



GESTION  
MONDIALE D'ACTIFS

# ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2023

30 JUIN 2023

# Table des matières

FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI.....	1
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI.....	9
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI.....	17
FNB Indice d'actions canadiennes CI.....	28
FNB de FPI canadiennes CI.....	41
FNB alpha Marchés émergents CI.....	51
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI.....	62
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI.....	73
FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy (auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy).....	86
FNB indiciel métavers CI Galaxy (auparavant FNB Métavers CI Galaxy).....	97
FNB alpha Innovation mondiale CI.....	107
FNB Secteur financier mondial CI.....	117
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI.....	128
Fonds de lingots d'or CI.....	140
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI.....	149
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI.....	160
FNB d'épargne à intérêt élevé CI.....	171
FNB d'obligations de qualité supérieure CI.....	179
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI.....	194
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI.....	202
FNB Indice Morningstar International Momentum CI.....	210
FNB Indice Morningstar International Valeur CI.....	226
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI.....	241
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI.....	250
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI.....	261
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI.....	272
FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI (auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI).....	280
FNB d'actions privilégiées CI.....	293
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI.....	305
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI.....	314
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI.....	325
FNB Indice 1000 É.-U. CI.....	335
FNB Indice 500 É.-U. CI.....	354
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI.....	371
FNB Indice Chefs de file américains CI.....	382
FNB de répartition de l'actif équilibré CI.....	391
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI.....	400
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI.....	409
FNB de répartition de l'actif prudent CI.....	418
FNB de répartition de l'actif en actions CI.....	427
FNB de répartition de l'actif de croissance CI.....	436
<b>Notes des états financiers</b> .....	445
<b>Avis juridique</b> .....	463

Le gestionnaire des Fonds, CI Investments Inc., nomme un auditeur indépendant pour qu'il réalise l'audit des états financiers annuels des 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 des 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](mailto:servicefrancais@ci.com) ou au 1 800 792-9355.

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	86 674	106 867
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	27	17
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	7	7
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	86 708	106 891
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	14	20
Comptes créditeurs et charges à payer	19	18
	33	38
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	86 675	106 853

## 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 ordinaires	86 675	106 853	9,74	9,76	8 899 969	10 949 969

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	1 130	984
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	(921)	(1 099)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	995	(5 388)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 204</b>	<b>(5 503)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	7	4
Rabais sur frais	43	22
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>50</b>	<b>26</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 254</b>	<b>(5 477)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	92	124
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	6	12
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>101</b>	<b>142</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 153</b>	<b>(5 619)</b>

## 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 ordinaires	1 153	(5 619)	0,12	(0,45)	9 490 024	12 412 952

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	106 853	133 614
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 153	(5 619)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1 064)	(781)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	(24)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 064)	(805)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	9 409	10 068
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(29 676)	(28 812)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(20 267)	(18 744)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(20 178)	(25 168)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	86 675	108 446

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 153	(5 619)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	921	1 099
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	5
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(995)	5 388
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	451	298
Achat de placements et de dérivés	1 069	1 086
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	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(6)	(4)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
Amortissement des produits d'intérêts	(1 129)	(984)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 467</b>	<b>1 269</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 064)	(805)
Produit de l'émission de parts rachetables	187	237
Montant versé au rachat de parts rachetables	(580)	(692)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 457)</b>	<b>(1 260)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	10	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	17	8
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>27</b>	<b>17</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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 des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans 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
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>				
4 069 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2023	4 056 395	4 046 671	
4 171 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2024	4 105 689	4 045 718	
3 848 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2024	3 750 957	3 637 869	
3 851 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2025	3 710 748	3 563 182	
3 428 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2025	3 302 333	3 105 546	
3 483 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2026	3 321 436	3 095 347	
3 725 000	Hydro Québec, coupon détaché, 15 août 2026	3 494 727	3 251 309	
3 718 000	Hydro Québec, coupon détaché, 15 février 2027	3 447 421	3 198 509	
4 043 883	Hydro Québec, coupon détaché, 15 août 2027	3 474 507	3 416 822	
4 200 403	Hydro Québec, coupon détaché, 15 février 2028	3 535 386	3 486 161	
4 142 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2023	4 097 881	4 058 438	
4 183 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2024	4 086 269	3 996 499	
3 836 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2024	3 713 066	3 579 138	
3 923 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2025	3 752 580	3 584 925	
3 468 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2025	3 320 499	3 105 100	
3 487 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2026	3 306 697	3 068 218	
3 744 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2026	3 486 778	3 238 637	
3 767 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2027	3 465 202	3 207 172	
4 117 616	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2027	3 496 314	3 442 963	
4 263 077	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2028	3 544 701	3 507 658	
		<b>72 469 586</b>	<b>69 635 882</b>	<b>80,3</b>
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>				
4 098 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1 <sup>er</sup> juin 2024	4 014 925	3 919 193	
3 792 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1 <sup>er</sup> juin 2025	3 656 506	3 482 112	
3 369 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1 <sup>er</sup> juin 2026	3 237 018	2 995 091	
3 702 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1 <sup>er</sup> juin 2027	3 453 866	3 202 953	
4 096 874	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1 <sup>er</sup> juin 2028	3 492 971	3 439 077	
		<b>17 855 286</b>	<b>17 038 426</b>	<b>19,7</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>90 324 872</b>	<b>86 674 308</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>90 324 872</b>	<b>86 674 308</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets			274	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>86 674 582</b>	<b>100,0</b>

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 des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	10 949 969	12 949 969
Parts rachetables émises	950 000	1 000 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(3 000 000)	(2 900 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>8 899 969</b>	<b>11 049 969</b>

<sup>†</sup> 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 des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans 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 ordinaires	0,200

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	15 181
Garanties (hors trésorerie)	-	16 006

## 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	10	6
Charges	(3)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	7	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>37,5</b>

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans 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 - Obligations provinciales et obligations garanties	80,3
Obligations - Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	19,7
Autres actifs (passifs) nets	(0,0)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	23,8
AA/Aa/A+	56,0
A	16,1
BB/Ba/B+	4,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	19,7
AA/Aa/A+	80,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

\*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)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	20 066	33 217	33 391	-	86 674

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)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	9 854	44 326	39 822	12 865	106 867

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 546 000 \$ (807 000 \$ 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	-	86 674	-	86 674
<b>Total</b>	-	86 674	-	86 674

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	-	106 867	-	106 867
<b>Total</b>	-	106 867	-	106 867

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 Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	169 350	168 011
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	361	168
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	710	718
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription d'actions	-	-
	170 421	168 897
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	441	470
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 d'actions	-	-
Dividendes à payer aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	90	96
Frais d'administration à payer	11	12
Comptes créditeurs et charges à payer	37	56
	579	634
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	169 842	168 263

## États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre d'actions 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
Actions FNB	169 842	168 263	10,57	10,84	16 071 193	15 521 193

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

# FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes 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 action et le nombre d'actions)

	2023	2022
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 052	3 912
Intérêts aux fins des distributions	22	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	1 419	-
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	(3 078)	25 327
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	830	(45 517)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 245</b>	<b>(16 278)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	16	5
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	25	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>41</b>	<b>5</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 286</b>	<b>(16 273)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	558	769
Frais d'administration (note 5)	72	99
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	70	66
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de titres	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	67	92
Jetons de présence des administrateurs	-	-
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>768</b>	<b>1 027</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	<b>2 518</b>	<b>(17 300)</b>

## 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 action et le nombre d'actions)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre moyen pondéré d'actions :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actions FNB	2 518	(17 300)	0,16	(0,96)	15 699 094	18 009 867

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

# FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	168 263	283 223
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	2 518	(17 300)
<b>Dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>		
Revenu net de placement	(4 658)	(4 026)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(2 125)	(1 753)
<b>Total des dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>	(6 783)	(5 779)
<b>Transactions sur actions rachetables</b>		
Produit de l'émission d'actions rachetables	11 446	7 341
Réinvestissement des dividendes aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Rachat d'actions rachetables	(5 602)	(90 071)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur actions rachetables</b>	5 844	(82 730)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	1 579	(105 809)
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	169 842	177 414

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

# FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	2 518	(17 300)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	3 078	(25 327)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	70	66
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(830)	45 517
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	25 303	37 263
Achat de placements et de dérivés	(23 171)	(34 975)
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	8	748
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(5)	(54)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(1)	(7)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(20)	(1)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>6 950</b>	<b>5 930</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Dividendes versés aux porteurs d'actions rachetables, déduction faite des dividendes réinvestis	(6 782)	(5 779)
Produit de l'émission d'actions rachetables	49	30
Montant versé au rachat d'actions rachetables	(24)	(317)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(6 757)</b>	<b>(6 066)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	193	(136)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	168	230
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>361</b>	<b>94</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 060	4 660
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	22	-
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 Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes 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
<b>ACTIONS ORDINAIRES</b>				
238 199	Banque de Montréal	28 286 323	28 498 128	
426 031	Banque de Nouvelle-Écosse (La)	31 138 814	28 237 335	
482 169	Banque Canadienne Impériale de Commerce	29 000 437	27 271 479	
285 049	Banque Nationale du Canada	22 329 668	28 134 336	
224 468	Banque Royale du Canada	24 502 186	28 399 691	
350 864	Banque Toronto-Dominion (La)	29 566 117	28 809 443	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>164 823 545</b>	<b>169 350 412</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(208 274)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>		<b>164 615 271</b>	<b>169 350 412</b>	<b>99,7</b>
Position(s) vendeur sur option(s)			(441 025)	(0,2)
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>164 615 271</b>	<b>168 909 387</b>	<b>99,5</b>
Autres actifs (passifs) nets			932 728	0,5
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>			<b>169 842 115</b>	<b>100,0</b>

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par		Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
		contrat	Date d'expiration				
(595)	Banque de Montréal, (option d'achat) – 120,00	100	21 juillet 2023	120,00	CAD	(87 168)	(82 408)
(1 205)	Banque Canadienne Impériale de Commerce, (option d'achat) – 57,00	100	21 juillet 2023	57,00	CAD	(36 150)	(59 045)
(712)	Banque Nationale du Canada, (option d'achat) – 96,00	100	21 juillet 2023	96,00	CAD	(64 080)	(236 740)
(561)	Banque Royale du Canada, (option d'achat) – 127,00	100	21 juillet 2023	127,00	CAD	(83 308)	(62 832)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(270 706)</b>	<b>(441 025)</b>

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

# FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes 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	68	60
Paiements indirects <sup>†</sup>	24	26

## Transactions sur actions rachetables (note 4)

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Nombre d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	15 521 193	21 571 193
Actions rachetables émises	1 050 000	550 000
Actions rachetables émises aux fins du réinvestissement des dividendes	-	-
Actions rachetables rachetées	(500 000)	(6 650 000)
<b>Nombre d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	16 071 193	15 471 193

<sup>†</sup> 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 Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Actions FNB	0,650	0,08

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	23	7
Charges	(7)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	16	5
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,7</b>	<b>38,7</b>

# FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions	99,9
Autres actifs (passifs) nets	0,4
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,3</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,3)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,3)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 options.

