Province de Québec, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2031	68 542	61 368	
78 000	Province de Québec, 1,9 %, 1 ^{er} septembre 2030	75 256	68 093	
4 000	Province de Québec, 2,1 %, 27 mai 2031	3 568	3 507	
53 000	Province de Québec, 2,3 %, 1 ^{er} septembre 2029	54 871	48 216	
28 000	Province de Québec, 2,5 %, 1 ^{er} septembre 2026	27 345	26 540	
4 000	Province de Québec, 2,6 %, 6 juillet 2025	4 159	3 842	
29 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2025	28 516	27 873	
30 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	29 110	28 481	
44 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2028	44 892	41 464	
70 000	Province de Québec, 2,85 %, 1 ^{er} décembre 2053	62 739	56 100	
86 000	Province de Québec, 3,1 %, 1 ^{er} décembre 2051	83 061	72 848	
61 000	Province de Québec, 3,25 %, 1 ^{er} septembre 2032	58 041	57 657	
90 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2045	86 530	81 886	
72 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2048	63 532	65 452	
8 000	Province de Québec, 3,65 %, 20 mai 2032	7 795	7 828	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)				
20 000	Province de Québec, 3,75 %, 1 ^{er} septembre 2024	20 387	19 714	
41 000	Province de Québec, 4,25 %, 1 ^{er} décembre 2043	42 315	41 690	
37 000	Province de Québec, 4,4 %, 1 ^{er} décembre 2055	39 022	39 938	
26 000	Province de Québec, 5 %, 1 ^{er} décembre 2038	35 136	28 549	
80 000	Province de Québec, 5 %, 1 ^{er} décembre 2041	102 398	88 817	
2 000	Province de Québec, 5,35 %, 1 ^{er} juin 2025	2 363	2 021	
14 000	Province de Québec, 5,75 %, 1 ^{er} décembre 2036	17 095	16 407	
38 000	Province de Québec, 6,25 %, 1 ^{er} juin 2032	54 350	44 339	
10 000	Province de Québec, 8,5 %, 1 ^{er} avril 2026	13 989	11 037	
26 000	Province de Québec, série OS, 6 %, 1 ^{er} octobre 2029	34 639	28 854	
17 000	Province de la Saskatchewan, 2,15 %, 2 juin 2031	17 159	14 883	
19 000	Province de la Saskatchewan, 2,2 %, 2 juin 2030	20 436	16 976	
14 000	Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	13 894	13 238	
12 000	Province de la Saskatchewan, 2,75 %, 2 décembre 2046	10 023	9 463	
10 000	Province de la Saskatchewan, 2,8 %, 2 décembre 2052	8 756	7 845	
6 000	Province de la Saskatchewan, 2,95 %, 2 juin 2058	6 187	4 749	
10 000	Province de la Saskatchewan, 3,05 %, 2 décembre 2028	10 841	9 533	
15 000	Province de la Saskatchewan, 3,1 %, 2 juin 2050	13 399	12 574	
6 000	Province de la Saskatchewan, 3,2 %, 3 juin 2024	6 276	5 900	
13 000	Province de la Saskatchewan, 3,3 %, 2 juin 2048	13 255	11 314	
7 000	Province de la Saskatchewan, 3,4 %, 3 février 2042	7 243	6 285	
5 000	Province de la Saskatchewan, 3,75 %, 5 mars 2054	4 625	4 728	
9 000	Province de la Saskatchewan, 3,9 %, 2 juin 2045	9 656	8 637	
2 000	Province de la Saskatchewan, 5,6 %, 5 septembre 2035	2 343	2 291	
3 000	Province de la Saskatchewan, série EC, 5 %, 5 mars 2037	3 336	3 268	
6 000	Province de la Saskatchewan, série GC, 4,75 %, 1 ^{er} juin 2040	6 511	6 395	
		4 743 401	4 337 811	32,7
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES				
58 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,1 %, 15 décembre 2026	54 200	52 340	
35 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,1 %, 15 mars 2031	33 397	28 846	
45 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,25 %, 15 juin 2026	43 203	41 178	
24 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,4 %, 15 mars 2031	23 036	20 257	
32 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,55 %, 15 décembre 2026	31 993	29 335	
76 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,75 %, 15 juin 2030	81 205	66 617	
48 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,8 %, 15 décembre 2024	46 457	45 912	
35 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,9 %, 15 septembre 2026	32 975	32 577	
96 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,95 %, 15 décembre 2025	90 900	90 325	
55 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,1 %, 15 septembre 2029	53 194	49 804	
59 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,35 %, 15 juin 2027	58 324	55 362	
16 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,35 %, 15 mars 2028	16 405	14 923	
35 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,55 %, 15 mars 2025	35 933	33 730	
72 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,65 %, 15 décembre 2028	76 268	67 563	
80 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,9 %, 15 juin 2024	80 562	78 389	
70 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 3,55 %, 15 septembre 2032	69 929	69 172	
10 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 3,6 %, 15 décembre 2027	9 995	9 851	
30 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 3,8 %, 15 juin 2027	30 275	29 722	
26 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	26 503	24 638	
35 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série 100, 1,9 %, 15 mars 2031	35 133	30 702	
29 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série 101, 1,6 %, 15 décembre 2031	28 884	24 566	
55 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série FEV., 2,65 %, 15 mars 2028	57 332	51 998	
60 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série MAR, 0,95 %, 15 juin 2025	55 579	55 837	
4 000	Société canadienne des postes, série 2, 4,08 %, 16 juillet 2025	4 481	3 951	
178 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	166 241	160 408	
245 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} septembre 2025	232 653	225 334	
2 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} décembre 2030	1 914	1 627	
73 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 ^{er} octobre 2024	71 241	69 462	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES (suite)				
131 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} septembre 2026	120 571	119 556	
77 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} juin 2027	74 444	69 541	
91 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	90 509	86 185	
89 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	84 458	81 121	
2 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} juin 2030	2 104	1 739	
84 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	83 835	80 819	
69 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} avril 2025	66 346	65 413	
71 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2026	71 138	66 087	
2 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	1 948	1 745	
1 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} décembre 2031	992	867	
1 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	937	932	
1 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2032	894	900	
68 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	70 160	65 268	
1 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	942	939	
71 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	69 466	69 462	
1 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} décembre 2032	963	937	
86 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} août 2024	84 966	84 021	
83 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	80 782	79 767	
84 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	82 713	82 025	
52 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	51 382	50 424	
53 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} avril 2026	52 097	51 356	
3 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 24 août 2027	2 992	2 940	
25 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} août 2025	24 677	24 525	
79 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} mars 2028	80 681	78 398	
79 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} février 2025	78 740	77 841	
79 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	78 870	77 861	
1 000	Gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2029	1 430	1 122	
10 000	Gouvernement du Canada, 8 %, 1 ^{er} juin 2027	14 386	11 549	
6 000	Gouvernement du Canada, 9 %, 1 ^{er} juin 2025	7 900	6 491	
15 000	Muskkrat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust, série A, 3,63 %, 1 ^{er} juin 2029	17 678	14 773	
6 000	Muskkrat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust, série C, 3,86 %, 1 ^{er} décembre 2048	8 185	5 844	
		2 955 398	2 824 874	21,3
OBLIGATIONS MUNICIPALES				
11 000	Ville de Montréal, 1,75 %, 1 ^{er} septembre 2030	11 233	9 379	
12 000	Ville de Montréal, 2 %, 1 ^{er} septembre 2031	11 786	10 220	
5 000	Ville de Montréal, 2,3 %, 1 ^{er} septembre 2029	5 378	4 502	
2 000	Ville de Montréal, 2,4 %, 1 ^{er} décembre 2041	1 896	1 500	
13 000	Ville de Montréal, 3 %, 1 ^{er} septembre 2027	13 095	12 385	
7 000	Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} décembre 2036	6 951	6 180	
4 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	4 145	3 929	
10 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2038	9 405	9 002	
3 000	Ville d'Ottawa, 2,5 %, 11 mai 2051	2 463	2 137	
5 000	Ville d'Ottawa, 3,1 %, 27 juillet 2048	4 930	4 050	
2 000	Ville de Toronto, 2,4 %, 7 juin 2027	1 878	1 870	
8 000	Ville de Toronto, 2,45 %, 6 février 2025	7 885	7 713	
5 000	Ville de Toronto, 2,6 %, 24 septembre 2039	4 035	3 965	
16 000	Ville de Toronto, 2,65 %, 9 novembre 2029	17 750	14 766	
4 000	Ville de Toronto, 2,8 %, 22 novembre 2049	4 294	3 029	
3 000	Ville de Toronto, 3,25 %, 24 juin 2046	2 538	2 505	
6 000	Ville de Toronto, 3,5 %, 2 juin 2036	7 219	5 531	
2 000	Ville de Toronto, 3,8 %, 13 décembre 2042	2 196	1 839	
5 000	Ville de Toronto, 4,3 %, 1 ^{er} juin 2052	5 061	5 010	
7 000	Ville de Toronto, 4,7 %, 10 juin 2041	8 731	7 243	
1 000	Ville de Vancouver, 3,7 %, 18 octobre 2052	1 269	904	
3 000	Ville de Winnipeg, 4,3 %, 15 novembre 2051	4 129	2 986	
4 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,1 %, 1 ^{er} juin 2025	4 063	3 735	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS MUNICIPALES (suite)				
13 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,3 %, 15 avril 2031	12 116	11 527	
14 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	13 731	13 278	
7 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,55 %, 9 octobre 2029	7 697	6 435	
5 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,95 %, 14 octobre 2024	5 301	4 872	
9 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,05 %, 23 octobre 2028	8 905	8 569	
2 000	Municipalité régionale de Peel, 2,5 %, 16 juin 2051	1 632	1 421	
3 000	Municipalité régionale de Peel, 5,1 %, 29 juin 2040	4 402	3 241	
6 000	Municipalité régionale d'York, 2,15 %, 22 juin 2031	6 037	5 239	
4 000	Municipalité régionale d'York, 2,35 %, 9 juin 2027	3 857	3 733	
4 000	Municipalité régionale d'York, 2,5 %, 2 juin 2026	4 346	3 787	
9 000	Municipalité régionale d'York, série F, 4 %, 31 mai 2032	11 171	8 978	
12 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 1,6 %, 3 juillet 2030	12 198	10 246	
		233 723	205 706	1,6
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES				
3 000	Asian Development Bank, 4,65 %, 16 février 2027	3 511	3 038	
3 000	Banque interaméricaine de développement, 0,75 %, 15 octobre 2025	3 009	2 747	
18 000	Banque interaméricaine de développement, 0,88 %, 27 août 2027	17 946	15 796	
9 000	Banque interaméricaine de développement, 1,7 %, 10 octobre 2024	9 368	8 627	
13 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,75 %, 2 juillet 2025	13 087	12 030	
12 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,88 %, 28 septembre 2027	12 072	10 506	
8 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,95 %, 20 septembre 2029	8 535	7 129	
		67 528	59 873	0,5
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		14 419 827	13 171 551	99,5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
Total du portefeuille de placements		14 419 827	13 171 551	99,5
Autres actifs (passifs) nets			70 082	0,5
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			13 241 633	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	308 163	1 638 163
Parts rachetables émises	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(1 180 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	308 163	458 163

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,180

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	4 952
Garanties (hors trésorerie)	-	5 213

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	5
Charges	-	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	1	3
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	29,6	39,6

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Obligations de sociétés	39,9
Obligations et garanties provinciales	30,5
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	23,3
Obligations étrangères	3,9
Obligations municipales	1,7
Autres actifs (passifs) nets	0,7
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	23,1
AA/Aa/A+	36,1
A	9,7
BBB/Baa/B++	28,8
BB/Ba/B+	1,0
B	0,6
C et moins	0,1
Total	99,4

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	25,2
AA/Aa/A+	14,7
A	31,5
BBB/Baa/B++	27,9
Total	99,3

* Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

** Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	294	2 864	2 117	7 897	13 172

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	97	2 456	1 677	8 738	12 968

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 245 000 \$ (238 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	13 172	-	13 172
Total	-	13 172	-	13 172

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	12 968	-	12 968
Total	-	12 968	-	12 968

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	47 129	40 334
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	24	95
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	6	6
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	290	236
Renonciation aux frais de consultation	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	14	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	2 254	-
	49 717	40 671
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	2 243	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	7	7
Comptes créditeurs et charges à payer	20	16
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	2 270	23
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	47 447	40 648

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
	Parts non couvertes	47 447	40 648	45,19	45,16	1 050 000

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

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	633	922
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(499)	(3 352)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	416	(2 407)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	550	(4 837)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	7
Rabais sur frais	34	67
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	36	74
Total des revenus	586	(4 763)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	39	74
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	10
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	1	2
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	44	87
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	542	(4 850)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie:		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part:		Nombre moyen pondéré de parts:	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Parts non couvertes	542	(4 850)	0,55	(2,76)	980 387	1 757 735