### 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.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2022), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 16 935 000 \$ (16 801 000 \$ 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

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 options.

## 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	169 350	-	-	169 350
<b>Total</b>	<b>169 350</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>169 350</b>

### Positions vendeur 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)
Option(s)	(441)	-	-	(441)
<b>Total</b>	<b>(441)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(441)</b>

### 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	168 011	-	-	168 011
<b>Total</b>	<b>168 011</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>168 011</b>

### Positions vendeur 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)
Option(s)	(470)	-	-	(470)
<b>Total</b>	<b>(470)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(470)</b>

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'obligations convertibles canadiennes 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	58 161	56 334
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	562	2 682
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	57	42
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	1	1
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	461	448
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	59 242	59 507
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	4
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	31	33
Comptes créditeurs et charges à payer	7	7
	41	44
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>59 201</b>	<b>59 463</b>

## 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 ordinaires	59 201	59 463	9,71	9,59	6 097 245	6 197 245

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	1 495	1 413
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	308	103
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	593	(3 094)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2 396</b>	<b>(1 578)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(5)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	5	6
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>6</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2 396</b>	<b>(1 572)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	191	190
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	5	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	18	18
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>215</b>	<b>214</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 181</b>	<b>(1 786)</b>

## 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 ordinaires	2 181	(1 786)	0,36	(0,30)	6 081 499	5 930 394

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	59 463	61 828
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 181	(1 786)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1 249)	(779)
Profits nets réalisés	-	(653)
Remboursement de capital	(213)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 462)	(1 432)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	481	1 462
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 462)	(2 523)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(981)	(1 061)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(262)	(4 279)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	59 201	57 549

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 181	(1 786)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(308)	(103)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	5	5
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(593)	3 094
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 358	2 569
Achat de placements et de dérivés	(4 228)	(1 901)
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	(13)	(145)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(3)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(599)</b>	<b>1 729</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 462)	(1 432)
Produit de l'émission de parts rachetables	28	62
Montant versé au rachat de parts rachetables	(87)	(116)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 521)</b>	<b>(1 486)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(2 120)	243
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 682	1 061
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>562</b>	<b>1 305</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 483	1 268
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 convertibles canadiennes 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
		<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>			
	2 813 000	Aecon Group Inc., convertibles, 5 %, 31 décembre 2023	2 893 376	2 803 998	
	1 722 000	AG Growth International Inc., convertibles, 5 %, 30 juin 2027	1 753 858	2 152 500	
	1 471 000	AG Growth International Inc., convertibles, 5,2 %, 31 décembre 2027	1 403 758	1 466 587	
	1 532 000	Alaris Equity Partners Income, convertibles, 5,5 %, 30 juin 2024	1 393 951	1 514 995	
	1 366 000	Algoma Central Corp., convertibles, 5,25 %, 30 juin 2024	1 341 155	1 425 558	
USD	768 000	FPI American Hotel Income Properties LP, convertibles, 6 %, 31 décembre 2026	969 134	915 667	
USD	933 000	Argonaut Gold Inc., convertibles, 4,63 %, 30 novembre 2025	1 284 219	1 013 513	
USD	644 000	FPI BSR, convertibles, 5 %, 30 septembre 2025	842 101	853 139	
	1 845 000	Chemtrade Logistics Income Fund, convertibles, 6,25 %, 31 août 2027	1 837 977	1 848 506	
	1 623 000	Chemtrade Logistics Income Fund, convertibles, 7 %, 30 juin 2028	1 620 555	1 605 796	
	790 000	Chorus Aviation Inc., convertibles, 6 %, 30 juin 2026	807 627	764 325	
	2 641 000	Cineplex Inc., convertibles, 5,75 %, 30 septembre 2025	2 872 818	2 648 395	
USD	451 861	Cricket Media Inc., coupon détaché, 21 septembre 2025	75 568	74 825	
	2 660 000	Element Fleet Management Corp., convertibles, 4,25 %, 30 juin 2024	2 933 650	4 588 233	
	1 209 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,25 %, 15 janvier 2029	1 203 176	1 209 000	
	1 118 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,35 %, 30 juin 2025	1 162 201	1 238 744	
	1 682 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,75 %, 31 mars 2026	1 672 370	1 880 140	
	1 984 000	Extendicare Inc., convertibles, 5 %, 30 avril 2025	1 914 618	1 898 688	
USD	701 000	Fortuna Silver Mines Inc., convertibles, 4,65 %, 31 octobre 2024	987 180	886 861	
	1 037 610	GASFRAC Energy Services Inc., convertibles, 7 %, 28 février 2017	-	-	
	2 187 000	Innergex Renewable Energy Inc., convertibles, 4,65 %, 31 octobre 2026	2 282 175	2 012 040	
	2 274 000	Innergex Renewable Energy Inc., convertibles, 4,75 %, 30 juin 2025	2 310 148	2 234 205	
	806 000	Morguard North American Residential REIT, Convertible, 6 %, 31 mars 2028	802 042	789 799	
	1 803 000	Mullen Group Ltd., convertibles, 5,75 %, 30 novembre 2026	1 876 605	2 145 570	
	3 649 000	NFI Group Inc., convertibles, 5 %, 15 janvier 2027	3 527 323	3 056 037	
	832 000	North American Construction Group Ltd., convertibles, 5 %, 31 mars 2026	813 544	989 082	
	1 153 000	North American Construction Group Ltd., convertibles, 5,5 %, 30 juin 2028	1 187 508	1 368 611	
	1 955 000	FPI NorthWest Healthcare Properties, convertibles, 5,5 %, 31 décembre 2023	2 038 071	1 935 255	
	1 643 000	FPI NorthWest Healthcare Properties, convertibles, 6,25 %, 31 août 2027	1 611 632	1 499 238	
	2 257 000	Premium Brands Holdings Corp., convertibles, 4,2 %, 30 septembre 2027	2 495 853	2 098 559	
	2 590 000	Premium Brands Holdings Corp., convertibles, 4,65 %, 30 avril 2025	2 637 704	2 524 991	
	888 000	Quarterhill Inc., convertibles, 6 %, 30 octobre 2026	883 690	812 342	
	1 294 000	Slate Office REIT, convertibles, 5,5 %, 31 décembre 2026	1 246 766	1 002 850	
	1 476 000	StorageVault Canada Inc., convertibles, 5 %, 31 mars 2028	1 475 760	1 438 952	
	1 143 000	Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd., convertibles, 5,5 %, 30 septembre 2024	1 138 895	1 108 710	
	1 008 000	Well Health Technologies Corp., convertibles, 5,5 %, 31 décembre 2026	999 863	926 957	
	1 512 000	WildBrain Ltd., convertibles, 5,88 %, 30 septembre 2024	1 513 528	1 428 689	
			<b>57 810 399</b>	<b>58 161 357</b>	<b>98,2</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>57 810 399</b>	<b>58 161 357</b>	<b>98,2</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(25 639)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>57 784 760</b>	<b>58 161 357</b>	<b>98,2</b>
		Contrat(s) de change à terme		54 423	0,1
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>57 784 760</b>	<b>58 215 780</b>	<b>98,3</b>
		Autres actifs (passifs) nets		985 339	1,7
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>59 201 119</b>	<b>100,0</b>

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 convertibles canadiennes 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) (\$)
Banque de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	337 316	USD	251 100	1,34	4 742
Banque de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	261 504	USD	193 932	1,35	4 647
Banque de Montréal	A-1	15 août 2023	CAD	172 696	USD	127 272	1,36	4 205
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 juillet 2023	CAD	336 621	USD	251 100	1,34	4 047
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	198 032	USD	147 402	1,34	2 892
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	CAD	337 168	USD	251 099	1,34	4 596
Citibank N.A., New York	A-1	15 août 2023	CAD	196 086	USD	147 402	1,33	946
Banque HSBC, Toronto	A-1	18 juillet 2023	CAD	336 715	USD	251 099	1,34	4 142
Banque HSBC, Toronto	A-1	18 juillet 2023	USD	88 000	CAD	119 506	0,74	(2 953)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	172 650	USD	127 272	1,36	4 159
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	336 706	USD	251 100	1,34	4 132
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	59 213	USD	43 653	1,36	1 396
Banque Royale du Canada	A-1+	15 août 2023	CAD	172 659	USD	127 273	1,36	4 166
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	261 617	USD	193 925	1,35	4 769
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	337 033	USD	251 099	1,34	4 460
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	15 août 2023	CAD	172 568	USD	127 272	1,36	4 077
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>54 423</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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	57	(3)	-	54
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>57</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>54</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(3)</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	42	(3)	-	39
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>39</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(4)	3	-	(1)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(4)</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>(1)</b>

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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	5	4
Paiements indirects <sup>†</sup>	2	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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	6 197 245	6 097 245
Parts rachetables émises	50 000	150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(150 000)	(250 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	6 097 245	5 997 245

<sup>†</sup> 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 convertibles canadiennes 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 ordinaires	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	193	251
Garanties (hors trésorerie)	203	265

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB d'obligations convertibles canadiennes 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 - Produits industriels	30,4
Obligations - Immobilier	11,4
Obligations - Matériaux	10,2
Obligations - Services financiers	9,5
Obligations - Biens de consommation de base	7,7
Obligations - Services publics	7,6
Obligations - Services de communication	6,5
Obligations - Énergie	5,3
Autres actifs (passifs) nets	5,2
Obligations - Soins de santé	4,7
Obligations - Technologies de l'information	1,4
Contrat(s) de change à terme	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	82,9
AA/Aa/A+	0,1
BBB/Baa/B++	7,7
B	2,4
Aucune	5,2
<b>Total</b>	<b>98,3</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AA/Aa/A+	0,1
BBB/Baa/B++	14,6
BB/Ba/B+	3,4
B	4,3
Aucune	72,4
<b>Total</b>	<b>94,8</b>

\*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

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	3 798	(3 515)	283	0,5
<b>Total</b>	<b>3 798</b>	<b>(3 515)</b>	<b>283</b>	<b>0,5</b>

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	4 032	(3 712)	320	0,5
<b>Total</b>	<b>4 032</b>	<b>(3 712)</b>	<b>320</b>	<b>0,5</b>

~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 28 000 \$ (32 000 \$ 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

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

au 30 juin 2023

	Plus de				Total
	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)	5 ans (en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	4 739	26 309	22 930	4 183	58 161

au 31 décembre 2022

	Plus de				Total
	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)	5 ans (en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	30 208	22 275	3 851	56 334

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 362 000 \$ (386 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	-	58 086	75	58 161
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	54	-	54
<b>Total</b>	-	58 140	75	58 215

## 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	-	56 258	76	56 334
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	38	-	38
<b>Total</b>	-	56 296	76	56 372

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.

## 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)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Obligations	76	-	-	-	-	-	(1)	75
<b>Total</b>	76	-	-	-	-	-	(1)	75

\*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 30 juin 2023 s'est établie à (1 652 \$).

### 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)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Obligations	71	-	-	-	-	-	5	76
<b>Total</b>	71	-	-	-	-	-	5	76

\*\*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 31 décembre 2022 s'est établie à 5 000 \$.

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 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

# FNB Indice d'actions canadiennes 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	145 120	134 133
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	421	286
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	427	346
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	145 968	134 765
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	6	6
Comptes créditeurs et charges à payer	71	58
	77	64
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>145 891</b>	<b>134 701</b>

## 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 ordinaires non couvertes	145 891	134 701	19,88	19,13	7 339 999

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

# FNB Indice d'actions canadiennes 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 493	1 140
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	235	37
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4 745	(9 244)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>7 481</b>	<b>(8 067)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	1
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	21	9
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>19</b>	<b>10</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>7 500</b>	<b>(8 057)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	36	20
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	22	30
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	5	5
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>64</b>	<b>56</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 436</b>	<b>(8 113)</b>

## 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 ordinaires						
non couvertes	7 436	(8 113)	1,03	(2,02)	7 253 811	4 014 640

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

# FNB Indice d'actions canadiennes 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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	134 701	86 031
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 436	(8 113)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(2 092)	(1 067)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(41)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 133)	(1 067)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	14 923	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(9 036)	(7 674)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	5 887	(7 674)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	11 190	(16 854)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	145 891	69 177

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



# FNB Indice d'actions canadiennes 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 436	(8 113)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(235)	(37)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	22	30
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4 745)	9 244
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5 972	3 224
Achat de placements et de dérivés	(6 158)	(3 361)
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)	37
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	13	18
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>2 224</b>	<b>1 042</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 133)	(1 067)
Produit de l'émission de parts rachetables	86	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(42)	(45)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2 089)</b>	<b>(1 112)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	135	(70)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	286	144
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>421</b>	<b>74</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 412	1 177
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	8	-
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 canadiennes 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
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
2 972	La Société de Gestion AGF Limitée, catégorie B	21 517	23 360	
2 182	Alaris Equity Partners Income	37 205	33 057	
35 569	Banque de Montréal	4 567 369	4 255 475	
59 710	Banque de Nouvelle-Écosse (La)	4 436 422	3 957 579	
17 512	Brookfield Asset Management Ltd., catégorie A	577 535	757 219	
74 149	Brookfield Corp., catégorie A	4 031 093	3 307 045	
441	Brookfield Reinsurance Ltd.	25 777	19 766	
3 271	Groupe Canaccord Genuity Inc.	34 254	27 313	
45 415	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3 044 747	2 568 672	
4 674	Banque Canadienne de l'Ouest	137 607	115 541	
8 101	CI Financial Corp.	148 531	121 839	
4 027	Definity Financial Corp.	139 925	141 549	
11 196	ECN Capital Corp.	50 365	29 893	
19 122	Element Fleet Management Corp.	317 754	385 882	
1 337	EQB Inc.	87 506	93 590	
1 129	Fairfax Financial Holdings Ltd.	785 491	1 120 295	
4 105	Corporation Fiera Capital	36 361	26 518	
628	goeasy Ltd.	89 187	69 444	
13 709	Great-West Lifeco Inc.	481 459	527 385	
1 874	Home Capital Group Inc.	75 907	80 788	
5 183	iA Société financière inc.	388 287	467 766	
4 476	Société financière IGM Inc.	185 549	180 517	
8 762	Intact Corporation financière	1 644 719	1 792 180	
2 163	Banque Laurentienne du Canada	80 450	71 509	
93 088	Société Financière Manuvie	2 271 108	2 330 924	
16 847	Banque Nationale du Canada	1 643 494	1 662 799	
3 151	Nuvei Corp.	229 099	123 267	
3 306	Onex Corp.	252 719	241 900	
26 643	Power Corporation du Canada	985 120	950 089	
69 451	Banque Royale du Canada	9 120 854	8 786 942	
1 051	Sprott Inc.	49 443	45 077	
29 356	Financière Sun Life inc.	1 884 600	2 027 325	
13 813	Groupe TMX Limitée	378 491	411 766	
91 210	Banque Toronto-Dominion (La)	7 984 350	7 489 254	
2 256	Trisura Group Ltd.	94 716	84 758	
		<b>46 319 011</b>	<b>44 328 283</b>	<b>30,4</b>
<b>ÉNERGIE</b>				
8 110	Advantage Energy Ltd.	69 746	70 153	
20 221	Africa Oil Corp.	57 042	57 023	
30 586	ARC Resources Ltd.	452 517	540 455	
29 059	Athabasca Oil Corp.	59 145	83 399	
26 978	Baytex Energy Corp.	131 359	116 545	
13 092	Birchcliff Energy Ltd.	107 743	102 641	
1 382	Bonterra Energy Corp.	11 036	7 725	
21 636	Cameco Corp.	640 454	897 678	
53 993	Canadian Natural Resources Ltd.	3 480 840	4 021 399	
6 036	Cardinal Energy Ltd.	38 081	39 717	
68 155	Cenovus Energy Inc.	1 405 334	1 533 489	
12 283	CES Energy Solutions Corp.	34 042	32 181	
27 339	Crescent Point Energy Corp.	221 691	243 864	
7 009	Crew Energy Inc.	35 318	38 129	
41 139	Denison Mines Corp.	63 384	68 291	
101 337	Enbridge Inc.	5 341 327	4 989 834	
6 156	Enerflex Ltd.	50 491	55 527	
7 742	Energy Fuels Inc.	63 618	63 717	
10 416	Enerplus Corp.	179 854	199 987	

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 canadiennes 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
<b>ÉNERGIE (suite)</b>				
6 891	Ensign Energy Services Inc.	25 213	13 024	
29 381	Fission Uranium Corp.	27 436	17 922	
7 521	Freehold Royalties Ltd.	102 387	101 082	
11 975	Gear Energy Ltd.	15 852	11 496	
7 189	Gibson Energy Inc.	169 446	149 747	
10 596	Headwater Exploration Inc.	62 599	67 285	
8 899	Imperial Oil Ltd.	531 004	603 174	
4 359	International Petroleum Corp. de Suède	64 791	47 295	
2 367	Journey Energy Inc.	12 934	12 947	
7 827	Kelt Exploration Ltd.	37 150	43 753	
11 026	Keyera Corp.	334 218	336 844	
6 273	Logan Energy Corp.	-	63	
6 273	Logan Energy Corp., bons de souscription, 31 juillet 2023	-	63	
12 930	MEG Energy Corp.	195 974	271 530	
20 321	NexGen Energy Ltd.	113 596	127 006	
8 792	NuVista Energy Ltd.	84 204	93 371	
4 023	Obsidian Energy Ltd.	33 754	31 178	
3 818	Paramount Resources Ltd., catégorie A	97 259	109 958	
5 288	Parex Resources Inc.	105 597	140 449	
6 970	Corporation Parkland	221 167	230 010	
4 082	Pason Systems Inc.	51 665	46 902	
27 555	Pembina Pipeline Corp.	1 217 705	1 147 666	
8 294	Peyto Exploration & Development Corp.	95 329	90 902	
10 142	Pipestone Energy Corp.	35 189	23 022	
11 830	PrairieSky Royalty Ltd.	221 780	273 983	
662	Precision Drilling Corp.	50 969	42 812	
15 239	Secure Energy Services Inc.	93 041	96 615	
3 522	ShawCor Ltd.	32 545	67 482	
6 367	Spartan Delta Corp.	75 051	30 243	
1 541	STEP Energy Services Ltd.	8 990	5 024	
66 220	Suncor Énergie Inc.	2 459 535	2 573 309	
3 953	Surge Energy Inc.	32 482	27 829	
25 667	Tamarack Valley Energy Ltd.	104 003	82 391	
50 110	Corporation TC Énergie	3 079 058	2 682 889	
4 529	Topaz Energy Corp.	92 332	93 433	
15 905	Tourmaline Oil Corp.	962 079	992 790	
11 568	Trican Well Service Ltd.	38 677	40 835	
4 967	Valeura Energy Inc.	11 397	9 040	
7 939	Vermilion Energy Inc.	151 835	131 152	
30 161	Whitecap Resources Inc.	260 187	279 592	
		<b>23 751 452</b>	<b>24 307 862</b>	<b>16,7</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
651	ADENTRA Inc.	20 835	21 158	
3 002	Groupe Aecon Inc.	42 404	37 135	
930	AG Growth International Inc.	34 758	47 123	
17 934	Air Canada	375 350	448 171	
4 569	ATS Corp.	207 627	278 481	
1 709	Badger Infrastructure Solutions Ltd.	53 274	45 972	
11 960	Ballard Power Systems Inc.	145 365	69 368	
4 268	Bombardier Inc., catégorie B	194 030	278 743	
1 065	Boyd Group Services Inc.	237 140	269 179	
15 916	CAE Inc.	504 801	471 909	
29 750	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	4 668 697	4 772 495	
46 652	Canadian Pacific Kansas City Ltd.	4 724 213	4 991 764	
834	Cargojet Inc.	128 708	80 247	
10 033	Chorus Aviation Inc.	33 871	30 400	