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

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	40 648	104 433
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	542	(4 850)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(577)	(695)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(577)	(695)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	6 834	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(46 308)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	6 834	(46 308)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 799	(51 853)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	47 447	52 580

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

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	542	(4 850)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	499	3 352
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	10
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(416)	2 407
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	17 710	27 003
Achat de placements et de dérivés	(17 820)	(26 894)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(54)	202
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(9)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	4	(2)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	468	1 219
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(577)	(695)
Produit de l'émission de parts rachetables	38	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(340)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(539)	(1 035)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(71)	184
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	95	70
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	24	254
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	579	1 124
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS				
93 000	407 International Inc., 1,8 %, 22 mai 2025	88 786	87 506	
31 000	407 International Inc., 2,43 %, 4 mai 2027	29 207	28 710	
23 000	407 International Inc., 4,22 %, 14 février 2028	22 491	22 431	
24 000	AIMCo Realty Investors LP, 2,2 %, 4 novembre 2026	24 033	21 818	
26 000	AIMCo Realty Investors LP, série 1, 2,27 %, 26 juin 2024	25 233	25 198	
19 000	AIMCo Realty Investors LP, série 3, 3,37 %, 1 ^{er} juin 2027	18 032	17 837	
60 000	Air Lease Corp., 2,63 %, 5 décembre 2024	60 736	57 016	
43 000	Alectra Inc., série A, 2,49 %, 17 mai 2027	40 589	39 614	
31 000	Algonquin Power Co., 4,09 %, 17 février 2027	30 817	29 375	
157 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	158 372	152 975	
122 000	Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	122 959	118 114	
35 000	FPI Allied Properties, série C, 3,64 %, 21 avril 2025	36 195	33 440	
22 000	FPI Allied Properties, série E, 3,11 %, 8 avril 2027	20 390	19 747	
17 000	FPI Allied Properties, série G, 3,13 %, 15 mai 2028	14 756	14 769	
112 000	FPI Allied Properties, série H, 1,73 %, 12 février 2026	102 342	100 046	
29 000	AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	25 191	25 048	
100 000	AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	95 567	93 701	
11 000	AltaGas Ltd., 2,17 %, 16 mars 2027	10 126	9 823	
53 000	AltaGas Ltd., 3,84 %, 15 janvier 2025	56 485	51 531	
17 000	AltaGas Ltd., 3,98 %, 4 octobre 2027	16 486	16 110	
64 000	AltaGas Ltd., 4,12 %, 7 avril 2026	64 139	61 792	
25 000	AltaLink LP, 2,75 %, 29 mai 2026	26 153	23 594	
32 000	AltaLink LP, 3,4 %, 6 juin 2024	31 682	31 436	
266 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	260 626	257 995	
80 000	ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	75 311	73 679	
33 000	Artis REIT, série E, restreint, 5,6 %, 29 avril 2025	32 954	31 611	
248 000	AT&T Inc., 4 %, 25 novembre 2025	247 116	239 712	
36 000	Athene Global Funding, 2,1 %, 24 septembre 2025	35 690	32 934	
74 000	AtlaGas Ltd., 4,64 %, 15 mai 2026	73 076	72 452	
55 000	Bank of America Corp., taux flottant, 24 mars 2026	56 070	52 936	
51 000	Bank of America Corp., taux variable, 20 septembre 2025	49 883	49 519	
53 000	Bank of America Corp., taux variable, 15 septembre 2027	52 185	47 497	
98 000	Bank of America Corp., taux variable, 16 mars 2028	96 105	91 736	
32 000	Bank of America Corp., taux variable, 4 avril 2029	29 001	28 277	
127 000	Banque de Montréal, 1,55 %, 28 mai 2026	116 270	114 368	
79 000	Banque de Montréal, 1,76 %, 10 mars 2026	76 194	72 076	
186 000	Banque de Montréal, 2,28 %, 29 juillet 2024	180 733	179 687	
155 000	Banque de Montréal, 2,37 %, 17 janvier 2025	148 402	147 373	
183 000	Banque de Montréal, 2,7 %, 11 septembre 2024	179 239	177 454	
46 000	Banque de Montréal, 2,7 %, 9 décembre 2026	47 270	42 823	
131 000	Banque de Montréal, 3,19 %, 1 ^{er} mars 2028	124 428	122 530	
104 000	Banque de Montréal, 3,65 %, 1 ^{er} avril 2027	101 526	98 432	
138 000	Banque de Montréal, 4,31 %, 1 ^{er} juin 2027	135 025	133 612	
68 000	Banque de Montréal, 4,61 %, 10 septembre 2025	73 627	67 176	
130 000	Banque de Montréal, 4,71 %, 7 décembre 2027	128 309	127 494	
108 000	Banque de Montréal, 5,04 %, 29 mai 2028	107 984	107 412	
180 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 septembre 2029	179 715	173 356	
229 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	216 119	212 800	
62 000	Banque de Montréal, taux variable, 22 juillet 2031	59 192	55 098	
49 000	Banque de Montréal, taux variable, 27 octobre 2032	50 642	50 421	
82 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,4 %, 1 ^{er} novembre 2027	70 280	70 249	
135 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,85 %, 2 novembre 2026	131 537	121 314	
213 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janvier 2025	202 262	201 683	
202 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	194 070	191 420	
145 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,29 %, 28 juin 2024	141 942	140 790	
141 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,49 %, 23 septembre 2024	135 439	135 842	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
75 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,62 %, 2 décembre 2026	77 191	69 685	
184 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,95 %, 8 mars 2027	176 158	170 207	
84 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 3,1 %, 2 février 2028	78 511	78 353	
152 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 5,5 %, 8 mai 2026	154 320	152 516	
42 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 8,9 %, 20 juin 2025	46 548	44 297	
280 000	Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 3 juillet 2029	271 563	271 360	
81 000	Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 3 mai 2032	77 321	75 711	
18 000	Barclays PLC, taux variable, 23 juin 2027	16 305	16 038	
24 000	BCI QuadReal Realty, 1,07 %, 4 février 2026	23 406	21 537	
17 000	BCI QuadReal Realty, série 1, 1,68 %, 3 mars 2025	17 430	15 967	
26 000	BCI QuadReal Realty, série 5, 2,55 %, 24 juin 2026	25 075	24 142	
40 000	bclMC Realty Corp., 2,84 %, 3 juin 2025	41 384	38 112	
47 000	Bell Canada, 1,65 %, 16 août 2027	40 779	41 193	
29 000	Bell Canada, 2,2 %, 29 mai 2028	25 674	25 546	
109 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	110 352	104 504	
43 000	Bell Canada, 2,9 %, 12 août 2026	43 019	40 230	
302 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	307 047	291 690	
137 000	Bell Canada, 3,55 %, 2 mars 2026	137 087	131 004	
63 000	Bell Canada, 3,6 %, 29 septembre 2027	60 625	59 477	
17 000	BMW Canada Inc., 4,41 %, 10 février 2027	16 845	16 652	
24 000	BMW Canada Inc., série X, 0,99 %, 14 janvier 2025	23 028	22 447	
20 000	BMW Canada Inc., série Y, 4,76 %, 10 février 2025	19 925	19 778	
34 000	BP Capital Markets PLC, 3,47 %, 15 mai 2025	36 346	32 892	
26 000	Brookfield Asset Management Inc., 3,8 %, 16 mars 2027	25 703	24 575	
88 000	Brookfield Asset Management Inc., 4,82 %, 28 janvier 2026	93 560	86 252	
39 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,62 %, 14 novembre 2027	40 244	39 209	
43 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,63 %, 15 janvier 2027	43 237	40 537	
86 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,75 %, 2 juin 2025	88 484	83 071	
53 000	Bruce Power LP, 3,97 %, 23 juin 2026	53 722	51 196	
11 000	Bruce Power LP, 4,7 %, 21 décembre 2027	11 025	10 825	
59 000	Bruce Power LP, série 17-1, 3 %, 21 juin 2024	61 155	57 588	
92 000	Cameco Corp., 4,19 %, 24 juin 2024	96 263	90 445	
56 000	Corporation Cameco, série H, 2,95 %, 21 octobre 2027	51 317	50 743	
17 000	Canadian Core Real Estate LP, série 1, 3,3 %, 2 mars 2027	16 575	15 490	
131 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,1 %, 19 janvier 2026	123 831	117 792	
72 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,7 %, 15 juillet 2026	70 931	64 837	
210 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2 %, 17 avril 2025	198 585	197 262	
92 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	87 861	83 230	
158 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	151 946	152 260	
313 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,75 %, 7 mars 2025	301 191	298 760	
184 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,3 %, 26 mai 2025	186 641	177 642	
118 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,95 %, 29 juin 2027	120 186	116 800	
91 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,05 %, 7 octobre 2027	90 444	90 352	
275 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 19 juin 2029	283 765	267 134	
183 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 juillet 2030	174 939	169 288	
183 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 avril 2031	169 376	164 193	
59 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 7 avril 2032	57 237	55 744	
59 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 20 janvier 2033	59 525	57 832	
44 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 20 avril 2033	44 425	43 207	
87 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,8 %, 22 septembre 2025	86 342	82 871	
17 000	Canadian Natural Resources Ltd., 2,5 %, 17 janvier 2028	15 638	15 258	
35 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,42 %, 1 ^{er} décembre 2026	35 892	33 142	
90 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,55 %, 3 juin 2024	91 899	88 415	
95 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 2,54 %, 28 février 2028	87 682	86 020	
9 000	La Société Canadian Tire Limitée, 6,5 %, 13 avril 2028	9 703	9 444	
26 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 1,82 %, 16 décembre 2027	22 147	22 082	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
53 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 1,93 %, 16 avril 2026	50 537	47 728	
55 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 2,6 %, 6 septembre 2024	52 911	52 817	
47 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 2,61 %, 30 janvier 2025	46 426	44 551	
48 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 3,86 %, 21 avril 2025	46 643	46 195	
23 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 5,15 %, 2 septembre 2027	22 877	22 555	
48 000	Banque Canadienne de l'Ouest, série F, taux variable, 11 juin 2029	48 727	46 711	
8 000	Banque Canadienne de l'Ouest, taux variable, 22 décembre 2032	8 070	7 753	
84 000	Capital Power Corp., 4,28 %, 18 septembre 2024	87 272	82 243	
66 000	Capital Power Corp., 4,99 %, 23 janvier 2026	68 113	64 593	
36 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	34 505	33 719	
73 000	Cenovus Energy Inc., 3,5 %, 7 février 2028	69 180	68 486	
44 000	Cenovus Energy Inc., 3,6 %, 10 mars 2027	43 087	41 872	
16 000	Central 1 Credit Union, 1,32 %, 29 janvier 2026	15 659	14 241	
17 000	Central 1 Credit Union, 4,65 %, 7 février 2028	16 599	16 185	
32 000	Central 1 Credit Union, 5,42 %, 29 septembre 2025	31 846	31 588	
10 000	Central 1 Credit Union, taux variable, 30 juin 2031	9 887	8 772	
25 000	Chartwell, résidences pour retraités, série B, 4,21 %, 28 avril 2025	25 772	23 869	
19 000	CHIP Mortgage Trust, 1,74 %, 15 décembre 2045	18 993	17 067	
40 000	FPI Propriétés de Choix, série F, 4,06 %, 24 novembre 2025	40 054	38 655	
62 000	FPI Propriétés de Choix, série J, 3,55 %, 10 janvier 2025	65 644	59 990	
105 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	109 964	102 332	
44 000	FPI Propriétés de Choix, série L, 4,18 %, 8 mars 2028	42 432	41 778	
30 000	FPI Propriétés de Choix, série P, 2,85 %, 21 mai 2027	27 849	27 393	
24 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	22 735	21 841	
76 000	CI Financial Corp., 7 %, 2 décembre 2025	77 051	75 913	
113 000	Citigroup Inc., 4,09 %, 9 juin 2025	114 769	109 071	
35 000	Coast Capital Savings Federal Credit Union, 4,26 %, 21 avril 2025	34 122	33 511	
35 000	Coast Capital Savings Federal Credit Union, 6,13 %, 25 novembre 2024	35 298	34 629	
11 000	CPPIB Capital Inc., 0,75 %, 15 juin 2024	10 552	10 567	
11 000	CPPIB Capital Inc., 3,95 %, 8 septembre 2025	10 912	10 831	
45 000	FPI Crombie, série E, 4,8 %, 31 janvier 2025	47 459	43 994	
7 000	FPI Crombie, série F, 3,68 %, 26 août 2026	7 452	6 567	
5 000	FPI Crombie, série G, 3,92 %, 21 juin 2027	4 714	4 674	
9 000	FPI Crombie, série H, 2,69 %, 31 mars 2028	8 032	7 866	
31 000	FPI CT, série B, 3,53 %, 9 juin 2025	30 030	29 639	
22 000	FPI CT, série D, 3,29 %, 1 ^{er} juin 2026	21 548	20 573	
7 000	FPI CT, série E, 3,47 %, 16 juin 2027	6 508	6 471	
10 000	FPI CT, série F, 3,87 %, 7 décembre 2027	9 329	9 303	
46 000	Daimler Canada Finance Inc., 1,65 %, 22 septembre 2025	44 970	42 540	
147 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	145 789	139 552	
24 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,46 %, 15 décembre 2026	23 189	21 737	
113 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 5,18 %, 19 septembre 2025	112 353	111 709	
13 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 5,22 %, 20 septembre 2027	12 945	12 904	
18 000	Dollarama Inc., 1,51 %, 20 septembre 2027	15 568	15 622	
37 000	Dollarama Inc., 1,87 %, 8 juillet 2026	34 702	33 664	
44 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	44 058	43 729	
12 000	FPI industriel Dream, 5,38 %, 22 mars 2028	12 035	11 790	
82 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	75 187	74 074	
26 000	FPI industriel Dream, série C, 2,06 %, 17 juin 2027	22 552	22 674	
19 000	FPI industriel Dream, série D, restreint, 2,54 %, 7 décembre 2026	17 344	17 082	
37 000	FPI industriel Dream, série E, restreint, 3,97 %, 13 avril 2026	35 720	35 164	
45 000	Dream Summit Industrial LP, série A, 2,15 %, 17 septembre 2025	41 622	41 462	
37 000	Dream Summit Industrial LP, série B, 1,82 %, 1 ^{er} avril 2026	33 460	33 154	
19 000	Dream Summit Industrial LP, série C, 2,25 %, 12 janvier 2027	17 024	16 894	
13 000	L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, taux variable, restreint, 24 septembre 2031	12 935	11 515	
15 000	Enbridge Gas Inc., 2,5 %, 5 août 2026	15 560	13 964	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
13 000	Enbridge Gas Inc., 2,88 %, 22 novembre 2027	12 239	12 059	
22 000	Enbridge Gas Inc., 3,15 %, 22 août 2024	21 466	21 435	
42 000	Enbridge Gas Inc., 3,31 %, 11 septembre 2025	43 773	40 323	
103 000	Enbridge Inc., 2,44 %, 2 juin 2025	101 157	97 397	
70 000	Enbridge Inc., 3,2 %, 8 juin 2027	66 086	65 237	
87 000	Enbridge Inc., 3,95 %, 19 novembre 2024	91 869	85 039	
34 000	Enbridge Inc., 4,9 %, 26 mai 2028	33 907	33 707	
35 000	Enbridge Inc., 5,7 %, 9 novembre 2027	36 240	35 663	
26 000	Pipelines Enbridge Inc., 3 %, 10 août 2026	26 022	24 416	
114 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,45 %, 29 septembre 2025	111 675	109 357	
16 000	Energir Inc., série V, 2,1 %, 16 avril 2027	14 841	14 545	
2 000	ENMAX Corp., série 6, 3,33 %, 2 juin 2025	2 079	1 906	
45 000	Banque Équitable, 1,88 %, 26 novembre 2025	41 487	40 529	
45 000	Banque Équitable, 1,94 %, 10 mars 2025	43 072	41 786	
45 000	Banque Équitable, 3,36 %, 2 mars 2026	42 384	41 790	
10 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,7 %, 16 décembre 2026	10 899	9 626	
21 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	23 474	20 614	
128 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 1,09 %, 21 janvier 2026	118 990	115 050	
26 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 1,59 %, 10 septembre 2026	24 298	23 288	
90 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 2,42 %, 4 octobre 2024	88 050	86 526	
62 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 4,41 %, 19 mai 2027	62 121	60 207	
105 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,2 %, 1 ^{er} octobre 2025	105 423	104 373	
105 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, taux flottant, 26 mai 2030	104 756	99 091	
55 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, taux variable, 28 mai 2031	53 944	49 143	
59 000	Fédération des Caisses Desjardins du Québec, taux variable, 23 août 2022	57 837	57 278	
61 000	Finning International Inc., 2,63 %, 14 août 2026	58 075	56 457	
20 000	Finning International Inc., 4,45 %, 16 mai 2028	19 612	19 482	
44 000	First Capital Realty Inc., série T, 3,6 %, 6 mai 2026	42 041	41 088	
12 000	FPI First Capital, 3,45 %, 1 ^{er} mars 2028	10 788	10 587	
49 000	FPI First Capital, série R, 4,79 %, 30 août 2024	52 429	48 008	
56 000	FPI First Capital, série S, 4,32 %, 31 juillet 2025	56 960	53 846	
16 000	FPI First Capital, série U, 3,75 %, 12 juillet 2027	14 416	14 554	
36 000	FPI First Capital, série V, 3,46 %, 22 janvier 2027	33 819	32 696	
39 000	First National Financial Corp., série 2, 3,58 %, 25 novembre 2024	40 495	37 295	
12 000	First National Financial Corp., série 3, 2,96 %, 17 novembre 2025	12 126	10 999	
29 000	Fortis Inc., 2,18 %, 15 mai 2028	25 836	25 707	
12 000	FortisAlberta Inc., 3,3 %, 30 septembre 2024	11 663	11 662	
12 000	FortisBC Energy Inc., 2,58 %, 8 avril 2026	12 480	11 270	
75 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,7 %, 9 juillet 2025	70 925	68 992	
91 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,75 %, 15 avril 2026	83 392	81 612	
29 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 3,15 %, 8 février 2027	27 531	26 556	
30 000	La Financière General Motors du Canada Ltée, 5,2 %, 9 février 2028	29 789	29 247	
40 000	Genworth MI Canada Inc., 2,96 %, 1 ^{er} mars 2027	36 776	35 487	
50 000	George Weston Limitée, 4,12 %, 17 juin 2024	51 316	49 226	
60 000	Gibson Energy Inc., 2,45 %, 14 juillet 2025	58 093	56 248	
20 000	Gibson Energy Inc., 2,85 %, 14 juillet 2027	18 543	18 178	
67 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 31 octobre 2025	66 104	64 732	
61 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 30 novembre 2027	60 145	55 329	
50 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 28 février 2029	43 775	42 971	
31 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	28 569	28 430	
27 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 20-1, 1,54 %, 3 mai 2028	23 728	23 639	
26 000	Great-West Lifeco Inc., 3,34 %, 28 février 2028	24 695	24 280	
99 000	FPI H&R, série Q, 4,07 %, 16 juin 2025	99 562	94 835	
11 000	FPI H&R, série R, 2,91 %, 2 juin 2026	11 135	10 042	
8 000	FPI H&R, série S, 2,63 %, 19 février 2027	7 689	7 091	
13 000	HCN Canadian Holdings-1 LP, 2,95 %, 15 janvier 2027	12 507	11 751	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
53 000	Heathrow Funding Ltd., catégorie A-34, 3,25 %, 21 mai 2027	55 294	50 686	
35 000	Home Trust Co., 5,32 %, 13 juin 2024	34 953	34 495	
56 000	Honda Canada Finance Inc., 1,34 %, 17 mars 2026	53 342	50 480	
32 000	Honda Canada Finance Inc., 1,65 %, 25 février 2028	27 835	27 631	
20 000	Honda Canada Finance Inc. 1,71 %, 28 septembre 2026	19 730	17 985	
45 000	Honda Canada Finance Inc., 2,5 %, 4 juin 2024	44 103	43 817	
54 000	Honda Canada Finance Inc., 3,44 %, 23 mai 2025	57 251	52 114	
26 000	Honda Canada Finance Inc., 4,87 %, 23 septembre 2027	26 100	25 763	
127 000	Banque HSBC Canada, 1,78 %, 20 mai 2026	119 111	115 481	
158 000	Banque HSBC Canada, 3,4 %, 24 mars 2025	154 261	152 553	
93 000	Banque HSBC Canada, 4,81 %, 16 décembre 2024	92 650	91 962	
60 000	Hydro One Inc., 1,76 %, 28 février 2025	57 345	56 830	
52 000	Hydro One Inc., 2,77 %, 24 février 2026	53 097	49 299	
36 000	Hydro One Inc., 2,97 %, 26 juin 2025	34 942	34 594	
40 000	Hydro One Inc., 4,91 %, 27 janvier 2028	41 548	40 367	
40 000	Hydro One Ltd., 1,41 %, 15 octobre 2027	35 097	34 973	
54 000	Hyundai Capital Canada Inc., 3,2 %, 16 février 2027	51 035	49 684	
54 000	Hyundai Capital Canada Inc., 5,57 %, 8 mars 2028	55 017	53 632	
54 000	Hyundai Capital Canada Inc., série A, 2,01 %, 12 mai 2026	50 130	48 781	
37 000	iA Société financière Inc., taux variable, 21 février 2030	36 603	34 949	
18 000	iA Société financière Inc., taux variable, 24 septembre 2031	18 766	16 608	
38 000	iA Société financière Inc., taux variable, 25 février 2032	36 239	34 864	
21 000	Société financière IGM Inc., 3,44 %, 26 janvier 2027	21 185	19 710	
20 000	Intact Corporation financière, 2,18 %, 18 mai 2028	17 729	17 656	
25 000	Intact Corporation financière, 2,85 %, 7 juin 2027	23 042	23 098	
20 000	Intact Corporation financière, 3,69 %, 24 mars 2025	21 198	19 423	
46 000	Intact Corporation financière, 3,77 %, 2 mars 2026	46 998	44 286	
59 000	Inter Pipeline Ltd., 3,17 %, 24 mars 2025	60 373	56 459	
30 000	Inter Pipeline Ltd., 3,48 %, 16 décembre 2026	29 082	27 997	
44 000	Inter Pipeline Ltd., 4,23 %, 1 ^{er} juin 2027	42 128	41 934	
44 000	Inter Pipeline Ltd., 5,76 %, 17 février 2028	44 881	44 205	
15 000	Ivanhoe Cambridge II Inc., série 2, 2,3 %, 12 décembre 2024	14 477	14 314	
32 000	John Deere Financial Inc., 1,09 %, 17 juillet 2024	30 337	30 625	
45 000	John Deere Financial Inc., 1,34 %, 8 septembre 2027	39 369	39 026	
31 000	John Deere Financial Inc., 1,63 %, 9 avril 2026	29 737	28 284	
46 000	John Deere Financial Inc., 2,31 %, 20 juin 2025	46 023	43 525	
15 000	John Deere Financial Inc., 2,4 %, 17 septembre 2024	14 342	14 480	
43 000	John Deere Financial Inc., 2,41 %, 14 janvier 2025	43 219	41 138	
21 000	John Deere Financial Inc., 2,58 %, 16 octobre 2026	21 469	19 519	
65 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	59 553	57 221	
65 000	Banque Laurentienne du Canada, 1,15 %, 3 juin 2024	63 438	62 250	
77 000	Banque Laurentienne du Canada, 1,95 %, 17 mars 2025	74 261	71 987	
72 000	Banque Laurentienne du Canada, 4,6 %, 2 septembre 2025	70 971	69 973	
18 000	Lloyds Banking Group PLC, 3,5 %, 3 février 2025	17 718	17 212	
86 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	88 818	84 791	
23 000	Lower Mattagami Energy LP, série 2016-1, 2,31 %, 21 octobre 2026	23 378	21 208	
49 000	Banque Manuvie du Canada, 1,34 %, 26 février 2026	45 863	44 206	
54 000	Banque Manuvie du Canada, 1,5 %, 25 juin 2025	52 868	50 037	
26 000	Banque Manuvie du Canada, 1,54 %, 14 septembre 2026	25 554	23 221	
50 000	Banque Manuvie du Canada, 2,38 %, 19 novembre 2024	47 971	47 834	
38 000	Banque Manuvie du Canada, 2,86 %, 16 février 2027	37 658	35 084	
98 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 20 août 2029	95 028	94 909	
105 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 12 mai 2030	103 223	98 551	
63 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 10 mars 2033	63 482	62 502	
193 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	197 047	186 390	
49 000	Metro Inc., 3,39 %, 6 décembre 2027	46 802	46 049	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
70 000	Metro Inc., série J, 1,92 %, 2 décembre 2024	69 074	66 607	
43 000	Molson Coors International LP, 3,44 %, 15 juillet 2026	42 131	40 494	
123 000	Mondeléz International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	126 029	118 466	
52 000	Morgan Stanley, taux variable, 4 août 2027	51 387	46 398	
141 000	National Australia Bank Ltd., taux variable, 12 juin 2030	142 597	132 291	
45 000	Banque Nationale du Canada, 1,53 %, 15 juin 2026	42 360	40 483	
52 000	Banque Nationale du Canada, 2,24 %, 4 novembre 2026	50 427	47 268	
172 000	Banque Nationale du Canada, 2,55 %, 12 juillet 2024	165 668	166 742	
158 000	Banque Nationale du Canada, 2,58 %, 3 février 2025	152 284	150 729	
105 000	Banque Nationale du Canada, 5,3 %, 3 novembre 2025	105 841	104 608	
73 000	Banque nationale du Canada, taux variable, 18 août 2026	71 221	67 267	
44 000	Banque Nationale du Canada, taux variable, 16 août 2032	44 040	43 315	
53 000	NAV Canada, série 21-1, 0,94 %, 9 février 2026	49 630	47 967	
103 000	Nissan Canada Inc., 2,1 %, 22 septembre 2025	96 048	93 694	
53 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., 3,2 %, 24 avril 2026	53 341	50 345	
53 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série A, 3,2 %, 22 juillet 2024	53 435	51 678	
39 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série J, 2,8 %, 1 ^{er} juin 2027	36 171	36 057	
36 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série M, 2 %, 1 ^{er} décembre 2026	35 619	32 602	
34 000	OMERS Realty Corp., 3,33 %, 12 novembre 2024	33 471	32 987	
53 000	OMERS Realty Corp., série 9, 3,24 %, 4 octobre 2027	49 419	49 193	
60 000	OMERS Realty Corp., série 10, 3,33 %, 5 juin 2025	60 196	57 731	
64 000	Ontario Electricity Financial Corp., 8,25 %, 22 juin 2026	82 162	70 576	
2 000	Ontario Electricity Financial Corp., 8,5 %, 26 mai 2025	2 695	2 130	
2 000	Ontario Electricity Financial Corp., 9 %, 26 mai 2025	2 510	2 148	
6 000	Ontario Power Generation Inc., 1,17 %, 22 avril 2026	5 864	5 385	
2 000	Ontario Power Generation Inc., 2,89 %, 8 avril 2025	2 077	1 920	
32 000	Ontario Power Generation Inc., 3,32 %, 4 octobre 2027	30 031	30 157	
36 000	Pembina Pipeline Corp., 3,71 %, 11 août 2026	36 868	34 335	
33 000	Pembina Pipeline Corp., 4,24 %, 15 juin 2027	32 349	31 839	
86 000	Pembina Pipeline Corp., série 5, 3,54 %, 3 février 2025	90 059	83 264	
39 000	Pembina Pipeline Corp., série 10, 4,02 %, 27 mars 2028	37 699	36 919	
8 000	Primaris REIT, 4,73 %, 30 mars 2027	8 071	7 550	
15 000	FPI Primaris, 5,93 %, 29 mars 2028	15 020	14 771	
34 000	Primaris REIT, restreint, 4,27 %, 30 mars 2025	34 200	32 648	
96 000	PSP Capital Inc., 0,9 %, 15 juin 2026	94 217	86 723	
57 000	PSP Capital Inc., 1,5 %, 15 mars 2028	51 881	50 835	
19 000	PSP Capital Inc., série 11, 3 %, 5 novembre 2025	19 332	18 301	
25 000	Reliance LP, 2,68 %, 1 ^{er} décembre 2027	22 149	22 136	
72 000	Reliance LP, 3,75 %, 15 mars 2026	70 533	68 372	
73 000	Reliance LP, 3,84 %, 15 mars 2025	76 827	70 481	
93 000	FPI RioCan, série AB, 2,58 %, 12 février 2025	92 481	88 003	
19 000	FPI RioCan, série AC, 2,36 %, 10 mars 2027	17 310	16 760	
55 000	FPI RioCan, série AD, 1,97 %, 15 juin 2026	51 069	49 231	
108 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	103 597	101 498	
18 000	Rogers Communications Inc., 3,8 %, 1 ^{er} mars 2027	17 646	17 023	
236 000	Rogers Communications Inc., restreint, 3,1 %, 15 avril 2025	229 749	225 715	
127 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	121 515	114 735	
156 000	Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 ^{er} mai 2025	149 368	146 386	
119 000	Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28 janvier 2027	113 188	107 960	
210 000	Banque Royale du Canada, 2,35 %, 2 juillet 2024	203 997	203 519	
260 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	250 708	250 031	
314 000	Banque Royale du Canada, 3,37 %, 24 mars 2025	304 008	300 251	
105 000	Banque Royale du Canada, 4,61 %, 26 juillet 2027	106 767	102 888	
135 000	Banque Royale du Canada, 4,63 %, 1 ^{er} mai 2028	132 704	132 032	
102 000	Banque Royale du Canada, 4,64 %, 17 janvier 2028	102 940	99 843	
84 000	Banque Royale du Canada, 4,93 %, 16 juillet 2025	87 334	83 591	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
108 000	Banque Royale du Canada, 5,24 %, 2 novembre 2026	108 051	107 987	
151 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 25 juillet 2029	146 611	145 949	
149 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 23 décembre 2029	143 914	142 432	
131 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 30 juin 2030	128 905	121 714	
93 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 novembre 2031	90 655	82 681	
45 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 mai 2032	40 933	40 560	
53 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 28 janvier 2033	45 393	44 395	
83 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 1 ^{er} février 2033	81 621	80 531	
11 000	Sagen MI Canada Inc., 5,91 %, 19 mai 2028	10 915	10 806	
23 000	Saputo Inc., 1,42 %, 19 juin 2026	21 028	20 615	
51 000	Saputo Inc., 2,24 %, 16 juin 2027	45 941	45 869	
81 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	83 267	78 114	
57 000	Saputo Inc., 3,6 %, 14 août 2025	56 747	54 886	
27 000	Sienna Senior Living Inc., série A, 3,11 %, 4 novembre 2024	27 579	25 771	
32 000	Sienna Senior Living Inc., série B, 3,45 %, 27 février 2026	30 840	29 653	
25 000	SmartCentres REIT, série N, 3,56 %, 6 février 2025	26 413	24 042	
20 000	SmartCentres REIT, série P, 3,44 %, 28 août 2026	19 885	18 602	
20 000	SmartCentres REIT, série S, 3,83 %, 21 décembre 2027	18 402	18 421	
20 000	SmartCentres REIT, série V, 3,19 %, 11 juin 2027	18 263	18 157	
64 000	SmartCentres REIT, série X, 1,74 %, 16 décembre 2025	59 629	57 841	
70 000	Financière Sun Life Inc., taux flottant, 13 août 2029	68 084	67 335	
40 000	Financière Sun Life Inc., taux variable, 18 novembre 2031	38 264	36 189	
62 000	Financière Sun Life Inc., taux variable, 10 mai 2032	56 802	55 839	
105 000	Sysco Canada Inc., 3,65 %, 25 avril 2025	106 143	101 558	
35 000	TELUS Corp., 2,35 %, 27 janvier 2028	31 800	31 146	