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 canadiennes 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
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>				
3 464	Doman Building Materials Group Ltd.	22 039	22 689	
2 074	Exchange Income Corp.	97 427	108 698	
7 530	Finning International Inc.	249 825	306 848	
8 913	GFL Environmental Inc.	366 643	458 485	
5 049	Lion Electric Co. (The)	38 044	12 370	
4 373	Mullen Group Ltd.	62 732	66 382	
3 805	NFI Group Inc.	64 745	43 453	
9 067	RB Global Inc.	689 674	720 827	
2 577	Richelieu Hardware Ltd.	102 621	107 976	
3 095	Métaux Russel Inc.	98 383	113 587	
2 527	Savaria Corp.	43 038	42 706	
8 782	Groupe SNC-Lavalin inc.	252 751	305 174	
5 527	Stantec Inc.	363 026	478 030	
3 423	TELUS International (CDA) Inc.	112 058	68 768	
3 875	TFI International Inc.	540 718	584 854	
7 227	Thomson Reuters Corp.	1 133 160	1 292 621	
4 104	Industries Toromont Limitée	430 944	446 638	
12 852	Waste Connections Inc.	2 289 353	2 433 269	
1 821	Westshore Terminals Investment Corp.	45 145	56 888	
6 209	WSP Global Inc.	1 011 131	1 086 699	
		<b>19 384 530</b>	<b>20 599 107</b>	<b>14,1</b>
<b>MATÉRIAUX</b>				
22 898	Mines Agnico Eagle Limitée	1 535 186	1 514 703	
875	AirBoss of America Corp.	16 308	5 994	
19 704	Alamos Gold Inc., catégorie A	231 242	310 929	
4 661	Algoma Steel Group Inc.	48 676	43 627	
1 936	Altius Minerals Corp.	37 415	42 398	
41 581	Argonaut Gold Inc.	34 036	22 038	
4 938	Aya Gold & Silver Inc.	45 112	41 924	
61 142	B2Gold Corp.	297 684	288 590	
87 420	Société aurifère Barrick	1 991 131	1 959 082	
2 941	Canfor Corp.	71 757	69 937	
19 570	Capstone Copper Corp.	96 166	117 616	
3 380	Cascades Inc.	37 601	39 512	
7 221	CCL Industries Inc., catégorie B	476 542	470 232	
10 929	Centerra Gold Inc.	92 293	86 776	
5 764	Chemtrade Logistics Income Fund	47 014	47 207	
9 494	Dundee Precious Metals Inc.	67 410	83 073	
9 191	Eldorado Gold Corp.	95 855	123 251	
9 486	Endeavour Silver Corp.	45 947	36 521	
14 279	Equinox Gold Corp.	86 713	86 674	
3 993	ERO Copper Corp.	76 924	107 012	
3 999	Filo Corp.	66 587	103 214	
13 413	First Majestic Silver Corp.	168 001	100 463	
27 818	First Quantum Minerals Ltd.	781 154	871 816	
14 356	Fortuna Silver Mines Inc.	70 242	61 874	
9 539	Franco-Nevada Corp.	1 784 326	1 801 059	
9 040	Global Atomic Corp.	33 027	26 939	
13 608	GoGold Resources Inc.	31 913	20 684	
16 189	Hudbay Minerals Inc.	110 175	102 800	
8 209	i-80 Gold Corp.	29 578	24 463	
22 666	IAMGOLD Corp.	63 380	79 558	
2 564	Interfor Corp.	66 130	64 049	
28 488	Ivanhoe Mines Ltd., catégorie A	294 669	344 705	
11 087	K92 Mining Inc.	81 690	63 750	
8 536	Karora Resources Inc.	33 403	34 571	

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 canadiennes 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
<b>MATÉRIAUX (suite)</b>				
60 910	Kinross Gold Corp.	376 058	384 951	
3 205	Labrador Iron Ore Royalty Corp.	114 129	99 611	
5 005	Lithium Americas Corp.	148 525	134 184	
430	Lithium Royalty Corp.	6 399	5 680	
4 802	Lundin Gold Inc.	61 190	76 112	
33 828	Lundin Mining Corp.	303 664	351 135	
5 105	MAG Silver Corp.	103 988	75 299	
3 704	Major Drilling Group International Inc.	31 883	33 855	
19 485	Marathon Gold Corp.	26 442	15 783	
3 433	Methanex Corp.	172 284	187 922	
1 797	Neo Performance Materials Inc.	24 031	14 735	
34 080	New Gold Inc.	48 867	49 075	
11 449	NovaGold Resources Inc.	91 547	60 107	
25 018	Nutrien Ltd.	2 388 628	1 956 658	
35 190	OceanaGold Corp.	81 922	91 846	
10 162	Orla Mining Ltd.	51 850	56 501	
9 179	Redevances aurifères Osisko Ltée	149 286	186 884	
15 929	Osisko Mining Inc.	52 540	51 291	
18 199	Pan American Silver Corp.	458 254	351 241	
12 408	Sandstorm Gold Ltd.	91 497	84 250	
3 370	Seabridge Gold Inc.	62 543	53 819	
8 464	Silvercorp Metals Inc.	36 745	31 909	
7 071	SilverCrest Metals Inc.	62 381	54 871	
3 306	Skeena Resources Ltd.	29 763	21 125	
2 328	Solaris Resources Inc.	19 548	13 782	
10 286	SSR Mining Inc.	205 178	193 274	
1 641	Stelco Holdings Inc.	71 200	70 924	
2 977	Stella-Jones Inc.	137 402	203 091	
25 289	Ressources Teck Limitée, catégorie B	1 020 603	1 409 609	
4 290	Torex Gold Resources Inc.	56 752	80 738	
3 609	Transcontinental Inc., catégorie A	68 463	52 908	
8 960	Triple Flag Precious Metals Corp.	207 935	163 341	
1 805	Victoria Gold Corp.	19 240	13 935	
7 105	Wesdome Gold Mines Ltd.	71 980	49 024	
2 744	West Fraser Timber Co., Ltd.	280 643	312 295	
22 635	Wheaton Precious Metals Corp.	1 191 021	1 296 759	
1 539	Winpak Ltd.	65 962	63 422	
		<b>17 435 630</b>	<b>17 548 987</b>	<b>12,0</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
2 579	Absolute Software Corp.	35 582	39 098	
10 510	Bitfarms Ltd.	21 712	20 600	
28 746	BlackBerry Ltd.	252 768	210 996	
5 041	Celestica Inc.	68 939	96 938	
10 503	CGI inc.	1 204 664	1 467 269	
998	Constellation Software Inc.	2 141 012	2 739 270	
9 975	Converge Technology Solutions Corp.	70 389	31 920	
4 236	Descartes Systems Group Inc. (The)	395 591	449 524	
859	Docebo Inc.	52 520	45 046	
2 030	Dye & Durham Ltd.	52 206	36 763	
2 148	Enghouse Systems Ltd.	89 153	69 144	
10 435	Hut 8 Mining Corp.	47 945	45 914	
1 379	Kinaxis Inc.	226 734	261 045	
6 701	Lightspeed Commerce Inc.	385 050	150 169	
13 337	Open Text Corp.	685 592	734 869	
57 767	Shopify Inc., catégorie A	5 668 090	4 946 011	
		<b>11 397 947</b>	<b>11 344 576</b>	<b>7,8</b>

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 canadiennes 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
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
45 696	BCE Inc.	2 915 515	2 760 038	
3 151	Cineplex Inc.	35 025	27 949	
897	Cogeco Communications Inc.	81 065	63 409	
394	Cogeco inc.	24 022	22 013	
9 457	Corus Entertainment Inc., catégorie B	34 961	12 389	
7 674	Québecor Inc., catégorie B	228 304	250 556	
17 584	Rogers Communications Inc., catégorie B	1 080 298	1 062 777	
71 965	TELUS Corp.	2 058 411	1 855 258	
		<b>6 457 601</b>	<b>6 054 389</b>	<b>4,1</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
38 967	Alimentation Couche-Tard Inc.	2 236 312	2 647 028	
7 881	Empire Co., Ltd., catégorie A	299 178	296 562	
3 083	George Weston Limitée	474 454	482 859	
2 065	Jamieson Wellness Inc.	70 958	61 971	
7 317	Les Compagnies Loblaw limitée	784 624	887 406	
3 688	Aliments Maple Leaf Inc.	95 231	95 445	
11 770	Metro inc.	839 410	880 632	
2 380	North West Co., Inc. (The)	86 479	74 732	
2 194	Premium Brands Holdings Corp.	226 365	229 339	
12 155	Saputo inc.	412 343	360 760	
		<b>5 525 354</b>	<b>6 016 734</b>	<b>4,1</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
4 486	Aritzia Inc.	203 440	164 995	
1 094	AutoCanada Inc.	37 644	21 027	
1 773	BRP Inc. du Canada	180 286	198 558	
2 690	Canada Goose Holdings Inc.	88 137	63 430	
2 651	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	445 883	480 149	
14 073	Dollarama Inc.	1 021 314	1 262 630	
8 819	Gildan Activewear Inc.	372 466	376 659	
2 048	Linamar Corp.	137 119	142 582	
13 294	Magna International Inc.	1 174 686	994 258	
3 455	Martinrea International Inc.	40 988	45 779	
985	MTY Food Group Inc.	61 279	59 681	
1 694	Park Lawn Corp.	51 096	41 215	
1 842	Pet Valu Holdings Ltd.	65 398	55 997	
13 873	Restaurant Brands International Inc.	1 173 599	1 424 896	
1 749	Sleep Country Canada Holdings Inc.	47 597	50 214	
1 654	Spin Master Corp.	64 551	57 973	
1 966	Uni-Sélect inc.	65 860	92 500	
		<b>5 231 343</b>	<b>5 532 543</b>	<b>3,8</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
34 183	Algonquin Power & Utilities Corp.	483 673	374 304	
13 997	AltaGas Ltd.	337 176	333 129	
3 688	ATCO Ltd., catégorie I	158 448	145 455	
5 062	Boralex Inc., catégorie A	193 073	182 586	
5 542	Brookfield Infrastructure Corp., catégorie A	321 267	334 792	
6 060	Canadian Utilities Ltd., catégorie A	221 349	207 919	
5 821	Capital Power Corp.	257 652	245 064	
13 588	Emera Inc.	752 842	741 361	
24 247	Fortis Inc.	1 359 077	1 384 261	
15 832	Hydro One Ltd.	548 096	599 241	
7 595	Innervex énergie renouvelable inc.	134 607	93 722	
12 198	Northland Power Inc.	468 677	337 031	
8 221	Superior Plus Corp.	94 885	78 017	
12 582	TransAlta Corp.	158 290	156 017	

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 canadiennes 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
<b>SERVICES PUBLICS (suite)</b>				
5 336	TransAlta Renewables Inc.	86 973	60 724	
		<b>5 576 085</b>	<b>5 273 623</b>	<b>3,6</b>
<b>IMMOBILIER</b>				
6 306	FPI Allied Properties	202 582	136 966	
2 222	Altus Group Ltd.	125 368	97 612	
4 029	Artis REIT	41 968	29 130	
1 850	Boardwalk REIT	92 402	115 051	
8 787	FPI d'immeubles résidentiels canadien	445 903	446 907	
12 966	FPI Propriétés de Choix	188 875	175 949	
1 817	Colliers International Group Inc.	260 736	236 210	
5 226	FPI Crombie	87 980	71 492	
3 655	FPI CT	59 757	55 154	
12 354	FPI industriel Dream	166 398	174 315	
1 282	FPI de bureaux Dream	22 402	16 589	
1 081	Dream Unlimited Corp., catégorie A	30 397	22 301	
10 653	FPI First Capital	181 892	155 746	
1 939	FirstService Corp.	381 039	395 595	
3 172	FPI Granite	265 874	248 621	
13 019	FPI H&R	165 540	133 445	
6 807	InterRent REIT	95 607	87 266	
5 770	Killam Apartment REIT	104 242	101 898	
1 956	Minto Apartment REIT	35 076	29 379	
3 125	Nexus Industrial REIT	32 008	26 500	
10 449	NorthWest Healthcare Properties REIT	113 597	65 620	
4 837	Primaris REIT, série A	70 843	65 154	
15 185	FPI RioCan	325 984	292 767	
2 486	Slate Grocery REIT	35 538	32 393	
6 495	SmartCentres REIT	182 786	157 764	
11 868	StorageVault Canada Inc.	77 990	69 428	
12 910	Tricon Residential Inc.	175 462	150 789	
4 151	True North Commercial REIT	24 328	9 879	
		<b>3 992 574</b>	<b>3 599 920</b>	<b>2,5</b>
<b>SOINS DE SANTÉ</b>				
897	Andlauer Healthcare Group Inc.	45 593	39 917	
16 357	Bausch Health Cos., Inc.	306 419	173 384	
16 185	Canopy Growth Corp.	141 095	8 254	
11 706	Chartwell, résidences pour retraités	113 849	110 856	
10 447	Cronos Group Inc.	54 164	27 267	
5 013	dentalcorp Holdings Ltd.	56 775	36 795	
3 570	Extendicare Inc.	25 730	25 454	
3 635	Sienna Senior Living Inc.	47 585	41 875	
10 530	WELL Health Technologies Corp.	48 807	50 018	
		<b>840 017</b>	<b>513 820</b>	<b>0,4</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>145 911 544</b>	<b>145 119 844</b>	<b>99,5</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(120 334)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>145 791 210</b>	<b>145 119 844</b>	<b>99,5</b>
Autres actifs (passifs) nets			770 840	0,5
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>145 890 684</b>	<b>100,0</b>

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 canadiennes 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	11	4
Paiements indirects <sup>†</sup>	4	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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	7 039 999	4 129 999
Parts rachetables émises	750 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(450 000)	(390 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7 339 999</b>	<b>3 739 999</b>

<sup>†</sup> 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 canadiennes 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 ordinaires non couvertes	0,050

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	1 917
Garanties (hors trésorerie)	-	2 017

## 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	30	14
Charges	(9)	(5)
Revenu tiré des prêts de titres	21	9
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,5</b>	<b>37,9</b>

## Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
CI Financial Corp.	122

Placements	2022
CI Financial Corp.	60

# FNB Indice d'actions canadiennes 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 (%)
Actions - Services financiers	30,3
Actions - Énergie	18,0
Actions - Produits industriels	13,8
Actions - Matériaux	12,4
Actions - Technologies de l'information	5,5
Actions - Services de communication	4,8
Actions - Biens de consommation de base	4,2
Actions - Services publics	3,8
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	3,7
Actions - Immobilier	2,7
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Actions - Soins de santé	0,4
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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	(\$)
Indice Solactive Canada Broad Market	14 452 110

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive Canada Broad Market	13 392 833

### 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	145 120	-	-	145 120
<b>Total</b>	<b>145 120</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>145 120</b>

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	134 133	-	-	134 133
<b>Total</b>	<b>134 133</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>134 133</b>

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 de FPI canadiennes 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	537 816	572 052
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	19 096	16 783
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 466	506
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	2 091	2 157
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	560 469	591 498
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	298	512
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	-	80
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	345	382
Frais d'administration à payer	19	20
Comptes créditeurs et charges à payer	42	95
	704	1 089
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>559 765</b>	<b>590 409</b>

## 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 ordinaires	559 765	590 409	16,04	16,09	34 896 068	36 696 068

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

# FNB de FPI canadiennes 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	11 113	5 818
Intérêts aux fins des distributions	460	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	17 169	12 772
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(12 765)	(167 390)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>15 977</b>	<b>(148 797)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(377)	242
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	37	96
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	48	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(292)</b>	<b>338</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>15 685</b>	<b>(148 459)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2 243	2 744
Frais d'administration (note 5)	119	146
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	118	139
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	132	67
Taxe de vente harmonisée	240	296
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>2 853</b>	<b>3 393</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>12 832</b>	<b>(151 852)</b>

## 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 ordinaires	12 832	(151 852)	0,35	(4,06)	36 236 123	37 416 786

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

# FNB de FPI canadiennes 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	590 409	791 527
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	12 832	(151 852)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(3 611)	(3 307)
Profits nets réalisés	(5 778)	(10 497)
Remboursement de capital	(5 236)	(1 372)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(14 625)</b>	<b>(15 176)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	17 131	32 197
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(45 982)	(22 720)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(28 851)</b>	<b>9 477</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(30 644)</b>	<b>(157 551)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>559 765</b>	<b>633 976</b>

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

# FNB de FPI canadiennes 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	12 832	(151 852)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(17 169)	(12 772)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	74	(290)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	118	139
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	12 765	167 390
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	56 741	56 679
Achat de placements et de dérivés	(46 950)	(47 438)
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	66	1 125
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(37)	(79)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	(4)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(53)	(8)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>18 385</b>	<b>12 890</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(14 626)	(15 176)
Produit de l'émission de parts rachetables	792	1 005
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 164)	(695)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(15 998)</b>	<b>(14 866)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(74)	290
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2 387	(1 976)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	16 783	22 290
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>19 096</b>	<b>20 604</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	11 047	6 875
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	460	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 de FPI canadiennes 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
		<b>IMMOBILIER</b>			
	601 841	FPI Allied Properties	22 957 099	13 071 987	
	1 689 573	American Hotel Income Properties REIT LP	6 444 028	4 004 288	
USD	11 039	American Tower Corp.	3 542 568	2 836 162	
	368 408	Boardwalk REIT	17 303 273	22 911 294	
USD	996 095	BSR REIT	14 586 978	16 930 171	
	544 929	FPI d'immeubles résidentiels canadien	23 006 823	27 715 088	
	1 596 833	FPI Propriétés de Choix	21 552 296	21 669 024	
USD	10 565	Colliers International Group Inc.	1 402 444	1 374 266	
	1 532 714	FPI Crombie	22 468 023	20 967 528	
	1 114 129	FPI CT	16 139 901	16 812 207	
	2 141 617	FPI industriel Dream	20 826 614	30 218 215	
	334 874	FPI de bureaux Dream	5 829 234	4 333 270	
USD	8 258	Equinix Inc.	7 714 699	8 576 135	
	3 184 845	European Residential REIT	13 527 625	9 108 657	
	1 732 455	FPI First Capital	31 398 691	25 328 492	
USD	23 043	First Industrial Realty Trust Inc.	1 598 135	1 606 900	
USD	931 638	Flagship Communities REIT	18 547 882	20 055 546	
	342 153	FPI Granite	23 064 842	26 817 952	
	1 542 265	FPI H&R	22 075 381	15 808 216	
	1 919 085	InterRent REIT	20 726 218	24 602 670	
	1 586 480	Killam Apartment REIT	23 888 321	28 017 236	
	1 454 403	Minto Apartment REIT	27 953 824	21 845 133	
	1 156 728	Morguard North American Residential REIT	15 448 062	19 490 867	
	7 760 667	NexLiving Communities Inc.	1 414 982	1 008 887	
	140 893	Nexus Industrial REIT	1 528 944	1 194 773	
	869 611	NorthWest Healthcare Properties REIT	10 205 701	5 461 157	
	1 207 020	Primaris REIT, série A	18 950 246	16 258 559	
USD	58 283	Prologis Inc.	6 816 383	9 468 312	
	1 258 426	FPI RioCan	29 049 252	24 262 453	
USD	33 666	SBA Communications Corp.	12 005 074	10 336 272	
	2 866 424	StorageVault Canada Inc.	8 963 921	16 768 580	
USD	33 755	Sun Communities Inc.	6 364 054	5 833 772	
	2 261 000	Tricon Residential Inc.	24 016 064	26 408 480	
			<b>501 317 582</b>	<b>501 102 549</b>	<b>89,5</b>
		<b>SOINS DE SANTÉ</b>			
	2 445 900	Chartwell, résidences pour retraités	26 140 458	23 162 673	
	654 974	Sienna Senior Living Inc.	10 714 652	7 545 300	
			<b>36 855 110</b>	<b>30 707 973</b>	<b>5,5</b>
		<b>SERVICES FINANCIERS</b>			
	27 154	Brookfield Asset Management Ltd., catégorie A	574 872	1 174 139	
	108 336	Brookfield Corp., catégorie A	4 111 145	4 831 786	
			<b>4 686 017</b>	<b>6 005 925</b>	<b>1,1</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>542 858 709</b>	<b>537 816 447</b>	<b>96,1</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(1 177 473)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>541 681 236</b>	<b>537 816 447</b>	<b>96,1</b>
		Contrat(s) de change à terme		1 167 669	0,2
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>541 681 236</b>	<b>538 984 116</b>	<b>96,3</b>
		Autres actifs (passifs) nets		20 781 027	3,7
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>559 765 143</b>	<b>100,0</b>

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 de FPI canadiennes 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) (\$)
Banque de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	5 732 581	USD	4 267 371	1,34	80 585
Banque de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	4 444 184	USD	3 295 821	1,35	78 975
Banque de Montréal	A-1	15 août 2023	CAD	4 750 383	USD	3 500 896	1,36	115 671
Banque de Montréal	A-1	13 septembre 2023	CAD	3 022 997	USD	2 221 526	1,36	83 336
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 juillet 2023	CAD	5 720 773	USD	4 267 371	1,34	68 778
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	5 447 318	USD	4 054 617	1,34	79 553
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	499 292	USD	367 197	1,36	13 173
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 septembre 2023	CAD	3 022 442	USD	2 221 526	1,36	82 781
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	CAD	5 730 097	USD	4 267 371	1,34	78 102
Citibank N.A., New York	A-1	15 août 2023	CAD	5 393 777	USD	4 054 618	1,33	26 012
Citibank N.A., New York	A-1	13 septembre 2023	CAD	1 766 269	USD	1 317 251	1,34	23 201
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	15 août 2023	USD	2 012 000	CAD	2 736 244	0,74	(72 629)
Banque HSBC, Toronto	A-1	18 juillet 2023	CAD	5 722 395	USD	4 267 371	1,34	70 399
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	2 387 325	USD	1 777 221	1,34	35 596
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	1 766 289	USD	1 317 251	1,34	23 221
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	15 août 2023	USD	3 310 000	CAD	4 458 090	0,74	(76 098)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	4 749 105	USD	3 500 896	1,36	114 392
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	5 722 224	USD	4 267 371	1,34	70 229
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	1 628 770	USD	1 200 764	1,36	38 397
Banque Royale du Canada	A-1+	15 août 2023	CAD	4 749 315	USD	3 500 896	1,36	114 602
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	4 446 086	USD	3 295 690	1,35	81 050
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	5 727 793	USD	4 267 371	1,34	75 797
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	USD	2 618 000	CAD	3 564 565	0,73	(97 108)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	15 août 2023	CAD	4 746 868	USD	3 500 896	1,36	112 156
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	15 août 2023	USD	2 885 000	CAD	3 871 852	0,75	(52 502)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>1 167 669</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB de FPI canadiennes 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	1 466	(150)	-	1 316
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 466</b>	<b>(150)</b>	<b>-</b>	<b>1 316</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(298)	150	-	(148)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(298)</b>	<b>150</b>	<b>-</b>	<b>(148)</b>

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	506	(215)	-	291
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>506</b>	<b>(215)</b>	<b>-</b>	<b>291</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(512)	215	-	(297)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(512)</b>	<b>215</b>	<b>-</b>	<b>(297)</b>

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

# FNB de FPI canadiennes 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	113	129
Paiements indirects <sup>†</sup>	40	55

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	36 696 068	37 296 068
Parts rachetables émises	1 000 000	1 650 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(2 800 000)	(1 200 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>34 896 068</b>	<b>37 746 068</b>