85 000	TELUS Corp., 3,63 %, 1 ^{er} mars 2028	80 885	79 859	
139 000	TELUS Corp., 3,75 %, 17 janvier 2025	145 893	135 424	
110 000	TELUS Corp., 3,75 %, 10 mars 2026	109 347	105 651	
57 000	TELUS Corp., série CZ, 2,75 %, 8 juillet 2026	56 363	53 187	
48 000	Teranet Holdings LP, série 20, 3,54 %, 11 juin 2025	51 136	45 863	
305 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	297 678	287 797	
31 000	Groupe TMX Limitée, série D, 3 %, 11 décembre 2024	30 199	29 953	
13 000	Toronto Hydro Corp. série 12, 2,52 %, 25 août 2026	13 592	12 141	
184 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,13 %, 9 décembre 2025	173 511	166 387	
79 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,89 %, 8 mars 2028	69 677	68 663	
184 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,94 %, 13 mars 2025	174 837	173 365	
89 000	Banque Toronto Dominion (La), 2,26 %, 7 janvier 2027	84 173	80 646	
184 000	Banque Toronto-Dominion (La), 2,5 %, 2 décembre 2024	177 821	176 227	
368 000	Banque Toronto Dominion (La), 2,67 %, 6 avril 2033	349 118	347 039	
209 000	Banque Toronto-Dominion (La), 3,23 %, 24 juillet 2024	207 902	204 431	
144 000	Banque Toronto-Dominion (La), 4,21 %, 1 ^{er} juin 2027	140 416	139 097	
158 000	Banque Toronto Dominion (La), 4,34 %, 27 janvier 2026	158 396	154 138	
102 000	Banque Toronto Dominion (La), 4,48 %, 18 janvier 2028	102 177	99 191	
105 000	Banque Toronto-Dominion (La), 5,38 %, 21 octobre 2027	105 558	105 788	
20 000	Banque Toronto-Dominion (La), 9,15 %, 26 mai 2025	22 703	21 175	
107 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux flottant, 26 janvier 2032	107 007	97 699	
143 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 25 juillet 2029	141 222	138 897	
315 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	307 069	299 682	
132 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 4 mars 2031	138 874	129 013	
13 000	Tourmaline Oil Corp., série 1, 2,08 %, 25 janvier 2028	11 536	11 373	
42 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,18 %, 23 février 2026	39 622	37 941	
21 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,27 %, 22 juillet 2024	19 932	20 128	
18 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,66 %, 20 juillet 2026	17 924	16 286	
58 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,11 %, 26 février 2025	56 820	55 061	
104 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,31 %, 23 octobre 2024	100 367	99 866	
68 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,73 %, 25 août 2025	66 684	64 549	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
13 000	Toyota Credit Canada Inc., 4,33 %, 24 janvier 2028	13 011	12 642	
31 000	Toyota Credit Canada Inc., 4,45 %, 26 janvier 2026	31 024	30 436	
142 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,3 %, 17 juillet 2025	141 637	136 087	
39 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	36 873	36 119	
120 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,8 %, 5 avril 2027	116 514	114 265	
98 000	TransCanada Pipelines Ltd., 4,35 %, 12 mai 2026	96 886	95 466	
110 000	TransCanada Pipelines Ltd., 5,42 %, 10 mars 2026	110 350	109 260	
10 000	TransCanada Pipelines Ltd., 7,9 %, 15 avril 2027	11 000	10 728	
17 000	TransCanada Pipelines Ltd., 8,29 %, 5 février 2026	20 521	17 970	
14 000	Transcontinental Inc., 2,28 %, 13 juillet 2026	14 185	12 594	
46 000	TriSummit Utilities Inc., 3,15 %, 6 avril 2026	44 247	43 250	
110 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	106 011	106 280	
17 000	Union Gas Ltd., 2,81 %, 1 ^{er} juin 2026	17 763	16 015	
14 000	Union Gas Ltd., 3,19 %, 17 septembre 2025	15 052	13 403	
11 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série B, taux échelonné, 7 décembre 2026	13 810	11 812	
35 000	Ventas Canada Finance Ltd., 5,4 %, 21 avril 2028	35 296	34 628	
27 000	Ventas Canada Finance Ltd., série G, 2,45 %, 4 janvier 2027	25 678	24 219	
59 000	Verizon Communications Inc., 2,38 %, 22 mars 2028	53 702	52 466	
53 000	Crédit VW Canada Inc., 1,5 %, 23 septembre 2025	50 943	48 479	
50 000	Crédit VW Canada Inc., 2,05 %, 10 décembre 2024	49 158	47 427	
30 000	Crédit VW Canada Inc., 2,45 %, 10 décembre 2026	30 298	27 245	
52 000	Crédit VW Canada Inc., 2,85 %, 26 septembre 2024	50 158	50 178	
63 000	Crédit VW Canada Inc., 5,8 %, 17 novembre 2025	63 752	63 218	
10 000	Crédit VW Canada Inc., 5,86 %, 15 novembre 2027	10 249	10 170	
69 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	67 338	64 101	
30 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	28 155	27 645	
105 000	Wells Fargo & Co., 2,49 %, 18 février 2027	100 057	94 728	
45 000	Wells Fargo & Co., 2,98 %, 19 mai 2026	46 863	41 876	
88 000	Wells Fargo & Co., 3,87 %, 21 mai 2025	88 091	84 650	
75 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 28 avril 2026	74 461	72 713	
90 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 ^{er} mai 2026	86 847	84 719	
65 000	Westcoast Energy Inc., 3,43 %, 12 septembre 2024	64 925	63 306	
109 000	Westcoast Energy Inc., 3,77 %, 8 décembre 2025	106 127	104 771	
21 000	Westcoast Energy Inc., 8,85 %, 21 juillet 2025	23 339	22 064	
		28 481 903	27 574 748	58,1
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES				
345 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,1 %, 15 décembre 2026	322 145	311 333	
654 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,25 %, 15 juin 2026	621 457	598 460	
474 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,55 %, 15 décembre 2026	461 021	434 524	
226 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,8 %, 15 décembre 2024	218 655	216 171	
480 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,9 %, 15 septembre 2026	485 437	446 775	
268 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,95 %, 15 décembre 2025	256 603	252 155	
690 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,35 %, 15 juin 2027	655 881	647 455	
141 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,35 %, 15 mars 2028	134 794	131 506	
112 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,55 %, 15 mars 2025	109 594	107 935	
470 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 2,9 %, 15 juin 2024	465 610	460 534	
697 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 3,6 %, 15 décembre 2027	699 430	686 584	
282 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 3,8 %, 15 juin 2027	285 309	279 384	
79 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	77 566	74 861	
239 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série FEV., 2,65 %, 15 mars 2028	231 725	225 957	
248 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, série MAR, 0,95 %, 15 juin 2025	236 462	230 793	
823 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	752 382	741 659	
1 254 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} septembre 2025	1 179 755	1 153 335	
339 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 ^{er} octobre 2024	331 700	322 572	
499 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	482 225	472 596	
474 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	470 921	456 052	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES (suite)				
301 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} avril 2025	289 282	285 354	
317 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	325 841	304 264	
402 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	404 159	393 294	
484 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} août 2024	477 468	472 863	
477 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} novembre 2024	468 986	465 787	
418 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} octobre 2025	408 867	405 328	
242 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 ^{er} avril 2026	238 325	234 493	
435 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} août 2025	426 941	426 740	
443 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} février 2025	441 105	436 503	
542 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	538 936	534 185	
43 000	Gouvernement du Canada, 9 %, 1 ^{er} juin 2025	55 532	46 520	
		12 554 114	12 255 972	25,8
OBLIGATIONS PROVINCIALES				
1 000	Alberta Capital Finance Authority, 4,45 %, 15 décembre 2025	1 111	993	
5 000	Hydro Terre-Neuve-et-Labrador, série Y, 8,4 %, 27 février 2026	6 537	5 466	
2 000	OPB Finance Trust, série E, 2,95 %, 2 février 2026	2 120	1 910	
49 000	OPB Finance Trust, série F, 2,98 %, 25 janvier 2027	50 278	46 483	
238 000	Province de l'Alberta, 2,2 %, 1 ^{er} juin 2026	243 931	223 681	
55 000	Province de l'Alberta, 2,35 %, 1 ^{er} juin 2025	54 687	52 640	
327 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 1 ^{er} juin 2027	311 368	308 070	
42 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 ^{er} juin 2024	41 829	41 268	
96 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,3 %, 18 juin 2026	100 125	90 481	
148 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	140 973	139 484	
71 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	71 079	68 560	
29 000	Province de la Colombie-Britannique, 6,15 %, 19 novembre 2027	32 104	31 290	
2 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD-T, 9 %, 23 août 2024	2 673	2 086	
23 000	Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	22 309	22 050	
152 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	159 813	144 258	
94 000	Province du Manitoba, 2,6 %, 2 juin 2027	89 621	88 694	
5 000	Province du Manitoba, 3,3 %, 2 juin 2024	5 411	4 921	
16 000	Province du Manitoba, 4,4 %, 5 septembre 2025	18 329	15 901	
2 000	Province du Manitoba, 7,75 %, 22 décembre 2025	2 621	2 142	
5 000	Province du Nouveau-Brunswick, 1,8 %, 14 août 2025	5 133	4 712	
71 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	66 604	66 153	
73 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,6 %, 14 août 2026	75 003	69 289	
5 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,65 %, 3 juin 2024	5 542	4 936	
26 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,25 %, 2 juin 2027	23 152	23 223	
10 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,3 %, 2 juin 2025	9 755	9 549	
47 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,85 %, 17 octobre 2027	47 032	46 315	
12 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 8,45 %, 5 février 2026	15 216	13 128	
83 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6Z, 3 %, 2 juin 2026	88 346	79 670	
41 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 2,1 %, 1 ^{er} juin 2027	38 186	37 975	
39 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 6,6 %, 1 ^{er} juin 2027	43 580	42 388	
2 000	Province de la Nouvelle-Écosse, série D8, 2,15 %, 1 ^{er} juin 2025	2 125	1 907	
112 000	Province de l'Ontario, 1,05 %, 8 septembre 2027	98 692	98 953	
141 000	Province de l'Ontario, 1,35 %, 8 septembre 2026	129 184	128 719	
267 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	252 606	250 972	
852 000	Province de l'Ontario, 1,85 %, 1 ^{er} février 2027	794 748	785 717	
395 000	Province de l'Ontario, 2,3 %, 8 septembre 2024	383 649	382 803	
503 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	498 071	475 619	
366 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	352 684	351 956	
572 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2027	544 388	540 218	
56 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 5 février 2025	54 984	54 131	
237 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	235 677	233 673	
449 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	448 092	440 663	
64 000	Province de l'Ontario, 8 %, 2 juin 2026	81 898	70 202	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)				
5 000	Province de l'Ontario, 8,5 %, 2 décembre 2025	6 848	5 430	
6 000	Province de l'Ontario, 9,5 %, 2 juin 2025	7 664	6 516	
363 000	Province de Québec, 2,5 %, 1 ^{er} septembre 2026	380 620	344 068	
11 000	Province de Québec, 2,6 %, 6 juillet 2025	10 623	10 566	
149 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2025	148 876	143 208	
337 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	322 759	319 938	
123 000	Province de Québec, 3,75 %, 1 ^{er} septembre 2024	122 972	121 241	
14 000	Province de Québec, 5,35 %, 1 ^{er} juin 2025	14 252	14 147	
44 000	Province de Québec, 8,5 %, 1 ^{er} avril 2026	57 972	48 562	
32 000	Province de Québec, série QY, 1,85 %, 13 février 2027	31 713	29 536	
7 000	Province de la Saskatchewan, 0,8 %, 2 septembre 2025	6 864	6 446	
108 000	Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	113 091	102 503	
56 000	Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	53 540	52 951	
26 000	Province de la Saskatchewan, 3,2 %, 3 juin 2024	26 170	25 565	
1 000	Province de la Saskatchewan, 8,75 %, 30 mai 2025	1 282	1 071	
		6 956 512	6 734 997	14,2
OBLIGATIONS MUNICIPALES				
28 000	Ville de Montréal, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2026	29 484	26 618	
2 000	Ville de Montréal, 3 %, 1 ^{er} septembre 2025	2 159	1 928	
64 000	Ville de Montréal, 3 %, 1 ^{er} septembre 2027	61 546	60 970	
3 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	3 207	2 946	
12 000	Ville de Toronto, 2,4 %, 24 juin 2026	12 493	11 318	
50 000	Ville de Toronto, 2,4 %, 7 juin 2027	47 135	46 755	
1 000	Ville de Toronto, 2,45 %, 6 février 2025	1 043	964	
46 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,35 %, 30 juin 2026	45 172	42 055	
5 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 3 juin 2024	5 085	4 869	
97 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	101 621	91 995	
7 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,65 %, 2 octobre 2025	7 455	6 696	
10 000	Municipalité régionale de Peel, 2,3 %, 02 novembre 2026	10 234	9 368	
19 000	Municipalité régionale d'York, 2,35 %, 9 juin 2027	17 860	17 732	
22 000	Municipalité régionale d'York, 2,5 %, 2 juin 2026	23 026	20 831	
3 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,05 %, 4 juin 2025	3 297	2 906	
		370 817	347 951	0,7
OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES				
86 000	Banque interaméricaine de développement, 0,75 %, 15 octobre 2025	86 344	78 748	
128 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,63 %, 14 janvier 2026	127 719	115 938	
8 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,75 %, 2 juillet 2025	8 049	7 403	
14 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,8 %, 26 juillet 2024	14 108	13 521	
		236 220	215 610	0,5
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		48 599 566	47 129 278	99,3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
Total du portefeuille de placements		48 599 566	47 129 278	99,3
Autres actifs (passifs) nets			317 528	0,7
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			47 446 806	100,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects [†]	-	-

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts non couvertes	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	900 000	2 150 000
Parts rachetables émises	150 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(1 000 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 050 000	1 150 000

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,180

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	11 724
Garanties (hors trésorerie)	-	12 333

Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	3	11
Charges	(1)	(4)
Revenu tiré des prêts de titres	2	7
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	39,1

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2023, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
Obligations de sociétés	48,3
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	27,6
Obligations et garanties provinciales	15,3
Obligations étrangères	6,9
Obligations municipales	1,1
Autres actifs (passifs) nets	0,8
Total	100,0

Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	26,7
AA/Aa/A+	20,0
A	20,0
BBB/Baa/B++	28,5
BB/Ba/B+	2,1
B	1,7
CCC/Caa/C+	0,1
CC/Ca/C-	0,1
Aucune	0,1
Total	99,3

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	29,0
AA/Aa/A+	8,3
A	34,5
BBB/Baa/B++	27,4
Total	99,2

*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

**Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2023

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	1 888	27 374	13 902	3 965	47 129

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	403	21 011	15 584	3 336	40 334

Au 30 juin 2023, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 331 000 \$ (306 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	47 129	-	47 129
Total	-	47 129	-	47 129

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	40 334	-	40 334
Total	-	40 334	-	40 334

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

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

Notes des états financiers (non audité)

1. LES FONDS

Les Fonds suivants sont des fonds négociés en Bourse, chacun d'eux étant une fiducie créée en vertu des lois de la province de l'Ontario et régie par une déclaration de fiducie.

CI Investments Inc. est le gestionnaire et le fiduciaire (le « gestionnaire » et le « fiduciaire ») des Fonds. Le gestionnaire est une filiale en propriété exclusive de CI Financial Corp. (bourse de Toronto [TSX] : CIX). La Compagnie Trust CIBC Mellon est le dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, 2^e étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 16 août 2023.

Le tableau suivant indique la date à laquelle chaque catégorie de titres de chaque Fonds a commencé à être négociée à la TSX.

FNB	Symbole de TSX	Parts couvertes	Parts non couvertes	Parts à couverture variable
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	CHNA.B	-	1 août 2018	-
FNB d'actions mondiales ONE CI	ONEQ	21 sept. 2015	-	-
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	ONEB	9 oct. 2018	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	DGRC	-	19 sept. 2017	-
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	EMV.B	-	19 sept. 2017	-
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	EHE/EHE.B	12 juill. 2016	8 août 2017	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	IQD/IQD.B	12 juill. 2016	12 juill. 2016	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	DQI	-	-	12 juill. 2016
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	JAPN/JAPN.B	1 août 2018	1 août 2018	-
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	UMI/UMI.B	19 sept. 2017	19 sept. 2017	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	DGR/DGR.B	12 juill. 2016	12 juill. 2016	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	DQD	-	-	12 juill. 2016
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	CAGG	-	22 juin 2017	-
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	CAGS	-	22 juin 2017	-

Les Fonds offrent des parts CI ONE, des parts non couvertes, des parts couvertes ou des parts à couverture variable sur une base continue.

À compter du 31 mai 2023, les parts du FNB d'actions mondiales ONE CI et du FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI qui étaient auparavant émises en tant que parts couvertes ont été renommées parts ONE CI.

L'objectif de chaque Fonds est de mettre en commun et de gérer l'argent versé par des investisseurs et les porteurs de parts ayant des objectifs de placement semblables. Les Fonds peuvent investir dans des actions, des titres à revenu fixe, des dérivés, un ou des fonds sous-jacents ou une combinaison de ceux-ci en fonction de leurs objectifs et stratégies de placement. Les Fonds peuvent détenir des placements en vue d'obtenir un revenu ou une plus-value en capital ou les deux.

Fonds	Objectifs de placement
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice S&P China 500 (\$ CA), avant frais et dépenses. En ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice S&P China 500, avant frais et dépenses.
FNB d'actions mondiales ONE CI	Le Fonds cherche à fournir une croissance à long terme du capital en investissant dans un portefeuille de titres de participation d'émetteurs mondiaux, par le biais d'achats directs de sociétés cotées en Bourse ou de fonds négociés en Bourse qui représentent une catégorie d'actifs en actions.
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	Le Fonds cherche à offrir un taux de rendement stable, principalement par le biais du revenu, et dans une moindre mesure, une appréciation du capital en investissant dans un portefeuille composé principalement de titres à revenu fixe nord-américains de première qualité émis par des sociétés, des gouvernements (fédéral et étatique/provincial) et des entités et agences liées au gouvernement, par des achats directs ou des fonds négociés en Bourse (FNB).