<sup>†</sup> 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 de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires	0,750	0,04

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	235 332
Garanties (hors trésorerie)	-	247 265

## 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	55	156
Charges	(18)	(60)
Revenu tiré des prêts de titres	37	96
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>33,4</b>	<b>38,5</b>

# FNB de FPI canadiennes 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 (%)
Actions - Immobilier	91,4
Actions - Soins de santé	4,5
Autres actifs (passifs) nets	3,1
Actions - Services financiers	1,0
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 53 782 000 \$ (57 205 000 \$ 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	92 927	(71 378)	21 549	3,8
<b>Total</b>	<b>92 927</b>	<b>(71 378)</b>	<b>21 549</b>	<b>3,8</b>

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	107 593	(88 354)	19 239	3,3
<b>Total</b>	<b>107 593</b>	<b>(88 354)</b>	<b>19 239</b>	<b>3,3</b>

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

### Risque de change (suite)

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 2 155 000 \$ (1 924 000 \$ 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	537 816	-	-	537 816
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 168	-	1 168
<b>Total</b>	<b>537 816</b>	<b>1 168</b>	<b>-</b>	<b>538 984</b>

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	572 052	-	-	572 052
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(6)	-	(6)
<b>Total</b>	<b>572 052</b>	<b>(6)</b>	<b>-</b>	<b>572 046</b>

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 alpha Marchés émergents 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	84 496	67 144
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	962	2 113
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	45	34
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	331	117
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	544
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	85 834	69 952
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	10	11
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	78	1 609
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	60	50
Frais d'administration à payer	12	10
Comptes créditeurs et charges à payer	96	75
	256	1 755
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>85 578</b>	<b>68 197</b>

## 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
Série FNB en \$ CA	84 462	67 097	16,73	16,17	5 050 000	4 150 000
Série FNB couverte en \$ US	1 116	1 100	16,84*	16,25*	50 000	50 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des série FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB alpha Marchés émergents 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 546	590
Intérêts aux fins des distributions	2	-
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	(1 364)	(4 666)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3 077	(4 096)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 261</b>	<b>(8 172)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(73)	(72)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	7	2
Rabais sur frais	257	174
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>192</b>	<b>104</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 453</b>	<b>(8 068)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	349	182
Frais d'administration (note 5)	69	36
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	170	129
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	9
Retenues d'impôts	105	79
Taxe de vente harmonisée	16	8
Autres frais	4	-
<b>Total des charges</b>	<b>714</b>	<b>444</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 739</b>	<b>(8 512)</b>

## 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
Série FNB en \$ CA	2 718	(8 117)	0,56	(3,50)	4 830 110	2 318 508
Série FNB couverte en \$ US	21	(395)	0,42	(4,41)	50 000	89 503

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

# FNB alpha Marchés émergents 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)

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	67 097	40 908	1 100	1 233	68 197	42 141
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 718	(8 117)	21	(395)	2 739	(8 512)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(704)	(156)	(5)	(2)	(709)	(158)
Profits nets réalisés	-	(158)	-	(3)	-	(161)
Remboursement de capital	-	-	-	(1)	-	(1)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(704)	(314)	(5)	(6)	(709)	(320)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	19 583	6 359	-	2 368	19 583	8 727
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(4 232)	-	-	(1 153)	(4 232)	(1 153)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	15 351	6 359	-	1 215	15 351	7 574
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	17 365	(2 072)	16	814	17 381	(1 258)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	84 462	38 836	1 116	2 047	85 578	40 883

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

# FNB alpha Marchés émergents 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 739	(8 512)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 364	4 666
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	9
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	170	129
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3 077)	4 096
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	34 050	22 912
Achat de placements et de dérivés	(50 847)	(29 774)
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	(214)	(58)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	10	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	2	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	10	(9)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(15 795)</b>	<b>(6 541)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(709)	(320)
Produit de l'émission de parts rachetables	19 583	8 727
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4 232)	(1 153)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>14 642</b>	<b>7 254</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	2	(9)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1 153)	713
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 113	164
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>962</b>	<b>868</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 226	454
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(9)
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 alpha Marchés émergents 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
<b>CHINE</b>					
CNY	392 443	Aier Eye Hospital Group Co., Ltd.	1 843 301	1 327 626	
HKD	191 793	Alibaba Group Holding Ltd.	3 308 393	2 632 863	
USD	37 433	Atour Lifestyle Holdings Ltd., CAAE	915 487	805 331	
CNY	1 752 500	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	1 711 796	1 540 495	
CNY	4 943	Kweichow Moutai Co., Ltd.	1 657 687	1 524 366	
USD	30 347	Li Auto Inc., CAAE	950 490	1 411 097	
HKD	105 663	Li Ning Co., Ltd.	1 123 933	752 939	
CNY	162 700	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	882 336	962 847	
HKD	60 900	Meituan, catégorie B	1 697 669	1 259 167	
USD	40 153	MINISO Group Holding Ltd., CAAE	955 080	903 744	
USD	9 468	NetEase Inc., CAAE	1 116 245	1 212 757	
USD	10 102	PDDHoldings Inc., CAAE	1 133 260	925 275	
CNY	459 469	SANY Heavy Industry Co., Ltd.	1 436 633	1 393 489	
HKD	100 047	Tencent Holdings Ltd.	6 132 902	5 608 647	
USD	19 690	Trip.com Group Ltd., CAAE	762 492	912 951	
			<b>25 627 704</b>	<b>23 173 594</b>	<b>27,0</b>
<b>MEXIQUE</b>					
USD	7 548	Coca-Cola FEMSA SAB de CV, CAAE, série L	885 928	833 034	
MXN	282 633	Fomento Económico Mexicano SAB de CV	3 121 948	4 143 163	
MXN	413 741	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	4 045 101	4 509 197	
MXN	541 409	Wal-Mart de Mexico SAB de CV, série V	2 690 934	2 844 707	
			<b>10 743 911</b>	<b>12 330 101</b>	<b>14,4</b>
<b>INDE</b>					
INR	67 409	Axis Bank Ltd.	998 228	1 074 883	
INR	51 524	Dabur India Ltd.	459 677	476 710	
INR	31 097	Housing Development Finance Corp., Ltd.	1 275 402	1 417 085	
INR	66 132	ICICI Bank Ltd.	944 322	998 081	
INR	43 592	Infosys Ltd.	905 616	940 110	
INR	52 725	Larsen & Toubro Ltd.	1 850 124	2 107 737	
INR	6 607	Maruti Suzuki India Ltd.	946 179	1 044 415	
INR	48 590	Reliance Industries Ltd.	2 026 586	2 001 049	
INR	7 671	Shriram Transport Finance Co., Ltd.	191 873	214 946	
INR	22 742	Titan Co., Ltd.	945 806	1 119 237	
INR	607 461	Zomato Ltd.	536 420	736 202	
			<b>11 080 233</b>	<b>12 130 455</b>	<b>14,2</b>
<b>TAÏWAN</b>					
TWD	11 115	Alchip Technologies Ltd.	435 962	848 646	
TWD	105 601	Elite Material Co., Ltd.	801 583	1 093 754	
TWD	36 867	OTES Co., Ltd.	1 275 820	1 348 618	
USD	59 660	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	7 374 263	7 976 170	
			<b>9 887 628</b>	<b>11 267 188</b>	<b>13,2</b>
<b>CORÉE DU SUD</b>					
KRW	83 872	Samsung Electronics Co., Ltd.	5 744 572	6 088 188	7,1
<b>HONG KONG</b>					
HKD	174 105	AIA Group Ltd.	2 366 055	2 328 237	
HKD	73 109	ASMPT Ltd.	951 384	953 556	
HKD	76 199	China Resources Beer (Holdings) Co., Ltd.	787 307	664 720	
HKD	20 484	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	1 194 238	1 022 282	
HKD	72 792	Techtronic Industries Co., Ltd.	1 004 751	1 047 871	
			<b>6 303 735</b>	<b>6 016 666</b>	<b>7,0</b>
<b>BRÉSIL</b>					
BRL	47 536	Banco do Brasil SA	485 339	651 013	
USD	132 728	Petróleo Brasileiro SA, CAAE	2 160 779	2 431 749	
USD	41 350	Vale SA, CAAE	936 725	735 126	
			<b>3 582 843</b>	<b>3 817 888</b>	<b>4,5</b>

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 alpha Marchés émergents 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
<b>INDONÉSIE</b>					
IDR	1 379 969	PT Bank Mandiri (Persero) TBK	561 797	634 063	
IDR	4 857 129	PT Telkom Indonesia (Persero) TBK	1 754 126	1 716 720	
			<b>2 315 923</b>	<b>2 350 783</b>	<b>2,7</b>
<b>SINGAPOUR</b>					
USD	7 432	Sea Ltd., CAAE	857 214	571 435	
SGD	709 851	Singapore Telecommunications Ltd.	1 813 192	1 738 345	
			<b>2 670 406</b>	<b>2 309 780</b>	<b>2,7</b>
<b>THAÏLANDE</b>					
THB	182 612	Bumrungrad Hospital PCL	1 413 494	1 542 035	
THB	79 296	Kasikornbank PCL	484 721	383 687	
			<b>1 898 215</b>	<b>1 925 722</b>	<b>2,3</b>
<b>É.-U.</b>					
USD	809	MercadoLibre Inc.	1 046 925	1 269 563	1,5
<b>CHILI</b>					
USD	12 389	Sociedad Química y Minera de Chile SA, CAAE	1 458 814	1 191 863	1,4
<b>CANADA</b>					
	19 909	First Quantum Minerals Ltd.	598 691	623 948	0,7
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>82 959 600</b>	<b>84 495 739</b>	<b>98,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(137 825)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>82 821 775</b>	<b>84 495 739</b>	<b>98,7</b>
Contrat(s) de change à terme				(10 022)	-
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>82 821 775</b>	<b>84 485 717</b>	<b>98,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				1 092 606	1,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>85 578 323</b>	<b>100,0</b>

## 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+	14 juillet 2023	CAD	4 062	USD	3 065	1,33	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	16 278	USD	12 313	1,32	(31)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	14 669	USD	11 142	1,32	(90)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	14 511	USD	11 042	1,31	(115)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	9 065	CAD	11 969	0,76	38
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	13 859	CAD	18 411	0,75	(54)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	847 437	CAD	1 132 249	0,75	(9 772)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	13 janvier 2023	USD	828 591	CAD	1 132 550	0,73	(10 688)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(10 022)</b>

\*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 alpha Marchés émergents 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	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(10)	-	-	(10)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(10)	-	-	(10)

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(11)	-	-	(11)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(11)	-	-	(11)

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

# FNB alpha Marchés émergents 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	156	94
Paiements indirects <sup>†</sup>	55	40

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	4 150 000	2 100 000	50 000	50 000
Parts rachetables émises	1 150 000	350 000	-	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(250 000)	-	-	(50 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>5 050 000</b>	<b>2 450 000</b>	<b>50 000</b>	<b>100 000</b>