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	Le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice de croissance du dividende de titres canadiens de qualité WisdomTree avant les frais et dépenses.
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice du dividende des marchés émergents (\$ CA) WisdomTree, avant les frais et dépenses. En ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice du dividende des marchés émergents WisdomTree, avant les frais et dépenses.
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice d'actions WisdomTree Europe couvert en \$ CA, avant les frais et dépenses, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice des actions WisdomTree Europe avant les frais et dépenses.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice de croissance du dividende de qualité WisdomTree International (\$ CA), avant les frais et dépenses. En ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice de croissance du dividende de qualité WisdomTree International, avant les frais et dépenses.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts à couverture variable, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice de croissance du dividende de qualité WisdomTree International à couverture variable en \$ CA, avant les frais et dépenses.
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree Japan Equity (\$ CA), avant les frais et dépenses, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice d'actions WisdomTree Japon avant les frais et dépenses.
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend (\$ CA), avant les frais et dépenses; et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice du dividende à moyenne capitalisation WisdomTree U.S. avant les frais et dépenses.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth (\$ CA), avant les frais et dépenses; et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice de croissance du dividende de qualité WisdomTree U.S. avant les frais et dépenses.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts à couverture variable, le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice de croissance du dividende de qualité WisdomTree U.S. à couverture variable en \$ CA, avant les frais et dépenses.
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Canadian Aggregate Enhanced Yield, avant les frais et dépenses.
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Le Fonds cherche à suivre, dans la mesure du possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Canadian Short Aggregate Enhanced Yield, avant les frais et dépenses.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Le 8 avril 2022, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
FNB actif Dividendes canadiens CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI
FNB Indice MSCI Canada Pondération faible risque CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI
Catégorie Revenu d'actions canadiennes de base CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI
FNB Indice MSCI États-Unis Pondération faible risque CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI

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.

Le 8 avril 2022, à la clôture des bureaux, les Fonds prorogés ont acquis la totalité de l'actif net des Fonds clôturés en échange de titres des Fonds prorogés. La valeur des titres des Fonds prorogés émis dans le contexte de ces fusions correspond à l'actif net transféré des Fonds clôturés. Le coût associé à ces fusions 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
FNB actif Dividendes canadiens CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	9 427 778	263 149
FNB Indice MSCI Canada Pondération faible risque CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	1 539 513	42 971
Catégorie Revenu d'actions canadiennes de base CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	12 545 785	350 180
FNB Indice MSCI États-Unis Pondération faible risque CI	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	19 528 049	518 840

Les résultats des Fonds clôturés ne figurent pas dans ces états financiers.

Les états de la situation financière sont au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. Les états du résultat global et les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022.

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.

Les principales méthodes comptables des Fonds sont résumées ci-après :

a. Classement et comptabilisation des instruments financiers

Les Fonds classent et évaluent leurs placements, entre autres dans des titres à revenu fixe, des titres de capitaux propres, des fonds de placement, des fonds négociés en Bourse et des dérivés, selon le modèle économique des Fonds pour la gestion de ces actifs financiers et les caractéristiques de flux de trésorerie contractuels des actifs financiers. Les portefeuilles d'actifs financiers des Fonds sont gérés et leur rendement est évalué selon la juste valeur. Les Fonds mettent surtout l'accent sur les informations sur la juste valeur et utilisent celles-ci pour évaluer le rendement des actifs et pour prendre des décisions. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance des Fonds correspondent uniquement à du capital et à des intérêts. Ces titres ne sont pas détenus aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels ni aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels et de la vente de ces titres. La perception de flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à la réalisation de l'objectif du modèle économique des Fonds. Par conséquent, tous les placements et les dérivés sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »). Les ventes à découvert sont comptabilisées en tant que passifs financiers à la JVRN. Les contrats de dérivés dont la juste valeur est négative sont présentés en tant que passifs à la JVRN.

Les obligations des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables correspondent 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.

Les actifs financiers et passifs financiers sont compensés et le solde net est présenté dans les états de la situation financière si, et seulement si, les Fonds ont un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et s'ils ont l'intention soit de régler les montants nets, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les Fonds concluent, dans le cadre normal de leurs activités, diverses conventions-cadres de compensation ou autres accords similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans les états de la situation financière, mais qui permettent néanmoins d'opérer compensation des montants dans certaines circonstances, comme la faillite ou la résiliation des contrats.

b. Juste valeur des instruments 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. Les bons de souscription non cotés, le cas échéant, sont évalués en fonction d'un modèle de tarification prenant en compte des facteurs comme la valeur de marché du titre sous-jacent, le prix d'exercice et les modalités du bon de souscription. Les titres à revenu fixe, les débentures et les autres instruments de créance, y compris les placements à court terme, sont évalués au cours fourni par des courtiers en valeurs mobilières reconnus. Le ou les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable selon la valeur liquidative présentée par les gestionnaires des fonds sous-jacents.

La juste valeur des placements privés et des autres titres pour lesquels il existe des données non observables importantes est établie à l'aide de modèles d'évaluation pouvant être fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données

Notes des états financiers (non audité) (suite)

analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire afin de garantir qu'elles sont raisonnables. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des placements privés.

c. Trésorerie

La trésorerie comprend les dépôts en espèces et le découvert bancaire.

d. Coût des placements

Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est déterminé selon le coût moyen, commissions et coûts de transaction non compris. Le coût moyen n'inclut pas l'amortissement des primes ou des escomptes sur les titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro.

e. Opérations de placement et comptabilisation des revenus

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération, c'est-à-dire à la date où un Fonds s'engage à acheter ou à vendre le placement. Les « intérêts aux fins des distributions » présentés dans les états du résultat global correspondent à l'intérêt nominal reçu par les Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire. Les intérêts gagnés en espèces sont inclus dans les états du résultat global sous « Intérêts aux fins des distributions ».

Les dividendes et les distributions tirés des placements sont comptabilisés à la date ex-dividende/ex-distribution.

Les distributions des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents sont traitées à titre de revenu, gains en capital ou remboursement de capital, selon les meilleurs renseignements dont dispose le gestionnaire. En raison de la nature de ces placements, la répartition effectuée au cours de l'exercice considéré pourrait être différente de cette information. Les distributions de fiducies de revenu et de fonds sous-jacents qui sont traitées comme un remboursement de capital aux fins de l'impôt sur le revenu réduisent le coût moyen des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents.

f. Conversion de devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds. Les montants en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle comme suit : les placements, les contrats de change à terme et les autres actifs et passifs à la juste valeur, au cours du change de clôture chaque jour ouvrable; les revenus et les charges, les achats, les ventes et les règlements de placements, au cours du change en vigueur à la date des opérations en cause. Les profits et pertes de change sur la trésorerie sont présentés à titre de « Profit (perte) de change sur la trésorerie » et les profits et pertes de change se rapportant à d'autres actifs et passifs financiers sont présentés sous les postes « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés » et « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global.

g. Évaluation des parts

La valeur liquidative par part de chaque catégorie est calculée à la fin de chaque jour ouvrable de la TSX en divisant la valeur liquidative totale de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre de parts de cette catégorie en circulation.

La valeur liquidative 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 autres revenus et charges ainsi que les profits et les pertes sont imputés proportionnellement à chaque catégorie en fonction de la valeur liquidative relative de chaque catégorie.

Au 30 juin 2023, au 31 décembre 2022 et au 30 juin 2022, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables utilisé aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

h. Classement des parts

Les parts 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. Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille

Les coûts de transaction, notamment les commissions de courtage, engagés lors de l'achat et de la vente de titres, sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille ».

Les Fonds qui investissent uniquement dans les parts/les actions de fonds sous-jacents ne sont pas assujettis aux commissions.

j. Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, provenant des opérations par part

« L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part » dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre moyen pondéré de parts de cette catégorie en circulation au cours de la période.

k. Contrats de change à terme

Les Fonds sont autorisés à conclure des contrats de change à terme de temps à autre. Les contrats de change à terme sont évalués chaque jour d'évaluation selon la différence entre le taux prévu aux termes du contrat et le taux à terme en vigueur à la date d'évaluation, appliquée au montant notionnel du contrat et ajustée en fonction du risque de contrepartie. Tout profit (perte) latent découlant des contrats de change à terme est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

l. Compensation des instruments financiers

Les informations présentées dans les tableaux « Compensation des instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds comprennent les actifs et passifs des contrats de change à terme qui sont assujettis à un accord de compensation exécutoire. Les transactions avec des contreparties individuelles sont régies par des accords de compensation distincts. Chaque accord prévoit un règlement net de certains contrats ouverts pour lesquels les Fonds et la contrepartie concernée choisissent de régler leurs contrats sur une base nette. En l'absence d'un tel choix, les contrats seront réglés sur une base brute. Cependant, chaque partie à l'accord de compensation aura la possibilité de régler tous les contrats ouverts sur une base nette en cas de défaillance de l'autre partie.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les accords de compensation de l'International Swaps and Derivatives Association Inc. (accord de compensation ISDA) régissent les opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré conclus par les Fonds et des contreparties choisies. Les accords de compensation ISDA prévoient des dispositions pour les obligations générales, les représentations, les accords, les garanties et les cas de défaillance ou de résiliation. Les clauses de résiliation comprennent des dispositions qui peuvent permettre aux contreparties de choisir une résiliation anticipée et de provoquer un règlement de toutes les opérations en cours en vertu de l'accord de compensation ISDA applicable. Tout choix de résiliation anticipée pourrait avoir une incidence importante sur les états financiers. La juste valeur des opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré, nette de la garantie reçue ou donnée par une contrepartie à la fin de la période, est présentée dans les notes propres au Fonds jointes aux états financiers de chacun des Fonds, le cas échéant.

Les Fonds peuvent être assujettis à plusieurs accords-cadres ou accords de compensation, avec certaines contreparties. Ces accords-cadres réduisent le risque de contrepartie lié aux opérations pertinentes en spécifiant les mécanismes de protection de crédit et en fournissant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Puisque les opérations ont des mécanismes différents et sont parfois négociées par différentes entités juridiques d'une contrepartie, chaque type d'opération peut être couvert par un accord-cadre différent, d'où la nécessité d'avoir plusieurs accords avec une seule contrepartie. Comme les accords-cadres sont propres aux opérations uniques visant différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de dénouer et de régler leur exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance à l'égard des opérations régies par un accord unique avec une contrepartie.

m. Participations 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 un 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. Une entité structurée est une entité qui a été conçue de telle sorte que les droits de vote ou droits similaires ne sont pas les facteurs dominants pour déterminer qui contrôle l'entité, ou de telle sorte que les droits de vote sont uniquement liés à des tâches administratives et que les activités pertinentes sont régies par des dispositions contractuelles.

Le gestionnaire a déterminé que le ou les fonds sous-jacents ou le ou les fonds négociés en Bourse (« FNB ») détenus par les Fonds répondent généralement à la définition d'une entité structurée non consolidée. Les titres adossés à des créances hypothécaires et les titres adossés à des crédits mobiliers sont également considérés comme des entités structurées non consolidées. Les Fonds comptabilisent leurs placements dans des entités structurées non consolidées à la JVRN.

Les Fonds qui investissent dans un ou des fonds sous-jacents sont assujettis aux modalités des documents de placement du ou des fonds sous-jacents concernés et sont sensibles au risque de prix du marché découlant des incertitudes entourant les valeurs futures du ou des fonds sous-jacents en question. Le ou les fonds sous-jacents du portefeuille de placements sont gérés par des gestionnaires de portefeuille qui sont rémunérés pour leurs services par le fonds sous-jacent concerné. Cette rémunération est généralement constituée de frais calculés en fonction de l'actif et est reflétée dans l'évaluation de chacun des fonds sous-jacents, sauf lorsque les Fonds investissent dans certaines catégories de fonds sous-jacents pour lesquelles la rémunération des gestionnaires de portefeuille est négociée et payée à l'extérieur de chacun des fonds sous-jacents. Le ou les fonds sous-jacents financent leurs activités en

émettant des parts ou des actions rachetables qui donnent droit aux porteurs à une participation égale du ou des fonds sous-jacents. Les Fonds peuvent demander le rachat de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents sur une base quotidienne. Ces placements sont inclus au poste « Placements » à la JVRN dans les états de la situation financière. Tout profit (perte) latent découlant de ces placements est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global, jusqu'au moment où ces placements sont vendus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les fonds sous-jacents est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents.

Certains Fonds effectuent des placements dans un ou des FNB, qui sont présentés dans l'inventaire du portefeuille de placement. Ces Fonds ont déterminé que leurs placements dans des tels FNB satisfont aux critères de définition des entités structurées non consolidées. Ce ou ces FNB financent leurs activités en émettant des actions rachetables qui peuvent être vendues au gré du détenteur et qui lui donnent droit à une participation proportionnelle à la valeur liquidative de chaque FNB. Le ou les FNB sont domiciliés au Canada ou aux États-Unis et sont cotés en bourse. L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les FNB est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les FNB.

L'information se rapportant à la participation dans des entités structurées non consolidées figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

n. Retenues d'impôts

Un Fonds peut, de temps à autre, être assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées séparément dans les états du résultat global.

o. Taxe de vente harmonisée

Certaines provinces, y compris l'Ontario, l'Île-du-Prince-Édouard, la Nouvelle-Écosse, le Nouveau-Brunswick et Terre-Neuve-et-Labrador (chacune, une juridiction fiscale participante), ont harmonisé leur taxe de vente provinciale (« TVP ») avec la taxe fédérale sur les produits et services (« TPS »). La taxe de vente harmonisée (« TVH ») correspond au taux de 5 % de la TPS fédérale combiné à celui de la TVP des provinces concernées. La province de Québec perçoit également la taxe de vente du Québec (« TVQ »). La TVH à verser ou à recevoir est calculée selon le lieu de résidence des porteurs de parts et la valeur de leur participation dans le Fonds à une date donnée, et non en fonction du territoire dont relève le Fonds. Le taux effectif des taxes de vente applicable à chaque catégorie du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts entre les provinces. Il est calculé selon le taux de TVH ou, si la province concernée n'applique pas la TVH, selon le taux de TPS ou de la TVQ. Tous les montants à ce titre sont inscrits au poste « Taxe de vente harmonisée » des états du résultat global.

3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

La préparation d'états financiers conformes aux IFRS 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 dépenses pour la période. 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 :

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Évaluation à la juste valeur des investissements et des dérivés non cotés sur un marché actif

De temps à autre, les Fonds peuvent détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, notamment des titres non cotés, des titres privés ou des dérivés. 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. La juste valeur des titres privés est établie à l'aide de modèles d'évaluation fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs ont été examinées de façon indépendante par le gestionnaire selon les hypothèses et les estimations disponibles à la date de l'état de la situation financière. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres privés.

Dans la mesure du possible, les modèles d'évaluation font appel à des données observables. Toutefois, le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre à l'entité que le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités, les corrélations et les hypothèses clés au sujet d'événements futurs. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers.

Les Fonds considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question.

La juste valeur des placements dans un ou des fonds sous-jacents qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs est évaluée principalement selon la dernière valeur liquidative de ces parts ou actions disponible pour chaque fonds sous-jacent, telle qu'elle est déterminée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

IFRS 10 – États financiers consolidés (IFRS 10)

Conformément à l'IFRS 10, le gestionnaire a déterminé que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement, à savoir une entité qui obtient des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion de placements, qui déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital ou de revenus de placement ou les deux, et qui évalue et mesure la performance de ses placements sur la base de la juste valeur. Par conséquent, les Fonds ne consolident pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent plutôt à la JVRN, comme l'exige la norme comptable.

4. PARTS RACHETABLES

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts rachetables et transférables d'un nombre illimité de catégories de parts, dont chacune représente une participation indivise dans l'actif net de ce Fonds.

Toutes les parts d'un Fonds ont des droits et des privilèges égaux. Chaque part entière a droit à un vote à toutes les assemblées des porteurs de parts et a le droit de participer de façon égale aux distributions faites par un Fonds aux porteurs de parts, autres que les distributions des frais de gestion, y compris les distributions de revenus nets et les gains et distributions en capital réalisés nets à la clôture du Fonds.

Les distributions de gains en capital sont automatiquement réinvesties dans des parts supplémentaires du Fonds, qui sont immédiatement consolidées afin que la valeur liquidative par part demeure inchangée. Les parts sont émises uniquement comme étant entièrement payées et ne peuvent être évaluées.

Tout jour de négociation, les porteurs de parts peuvent échanger le nombre prescrit de parts (ou un multiple intégral de celui-ci) contre des paniers de titres ou de liquidités. Tout jour de négociation, les porteurs de parts peuvent faire racheter des parts de tout Fonds en contrepartie d'un montant en espèces à un prix de rachat par part égal au moindre des montants suivants : (i) 95 % du cours de clôture des parts à la TSX le jour effectif du rachat; et (ii) la valeur liquidative par part le jour effectif du rachat. Un droit de racheter des parts d'un Fonds peut être suspendu avec l'approbation des Autorités canadiennes en valeurs mobilières.

Chaque Fonds gère son capital selon ses objectifs et stratégies de placement décrits à la note 1 et les pratiques de gestion des risques décrites à la note 10, et s'efforce d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant des liquidités suffisantes pour effectuer des distributions et des rachats. Afin de gérer leurs structures de capital, les Fonds peuvent ajuster le montant des distributions versées aux porteurs de parts.

L'information se rapportant aux transactions sur parts rachetables figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

5. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

Frais de gestion

Le gestionnaire de chaque Fonds, en contrepartie des frais de gestion qu'il reçoit, fournit les services de gestion requis pour les activités quotidiennes des Fonds, y compris la gestion des portefeuilles de placements des Fonds et le détachement de personnel de direction clé.

À titre de rémunération pour les services rendus aux Fonds, les Fonds versent au gestionnaire des frais de gestion annuels calculés en pourcentage de la valeur liquidative quotidienne et payés mensuellement à terme échu.

Charges d'exploitation

En plus du paiement des frais de gestion, chaque Fonds est responsable (a) des coûts et des dépenses engagés pour se conformer au Règlement 81-107 : Comité d'examen indépendant des fonds d'investissement (Règlement 81-107) (y compris les dépenses liées à la mise en œuvre et au fonctionnement continu du Comité d'examen indépendant (CEI) des Fonds); (b) les frais de courtage et autres frais, les taxes, les prélèvements ou les dépenses (comme les frais d'apposition de timbre) engagées dans le cadre de l'exécution des transactions de portefeuille ou en lien avec la création, les transactions d'échange et de rachat (y compris, sans s'y limiter, les frais, les taxes, les prélèvements ou les dépenses liés à l'achat ou à la vente d'un montant de toute devise, ou le rapatriement de tout titre ou autre actif, liés à l'exécution des transactions de portefeuille ou à toute création, transactions d'échange ou de rachat), (c) les frais juridiques ou les dépenses liés à tout arbitrage, litige, ou arbitrage ou litige en cours ou probable, y compris tout règlement en lien avec ceux-ci, (d) les frais de distribution et les dépenses payés par le Fonds en vertu de tout régime de réinvestissement de distribution adopté par le Fonds, (e) les intérêts et les impôts de quelque nature que ce soit (y compris, mais sans s'y limiter, le revenu, la taxe d'accise, le transfert et les retenues d'impôt, ainsi que toutes les autres taxes applicables, y compris la TPS et la TVH); (f) les frais et dépenses liés à la prestation de services de prêt de titres; (g) les coûts de conformité à toute nouvelle exigence gouvernementale ou réglementaire introduite après l'établissement du Fonds; et (h) des dépenses extraordinaires. Le paiement ou l'hypothèse par le gestionnaire de toute dépense d'un Fonds décrite aux points (a) à (h) ci-dessus, que le gestionnaire n'est pas tenu de payer ou d'assumer, n'oblige pas le gestionnaire à payer ou à assumer la même dépense

Notes des états financiers (non audité) (suite)

ou toute dépense similaire d'un Fonds à toute occasion ultérieure. Le gestionnaire est responsable de tous les autres coûts et dépenses des Fonds, y compris les frais payables au conseiller en placement, au dépositaire, au registraire et à l'agent de transfert et à l'agent du régime, et des frais payables aux autres fournisseurs de services retenus par le gestionnaire.

Absorption

La décision de renoncer aux frais de gestion et aux charges d'exploitation propres à un Fonds ou de les prendre en charge est au gré du gestionnaire. La pratique visant à renoncer aux dépenses ou à les prendre en charge peut se poursuivre indéfiniment ou être abandonnée en tout temps sans avis aux porteurs de parts. Les charges d'exploitation propres à un Fonds prises en charge par le gestionnaire ou les frais de gestion auxquels il a renoncé sont présentés dans les états du résultat global.

Rabais sur frais

Dans certains cas, le gestionnaire peut accepter de facturer des frais de gestion réduits par rapport aux frais de gestion qu'il aurait autrement le droit de recevoir des Fonds pour les placements effectués dans les Fonds par certains porteurs de parts. Un montant égal à la différence entre les frais autrement facturables et les frais réduits du Fonds sera distribué en espèces par le Fonds aux porteurs de parts à titre de distribution des frais de gestion. Les rabais sur les frais de gestion sont incluses 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 ».

Placements dans les fonds sous-jacents

Un Fonds qui investit dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents ne paiera pas de frais de gestion et d'administration en double sur la portion des actifs qui sont investis dans des parts ou des actions du ou des fonds sous-jacents. Au cours de la période, un Fonds pourrait recevoir un rabais sur les frais de gestion ou d'administration du gestionnaire du ou des fonds sous-jacents relativement à ses placements dans un fonds sous-jacent. Les rabais sur frais de gestion ou d'administration, le cas échéant, 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 ».

Voir le tableau des taux de frais de gestion dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir les ratios des frais de gestion de chaque catégorie de chaque Fonds.

6. PRÊT DE TITRES

Les Fonds ont conclu un programme de prêt de titres avec la Bank of New York Mellon, qui agit comme agent de prêt de titres. Ces opérations comportent l'échange temporaire de titres contre une garantie comportant l'engagement à remettre les mêmes titres à une date future. Le produit tiré de ces opérations prend la forme d'honoraires payés par la contrepartie et, dans certaines circonstances, d'intérêts payés sur le montant au comptant ou les titres détenus en garantie. Le produit des opérations de prêt de titres est inclus aux états du résultat global et est comptabilisé lorsqu'il est gagné. La valeur de marché globale de tous les titres prêtés par un Fonds ne peut dépasser 50 % des actifs de ce Fonds. La garantie reçue est composée de titres admissibles et de titres qui sont immédiatement convertibles en titres de même type ou qui peuvent être échangés contre de tels titres, qui comportent les mêmes modalités et pour un même nombre que ceux prêtés par chaque Fonds, d'une valeur de marché correspondant au moins à 102 % de la valeur de marché des titres prêtés. Chaque dépositaire du Fonds a le droit de recevoir des paiements à même le montant brut tiré des opérations de prêt de titres des Fonds et assume tous les coûts d'exploitation directement liés au prêt de titres, y compris le coût d'indemnisation en cas de défaut de l'emprunteur. La valeur des titres prêtés et des garanties reçues de même qu'un rapprochement entre le revenu brut tiré des prêts de titres et le revenu tiré des prêts de titres figurent dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant. Les revenus tirés des prêts de titres figurent au poste « Revenu tiré des prêts de titres » des états du résultat global.

7. IMPOSITION

Les Fonds répondent à la définition de fiducie de fonds commun de placement en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du résultat net des Fonds aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours de tout exercice doivent être distribués aux porteurs de parts de manière à ce que chaque Fonds n'ait aucun impôt à payer. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. L'impôt sur le montant net des gains en capital réalisés qui ne sont ni payés ni payables peut, en général, être recouvré en vertu des dispositions de remboursement contenues dans la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et dans les lois provinciales de l'impôt sur le revenu, lorsque des rachats sont effectués. À l'occasion, les Fonds peuvent effectuer des distributions supérieures à leurs revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

8. DISTRIBUTIONS

Chaque Fonds verse des distributions mensuelles ou trimestrielles à ses porteurs de parts. Le montant des distributions est fondé sur l'évaluation par le gestionnaire des flux de trésorerie prévus des Fonds de temps à autre.

En plus des distributions décrites ci-dessus, un Fonds peut, de temps à autre, payer des distributions supplémentaires sur ses parts, y compris sans restriction en lien avec un dividende spécial ou en lien avec les rendements du capital.

9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp. ou ses filiales ou dans d'autres fonds de placement gérés par le gestionnaire indiqués dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

Opérations entre fonds

Ces opérations entre Fonds surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète un titre d'un émetteur auprès d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le CEI passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours des périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, certains Fonds ont effectué des opérations entre Fonds.

Opérations entre fonds liés

Ces opérations surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète les parts ou actions d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Au cours des périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, certains Fonds ont effectué des opérations entre fonds liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans un ou des fonds liés à la fin de chaque des périodes.

Opérations avec un émetteur lié

Ces opérations surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète les titres de CI Financial Corp. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le Comité d'examen indépendant (CEI) passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Durant les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, certains Fonds ont effectué des opérations entre émetteurs liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans la société CI Financial Corp. à la fin de chaque des périodes.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

10. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Conflit entre l'Ukraine et la Russie

L'intensification du 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.

Transition du taux interbancaire offert

À compter du 31 décembre 2021, la publication du taux interbancaire offert à Londres (LIBOR) en livre sterling, en yen japonais, en franc suisse et en euro a cessé pour toutes les échéances, ainsi que pour les échéances des titres à 1 semaine et à 2 mois. En outre, le taux LIBOR en dollar américain pour les titres à un mois, à trois mois, à six mois et à douze mois ne sera plus publié après le 30 juin 2023.

Le 16 mai 2022, Refinitiv Benchmark Services (UK) Limited, l'administrateur du taux offert en dollars canadiens (CDOR), a annoncé que le CDOR pour toutes les échéances cessera d'être calculé après sa publication finale le 28 juin 2024.

La réforme des taux de référence à l'échelle mondiale visant à passer du LIBOR ou CDOR à des taux de référence alternatifs peut avoir une incidence sur un Fonds qui détient des placements indexés au LIBOR ou au CDOR. Les risques de marché découlent du fait que les nouveaux taux de référence sont susceptibles de différer du taux LIBOR en dollar américain ou du CDOR, ce qui peut se répercuter sur la volatilité ou la liquidité des marchés pour les instruments actuellement indexés sur le LIBOR en dollar américain ou le CDOR. Afin de gérer ces risques, le gestionnaire continue de suivre de près l'évolution du secteur et prend toutes les mesures nécessaires pour identifier, mesurer et gérer les risques liés à l'exposition des Fonds au LIBOR en dollar américain ou au CDOR découlant des titres en portefeuille.

Gestion des risques

Les Fonds sont exposés à divers risques associés aux instruments financiers : le risque de concentration, le risque de crédit, le risque de liquidité, la compensation d'instruments financiers 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 détient le Fonds. La valeur des placements dans un portefeuille peut changer de jour en jour en raison des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur, des conditions du marché, de la conjoncture économique et des nouvelles propres aux sociétés dans lesquelles le Fonds a investi. Le gestionnaire des Fonds peut atténuer les effets négatifs de ces risques sur la performance des Fonds à l'aide des mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions des Fonds 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.

Les Fonds qui investissent dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents sont indirectement exposés aux risques liés aux instruments financiers indiqués plus haut.

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.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes annexes 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 solvabilité de l'émetteur. La valeur comptable des titres de créance telle que présentée dans l'inventaire du portefeuille représente l'exposition au risque de crédit de chaque Fonds. L'exposition au risque de crédit pour les dérivés se fonde sur le profit latent de chaque Fonds sur les obligations contractuelles envers la contrepartie à la date de clôture. La note de crédit d'une contrepartie à un dérivé est indiquée dans l'inventaire du portefeuille de chaque Fonds, le cas échéant. L'exposition au risque de crédit des autres actifs du Fonds correspond à leur valeur comptable présentée dans les états de la situation financière.

Certains Fonds investissent uniquement dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents et peuvent être exposés au risque de crédit indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents investissent dans des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés.

Les notes de crédit des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés proviennent de S&P Global Ratings, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement. Les notes de crédit peuvent être à long terme ou à court terme. Les notes de crédit à court terme sont généralement attribuées aux obligations et instruments dérivés à court terme.

Le tableau ci-dessous permet de comparer les notes de crédit à long terme présentées dans le tableau des risques de crédit et les notes de crédit à court terme présentées à l'annexe des dérivés de l'inventaire du portefeuille.

Notes de crédit selon le tableau des risques de crédit	Notes de crédit selon les tableaux des dérivés
AAA/Aaa/A++	A-1+
AA/Aa/A+	A-1, A-2, A-3
A	B, B-1
BBB/Baa/B++	B-2
BB/Ba/B+	B-3
B	C
CCC/Caa/C++	-
CC/Ca/C+	-
C et moins	D
Aucune	AN

Les soldes de trésorerie présentés dans les états de la situation financière sont conservés par le dépositaire. Le gestionnaire surveille régulièrement la solvabilité du dépositaire. La note de crédit du dépositaire au 30 juin 2023 était de AA (AA au 31 décembre 2022).

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Toutes les opérations effectuées par les Fonds portant sur des titres cotés sont réglées ou payées à la livraison en utilisant des courtiers approuvés. Le risque de défaillance est considéré comme minime, étant donné que la livraison des titres vendus n'est effectuée qu'au moment de la réception du paiement par le courtier. Le paiement est effectué lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une ou l'autre des parties manque à son obligation.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité s'entend du risque que les Fonds ne soient pas en mesure de satisfaire à leurs obligations en temps opportun ou à un prix raisonnable.

Les Fonds sont principalement exposés au risque de liquidité en raison des rachats de parts quotidiens en espèces. En règle générale, les Fonds investissent dans des titres qui sont considérés comme étant facilement réalisables étant donné qu'ils sont négociés en Bourse. Certains titres peuvent être moins liquides que d'autres titres et comportent le risque que le gestionnaire ne soit pas en mesure de les vendre aux cours du marché en vigueur. Ainsi, il peut être difficile de modifier considérablement la composition du portefeuille d'un Fonds dans une courte période.

L'échéance de tous les passifs financiers est de moins de trois mois, sauf pour les parts rachetables, lesquelles peuvent être rachetées sur demande au gré du porteur. Le gestionnaire ne s'attend pas à ce que cette échéance contractuelle soit représentative des sorties de trésorerie réelles, car les porteurs de parts conservent généralement ces instruments pour une plus longue période.

Risque de marché

Les placements des Fonds sont exposés au risque de marché, qui est le risque que la juste valeur ou les 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. Sauf pour les options vendues, les contrats à terme standardisés vendus à découvert et les placements vendus à découvert, le risque maximal provenant des instruments financiers est équivalent à leur juste valeur.

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme et, par conséquent, leur exposition à l'autre risque de prix est minime.

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. Par conséquent, les Fonds peuvent être exposés au risque que la valeur des titres libellés dans d'autres devises varie à cause de fluctuations des taux de change. L'inventaire du portefeuille indique toutes les obligations et tous les dérivés qui sont libellés en devises. Les actions négociées sur des marchés étrangers sont aussi exposées à des risques de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle des Fonds afin de déterminer leur juste valeur.

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de change indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers qui sont libellés en devises autres que la monnaie fonctionnelle des Fonds.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt et des dérivés de taux d'intérêt fluctue en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur des Fonds 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 Fonds qui investissent dans des 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.

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de taux d'intérêt indirect, dans le cas où le ou les fonds sous-jacents ou le ou les FNB investissent dans des instruments financiers portant intérêt.

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, les contrats de change à terme, les swaps et les certificats américain de dépôt et les certificats mondiaux d'actions étrangères si aucun cours du marché n'est disponible.

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 leur juste valeur.

Certains Fonds investissent dans d'autres fonds de placement et ces placements sont classés au niveau 1.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

La politique des Fonds consiste à comptabiliser les transferts d'un niveau à l'autre de la hiérarchie à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

11. LÉGENDE DES DEVISES

Voici une liste des abréviations qui peuvent être utilisées dans les états financiers :

AUD	Australian dollar
MXN	Mexican peso
BMD	Bermuda dollar
MYR	Malaysian ringgit
BRL	Brazilian real
NOK	Norwegian krone
CAD	Canadian dollar
NZD	New Zealand dollar
CHF	Swiss franc
PEN	Peruvian new sol
DKK	Danish krone
PHP	Philippine peso
EUR	Euro
PKR	Pakistani rupee
GBP	Pound sterling
PLN	Polish zloty
HKD	Hong Kong dollar
SEK	Swedish krona
IDR	Indonesian rupiah
SGD	Singapore dollar
ILS	Israeli shekel
THB	Thailand baht
INR	Indian rupee
TWD	New Taiwan dollar
JPY	Japanese yen
USD	U.S. dollar
KRW	South Korean won
ZAR	South African rand

Avis juridique

Certains noms, mots, phrases, graphismes ou conceptions graphiques figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Gestion mondiale d'actifs CI.

Fonds CI, Financière CI, Placements CI et le logo Placements CI sont des marques déposées de Gestion mondiale d'actifs CI. Les marques et noms des logos CI et icône CI sont la propriété de Gestion mondiale d'actifs CI et sont utilisés sous licence. Gestion mondiale d'actifs CI est le nom d'une société enregistrée de CI Investments Inc.

Le gestionnaire est autorisé par WisdomTree Investments, Inc. à utiliser et à référencer l'indice WisdomTree Europe CAD-Hedged Equity, l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth CAD, l'indice WisdomTree International Quality Dividend Growth CAD, l'indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend CAD, l'indice WisdomTree Emerging Markets Dividend CAD, l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Variably CAD-Hedged, l'indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Variably CAD-Hedged, l'indice WisdomTree Canada Quality Dividend Growth et l'indice WisdomTree Japan Equity CAD (les « indices WisdomTree ») et les marques WisdomTree dans les fonds (autres que le FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI, le FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI et le FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI) (les « Fonds sous licence WisdomTree »).

« WisdomTree® » et « Variably Hedged® » sont des marques déposées de WisdomTree Investments, Inc., laquelle est en attente de la réponse aux demandes de brevets qu'elle a déposées concernant la méthodologie et le fonctionnement de ses indices. Les Fonds sous licence de WisdomTree ne sont ni cautionnés, ni recommandés, ni vendus, ni promus par WisdomTree Investments, Inc. ou ses sociétés affiliées (« WisdomTree »). WisdomTree ne fait aucune déclaration ni ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant à l'utilité, à la légalité (y compris quant à l'exactitude ou au caractère adéquat des descriptions et des déclarations relatives aux Fonds sous licence de WisdomTree) ou à la pertinence d'investir dans des titres ou d'autres instruments ou produits financiers en général ou dans les Fonds sous licence de WisdomTree en particulier ou quant à l'utilisation des indices WisdomTree ou des données qu'ils comprennent. WisdomTree n'a accordé au gestionnaire que certains droits d'utilisation des indices WisdomTree, qui sont déterminés, composés et calculés par WisdomTree et/ou d'autres tierces parties, sans égard au gestionnaire, aux Fonds sous licence de WisdomTree ou aux investisseurs des Fonds sous licence de WisdomTree, et ni les Fonds sous licence de WisdomTree ni les investisseurs n'établissent quelque relation que ce soit avec WisdomTree en lien avec les Fonds sous licence de WisdomTree. WISDOMTREE NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE QUELLE FAÇON QUE CE SOIT DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE, NOTAMMENT DE L'ÉMISSION, DE L'EXPLOITATION, DE L'ADMINISTRATION, DE LA GESTION, DU RENDEMENT, DU MARKETING OU DE LA DISTRIBUTION DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE OU DU DÉFAUT DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE D'ATTEINDRE LEURS OBJECTIFS DE PLACEMENT RESPECTIFS. LA RESPONSABILITÉ DE WISDOMTREE NE SAURAIT D'AUCUNE FAÇON ÊTRE ENGAGÉE RELATIVEMENT À L'EXACTITUDE, À LA QUALITÉ, À LA CONFORMITÉ, À LA FIABILITÉ, À LA SÉQUENCE, À L'ACTUALITÉ OU AUTRES DES INDICES DE WISDOMTREE OU DES DONNÉES QU'ILS COMPRENNENT. SANS LIMITER LA PORTÉE DE CE QUI PRÉCÈDE, WISDOMTREE NE PEUT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE DOMMAGES PARTICULIERS, INDIRECTS OU ACCESSOIRES, DE DOMMAGES-INTÉRÊTS PUNITIFS OU DE TOUT MANQUE À GAGNER, MÊME SI ELLE AVAIT ÉTÉ AVISÉE DE CETTE POSSIBILITÉ.

« BLOOMBERG® » et l'indice Bloomberg Canadian Aggregate Enhanced Yield et l'indice Bloomberg Canadian Short Aggregate Enhanced Yield (les « indices Bloomberg ») sont des marques de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées, y compris Bloomberg Index Services Limited, l'administrateur des indices Bloomberg (collectivement, « Bloomberg ») et ont fait l'objet d'une licence d'utilisation à certaines fins par le distributeur des présentes (le « titulaire de licence »). Bloomberg n'est pas affilié au titulaire de licence, et Bloomberg n'approuve, n'avalise, n'examine ni ne recommande le FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI ou le FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI (les « produits »). Bloomberg ne garantit pas l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité de toute donnée ou information relative aux produits.

Le « S&P China 500 Index CAD » (« l'indice S&P ») est un produit de S&P Dow Jones Indices LLC ou de ses sociétés affiliées (« SPDJI ») et d'ICBC Credit Suisse Asset Management (International) Company Limited (« ICBCS »), et CI Investments Inc. détient une licence d'utilisation de cet indice. Standard & Poor's® et S&P® sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P »); Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« Dow Jones »). Le FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI n'est ni cautionné, ni recommandé, ni vendu, ni promu par SPDJI, Dow Jones, S&P, leurs sociétés affiliées respectives, ou ICBCS. Aucune de ces parties ne fait de déclaration quant à l'opportunité d'investir dans ces produits et ne saurait être tenue responsable des erreurs, omissions ou interruptions de l'indice S&P.

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires des présents états financiers en composant le 1 800 792-9355, en écrivant à servicefrancais@ci.com ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet du Fonds, est disponible à l'adresse www.ci.com ou à l'adresse www.sedar.com.

Pour plus d'informations, veuillez visit www.ci.com.

SA_F 08/23