<sup>†</sup> 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 alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série FNB en \$ CA	0,850	0,17
Série FNB couverte en \$ US	0,850	0,17

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	851
Garanties (hors trésorerie)	-	901

## 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	10	3
Charges	(3)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	7	2
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>38,5</b>

# FNB alpha Marchés émergents 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 (%)
Actions - Chine	31,7
Actions - Mexique	11,6
Actions - Taïwan	11,3
Actions - Inde	11,2
Actions - Corée du Sud	6,6
Actions - Hong Kong	5,6
Actions - R.-U.	5,1
Actions - Brésil	4,3
Actions - Indonésie	3,3
Actions - Singapour	2,0
Actions - Thaïlande	1,6
Autres actifs (passifs) nets	1,6
Actions - République tchèque	1,3
Actions - Canada	1,2
Actions - É.-U.	1,0
Actions - Afrique du Sud	0,6
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 (%)
Aucune	2,3
<b>Total</b>	<b>2,3</b>

\*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 principalement investi dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 8 450 000 \$ (6 714 000 \$ 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	21 472	1 103	22 575	26,4
Dollar de Hong Kong	16 384	-	16 384	19,1
Roupie indienne	12 157	-	12 157	14,2
Peso mexicain	11 720	-	11 720	13,7
Renminbi chinois	6 798	-	6 798	7,9
Won coréen	6 114	-	6 114	7,1
Dollar taiwanais	3 291	-	3 291	3,8
Roupie indonésienne	2 414	-	2 414	2,8
Baht thaïlandais	1 926	-	1 926	2,3
Dollar de Singapour	1 738	-	1 738	2,0
Réal brésilien	664	-	664	0,8
<b>Total</b>	<b>84 678</b>	<b>1 103</b>	<b>85 781</b>	<b>100,1</b>

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 de Hong Kong	16 429	-	16 429	24,1
Dollar américain	14 866	1 106	15 972	23,4
Peso mexicain	7 290	-	7 290	10,7
Roupie indienne	6 773	-	6 773	9,9
Won coréen	4 396	-	4 396	6,4
Renminbi chinois	4 287	-	4 287	6,3
Dollar taiwanais	3 421	-	3 421	5,0
Livre sterling	2 517	-	2 517	3,7
Roupie indonésienne	2 252	-	2 252	3,3
Réal brésilien	1 800	-	1 800	2,6
Dollar de Singapour	1 389	-	1 389	2,0
Baht thaïlandais	1 109	-	1 109	1,6
Couronne tchèque	891	-	891	1,3
Rand sud-africain	425	-	425	0,6
Euro	48	-	48	0,1
Peso chilien	7	-	7	0,0
<b>Total</b>	<b>67 900</b>	<b>1 106</b>	<b>69 006</b>	<b>101,0</b>

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

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

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 8 578 000 \$ (6 901 000 \$ 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	84 496	-	-	84 496
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(10)	-	(10)
<b>Total</b>	<b>84 496</b>	<b>(10)</b>	<b>-</b>	<b>84 486</b>

### 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	67 144	-	-	67 144
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(11)	-	(11)
<b>Total</b>	<b>67 144</b>	<b>(11)</b>	<b>-</b>	<b>67 133</b>

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 Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	496 302	534 011
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 495	4 413
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 399	556
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	125	156
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	3 505	2 624
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	9	-
	503 835	541 760
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	11	100
Swaps, options sur swaps et options	1 544	5 107
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	5	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	270	298
Comptes créditeurs et charges à payer	205	224
	2 035	5 729
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>501 800</b>	<b>536 031</b>

## 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 ordinaires couvertes	301 036	325 602	5,75	6,21	52 377 939	52 427 939
Parts ordinaires non couvertes	199 385	208 168	7,23	7,91	27 577 693	26 327 693
Parts ordinaires couvertes en \$ US	1 379	2 261	10,41*	11,13*	100 000	150 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	17 600	20 916
Intérêts aux fins des distributions	87	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	11 073	-
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	17 560	62 193
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(59 169)	28 240
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(12 849)</b>	<b>111 349</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(78)	109
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	63	39
Rabais sur frais	863	1 148
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>849</b>	<b>1 296</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(12 000)</b>	<b>112 645</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 704	1 775
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	472	561
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	2
Retenues d'impôts	1 625	1 726
Taxe de vente harmonisée	82	61
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>3 884</b>	<b>4 125</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(15 884)</b>	<b>108 520</b>

## 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 ordinaires couvertes	(7 903)	42 498	(0,15)	1,01	53 089 541	41 890 646
Parts ordinaires non couvertes	(7 899)	65 985	(0,29)	1,60	27 666 091	41 282 776
Parts ordinaires couvertes en \$ US	(82)	37	(0,56)	0,39	148 619	95 217

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	325 602	166 990	208 168	219 280	2 261	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(7 903)	42 498	(7 899)	65 985	(82)	37
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(7 864)	(5 004)	(3 258)	(5 099)	(43)	(40)
Profits nets réalisés	(7 536)	(12 488)	(7 502)	(13 088)	(54)	-
Remboursement de capital	-	(3)	-	(4)	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(15 400)</b>	<b>(17 495)</b>	<b>(10 760)</b>	<b>(18 191)</b>	<b>(97)</b>	<b>(40)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	89 744	111 948	38 976	99 507	3 672	2 621
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	5 013	-	6 102	-	25
Rachat de parts rachetables	(91 007)	(41 342)	(29 100)	(106 484)	(4 375)	(1 362)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(1 263)</b>	<b>75 619</b>	<b>9 876</b>	<b>(875)</b>	<b>(703)</b>	<b>1 284</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(24 566)</b>	<b>100 622</b>	<b>(8 783)</b>	<b>46 919</b>	<b>(882)</b>	<b>1 281</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>301 036</b>	<b>267 612</b>	<b>199 385</b>	<b>266 199</b>	<b>1 379</b>	<b>1 281</b>
	<b>Total du Fonds</b>					
	<b>2023</b>	<b>2022</b>				
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	536 031	386 270				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(15 884)	108 520				
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(11 165)	(10 143)				
Profits nets réalisés	(15 092)	(25 576)				
Remboursement de capital	-	(7)				
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(26 257)</b>	<b>(35 726)</b>				
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	132 392	214 076				
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	11 140				
Rachat de parts rachetables	(124 482)	(149 188)				
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>7 910</b>	<b>76 028</b>				
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(34 231)</b>	<b>148 822</b>				
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>501 800</b>	<b>535 092</b>				

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(15 884)	108 520
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(17 560)	(62 193)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	50	(5)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	472	561
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	59 169	(28 240)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	141 915	241 298
Achat de placements et de dérivés	(143 095)	(195 063)
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	(881)	(2 339)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(27)	102
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	12	7
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>24 171</b>	<b>62 648</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(26 256)	(24 585)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 034	6 385
Montant versé au rachat de parts rachetables	(817)	(40 276)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(26 039)</b>	<b>(58 476)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(50)	5
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1 868)	4 172
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 413	781
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>2 495</b>	<b>4 958</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	15 094	16 851
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	87	-
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 Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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
<b>É.-U.</b>					
USD	158 577	Chevron Corp.	32 586 808	33 055 283	
USD	238 888	ConocoPhillips Co.	30 122 952	32 789 133	
USD	221 691	EOG Resources Inc.	33 158 806	33 609 329	
USD	236 908	Exxon Mobil Corp.	29 926 158	33 659 755	
USD	186 122	Hess Corp.	33 460 050	33 520 528	
USD	426 524	Occidental Petroleum Corp.	26 838 962	33 224 215	
USD	121 959	Pioneer Natural Resources Co.	31 683 445	33 473 075	
			<b>217 777 181</b>	<b>233 331 318</b>	<b>46,5</b>
<b>R.-U.</b>					
USD	706 730	BP PLC, CAAE	31 827 223	33 039 930	
USD	411 565	Shell PLC, CAAE	29 625 555	32 920 428	
			<b>61 452 778</b>	<b>65 960 358</b>	<b>13,2</b>
<b>CANADA</b>					
	450 236	Canadian Natural Resources Ltd.	30 957 375	33 533 577	
	830 400	Suncor Énergie Inc.	30 751 764	32 269 344	
			<b>61 709 139</b>	<b>65 802 921</b>	<b>13,1</b>
<b>ITALIE</b>					
USD	871 212	Eni SPA, CAAE	30 562 968	33 227 636	6,6
<b>BRÉSIL</b>					
USD	1 810 654	Petróleo Brasileiro SA, CAAE	28 767 167	33 173 522	6,6
<b>FRANCE</b>					
USD	428 885	TotalEnergies SE, CAAE	31 398 916	32 749 054	6,5
<b>NORVÈGE</b>					
USD	828 438	Equinor ASA, CAAE	30 961 901	32 057 193	6,4
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>462 630 050</b>	<b>496 302 002</b>	<b>98,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(544 694)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>462 085 356</b>	<b>496 302 002</b>	<b>98,9</b>
Contrat(s) de change à terme				1 388 407	0,3
Position(s) vendeur sur option(s)				(1 543 883)	(0,3)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>462 085 356</b>	<b>496 146 526</b>	<b>98,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				5 653 652	1,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>501 800 178</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie <sup>a</sup>	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+	24 juillet 2023	CAD	262 698 794	USD	197 321 237	1,33	1 378 839
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	6 958	USD	5 264	1,32	(13)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	255 439	USD	193 145	1,32	(350)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	245 122	USD	185 903	1,32	(1 076)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	241 900	USD	183 951	1,32	(1 713)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	503 510	USD	382 675	1,32	(3 280)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	508 895	USD	387 128	1,31	(3 794)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	3 984 036	CAD	5 266 633	0,76	9 577
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	3 669 746	CAD	4 853 344	0,76	6 638
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	367 902	CAD	483 800	0,76	3 427
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	186 614	CAD	245 886	0,76	1 254
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	3 098	CAD	4 105	0,75	(3)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	184 232	CAD	244 118	0,75	(132)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	137 186	CAD	182 648	0,75	(967)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>1 388 407</b>

<sup>a</sup>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 Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI

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

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par		Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
		contrat						
(1 787)	BP PLC, CAAE, (option d'achat) – 36,00	100		21 juillet 2023	36,00	USD	(176 932)	(97 060)
(1 138)	Canadian Natural Resources Ltd., (option d'achat) – 74,00	100		21 juillet 2023	74,00	CAD	(180 942)	(229 876)
(401)	Chevron Corp., (option d'achat) – 160,00	100		21 juillet 2023	160,00	USD	(183 164)	(89 511)
(604)	ConocoPhillips Co., (option d'achat) – 110,00	100		21 juillet 2023	110,00	USD	(106 049)	(36 007)
(560)	EOG Resources Inc., (option d'achat) – 114,00	100		21 juillet 2023	114,00	USD	(253 572)	(209 575)
(2 095)	Equinor ASA, CAAE, (option d'achat) – 30,91	100		21 juillet 2023	30,91	USD	(149 347)	(41 630)
(599)	Exxon Mobil Corp., (option d'achat) – 110,00	100		21 juillet 2023	110,00	USD	(106 737)	(80 543)
(465)	Hess Corp., (option d'achat) – 140,00	100		21 juillet 2023	140,00	USD	(220 611)	(112 422)
(1 078)	Occidental Petroleum Corp., (option d'achat) – 60,00	100		21 juillet 2023	60,00	USD	(175 043)	(109 962)
(4 580)	Petroleo Brasileiro SA, CAAE, (option d'achat) – 14,00	100		21 juillet 2023	14,00	USD	(311 261)	(257 863)
(308)	Pioneer Natural Resources Co., (option d'achat) – 210,00	100		21 juillet 2023	210,00	USD	(202 492)	(142 808)
(1 041)	Shell PLC, CAAE, (option d'achat) – 62,50	100		21 juillet 2023	62,50	USD	(129 195)	(51 715)
(2 100)	Suncor Énergie Inc., (option d'achat) – 41,00	100		21 juillet 2023	41,00	CAD	(130 200)	(34 650)
(1 084)	TotalEnergies SE, CAAE, (option d'achat) – 60,00	100		21 juillet 2023	60,00	USD	(108 758)	(50 261)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>							<b>(2 434 303)</b>	<b>(1 543 883)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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	1 399	(11)	-	1 388
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 399</b>	<b>(11)</b>	<b>-</b>	<b>1 388</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(11)	11	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(11)</b>	<b>11</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	556	(100)	-	456
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>556</b>	<b>(100)</b>	<b>-</b>	<b>456</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(100)	100	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(100)</b>	<b>100</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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	457	529
Paiements indirects <sup>†</sup>	161	227

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	52 427 939	34 527 939	26 327 693	38 772 693	150 000	-
Parts rachetables émises	14 750 000	19 250 000	5 050 000	13 905 000	250 000	200 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(14 800 000)	(7 200 000)	(3 800 000)	(14 150 000)	(300 000)	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>52 377 939</b>	<b>46 577 939</b>	<b>27 577 693</b>	<b>38 527 693</b>	<b>100 000</b>	<b>100 000</b>

<sup>†</sup> 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 Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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 ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	157
Garanties (hors trésorerie)	-	165

## 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	116	78
Charges	(53)	(39)
Revenu tiré des prêts de titres	63	39
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>45,6</b>	<b>50,5</b>



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - É.-U.	46,5
Actions - Canada	13,4
Actions - R.-U.	13,2
Actions - Brésil	7,2
Actions - France	6,6
Actions - Italie	6,5
Actions - Norvège	6,3
Autres actifs (passifs) nets	1,3
Contrat(s) de change à terme	0,1
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>101,0</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(1,0)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(1,0)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 49 630 000 \$ (53 401 000 \$ 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	433 965	(253 071)	180 894	36,0
<b>Total</b>	<b>433 965</b>	<b>(253 071)</b>	<b>180 894</b>	<b>36,0</b>

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	465,500	(276,750)	188,750	35,2
<b>Total</b>	<b>465,500</b>	<b>(276,750)</b>	<b>188,750</b>	<b>35,2</b>

~ 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 18 089 000 \$ (18 875 000 \$ 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	496 302	-	-	496 302
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 388	-	1 388
<b>Total</b>	<b>496 302</b>	<b>1 388</b>	<b>-</b>	<b>497 690</b>

Positions vendeur 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)
Option(s)	(1 544)	-	-	(1 544)
<b>Total</b>	<b>(1 544)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1 544)</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie 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	534 011	-	-	534 011
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	456	-	456
<b>Total</b>	<b>534 011</b>	<b>456</b>	<b>-</b>	<b>534 467</b>

### Positions vendeur 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)
Option(s)	(5 107)	-	-	(5 107)
<b>Total</b>	<b>(5 107)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(5 107)</b>

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 amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	747 884	699 105
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	14 513	324
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3 071	2 357
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	12
Rabais sur frais à recevoir	189	222
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	443	444
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	4 411	3 856
Montant à recevoir pour la vente de placements	973	4
Montant à recevoir pour la souscription de parts	794	1 385
	772 278	707 709
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	318	234
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	3 407	1 605
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	346	337
Frais d'administration à payer	19	18
Comptes créditeurs et charges à payer	210	270
	4 300	2 464
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>767 978</b>	<b>705 245</b>

## 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 ordinaires couvertes	731 435	684 826	9,97	9,88	73 336 200	69 299 300
Parts ordinaires couvertes en \$ US	36 543	20 419	10,07*	9,95*	2 739 000	1 515 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	10 030	5 676
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	1 008	(15 103)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4 997	(42 828)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>16 035</b>	<b>(52 255)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2 051)	732
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	54	60
Rabais sur frais	1 201	1 233
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	25	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(771)</b>	<b>2 025</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>15 264</b>	<b>(50 230)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2 006	1 867
Frais d'administration (note 5)	109	102
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	8
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	84	70
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>2 204</b>	<b>2 048</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>13 060</b>	<b>(52 278)</b>

## 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 ordinaires couvertes	13 488	(50 800)	0,19	(0,80)	70 179 572	63 761 545
Parts ordinaires couvertes en \$ US	(428)	(1 478)	(0,20)	(0,92)	2 117 967	1 602 983

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	684 826	505 568	20 419	23 550	705 245	529 118
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 488	(50 800)	(428)	(1 478)	13 060	(52 278)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(7 920)	(5 383)	(287)	(109)	(8 207)	(5 492)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	(8)	-	(11)	-	(19)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(7 920)	(5 391)	(287)	(120)	(8 207)	(5 511)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	128 936	501 269	23 930	5 817	152 866	507 086
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(87 895)	(99 991)	(7 091)	(7 157)	(94 986)	(107 148)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	41 041	401 278	16 839	(1 340)	57 880	399 938
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	46 609	345 087	16 124	(2 938)	62 733	342 149
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	731 435	850 655	36 543	20 612	767 978	871 267

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	13 060	(52 278)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 008)	15 103
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	22	(507)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	8
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4 997)	42 828
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	819 659	648 948
Achat de placements et de dérivés	(862 232)	(1 086 607)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	12	(77)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	1	112
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(555)	(2 983)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	8	165
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	9
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(28)	16
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(36 054)</b>	<b>(435 263)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(8 207)	(5 511)
Produit de l'émission de parts rachetables	153 457	507 086
Montant versé au rachat de parts rachetables	(94 985)	(101 327)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>50 265</b>	<b>400 248</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(22)	507
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	14 211	(35 015)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	324	90 835
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>14 513</b>	<b>56 327</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	9 475	2 693
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 amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>					
	22 825 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2026	21 037 216	20 569 086	
	12 389 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	12 459 581	11 394 475	
	34 075 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2030	30 907 486	27 725 452	
	9 870 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 <sup>er</sup> février 2024	9 611 371	9 639 364	
	17 670 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2025	17 308 371	16 735 020	
	15 940 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	14 820 909	14 528 793	
	7 985 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	7 851 906	7 682 642	
	260 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2026	260 016	242 008	
	13 245 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	13 038 466	11 558 727	
	21 150 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2031	18 654 763	18 340 541	
	27 215 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	19 611 239	20 086 328	
	545 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2023	541 621	542 587	
	605 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2028	567 309	563 981	
	43 630 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	39 232 652	39 265 094	
	21 230 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2051	20 001 405	16 808 818	
	590 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 <sup>er</sup> juin 2029	612 233	553 983	
	4 595 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2024	4 517 029	4 495 487	
	16 930 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2032	16 019 661	15 864 036	
	4 850 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> août 2024	4 809 018	4 738 398	
	12 660 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2027	12 363 695	12 166 833	
	28 785 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> juin 2033	27 251 551	27 550 951	
	2 170 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2048	2 633 970	2 026 535	
	370 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	363 799	361 302	
	4 785 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2025	4 677 473	4 639 937	
	43 550 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 <sup>er</sup> mars 2028	43 626 935	43 218 408	
	5 180 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 <sup>er</sup> mai 2025	5 123 072	5 105 306	
			<b>347 902 747</b>	<b>336 404 092</b>	<b>43,8</b>
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES</b>					
USD	8 960 000	Obligation du Trésor américain, 1,88 %, 28 février 2027	11 148 091	10 878 913	
USD	13 930 000	Obligation du Trésor américain, 2,38 %, 31 mars 2029	17 430 573	16 845 550	
USD	3 015 000	Obligation du Trésor américain, 2,38 %, 15 février 2042	3 522 125	3 105 897	
USD	655 000	Obligation du Trésor américain, 2,5 %, 31 mars 2027	824 984	813 073	
USD	2 440 000	Obligation du Trésor américain, 2,63 %, 31 juillet 2029	3 068 103	2 985 542	
USD	2 665 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 30 avril 2027	3 457 349	3 334 491	
USD	3 220 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 31 juillet 2027	4 109 202	4 020 751	
USD	1 170 000	Obligation du Trésor américain, 2,75 %, 15 août 2032	1 446 813	1 420 360	
USD	23 245 000	Obligation du Trésor américain, 3 %, 15 août 2052	25 404 496	26 147 677	
USD	105 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2027	134 848	133 010	
USD	335 000	Obligation du Trésor américain, 3,13 %, 31 août 2029	431 973	421 446	
USD	31 275 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	40 188 002	39 939 373	
USD	2 355 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 30 avril 2028	3 209 408	3 030 458	
USD	10 095 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 février 2033	13 666 120	13 022 301	
USD	930 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2026	1 244 351	1 201 939	
USD	13 930 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mai 2028	18 157 727	18 045 766	
USD	400 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 31 mars 2030	542 925	518 257	
USD	34 350 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	44 938 146	43 613 854	
USD	8 575 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2053	10 935 576	10 900 017	
USD	275 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 30 septembre 2029	370 725	360 635	
USD	5 720 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 30 juin 2028	7 529 299	7 533 170	
USD	3 025 000	Obligation du Trésor américain, 4 %, 31 octobre 2029	4 157 735	3 996 411	
USD	1 735 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 31 janvier 2025	2 312 118	2 262 483	
USD	110 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 30 septembre 2027	151 389	144 883	
USD	48 170 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 15 novembre 2032	67 289 300	65 179 209	
USD	60 000	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 novembre 2025	82 283	79 072	
USD	2 810 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 28 février 2025	3 818 607	3 693 611	

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 amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES (suite)</b>					
USD	5 531 130	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	6 874 873	6 448 715	
USD	2 677 680	Obligation du Trésor américain, indexées sur l'inflation, 0,63 %, 15 juillet 2032	3 365 691	3 259 944	
USD	6 815 555	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,25 %, 15 avril 2028	9 151 864	8 734 116	
			<b>308 964 696</b>	<b>302 070 924</b>	<b>39,3</b>
<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>					
	1 700 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	1 738 812	1 656 418	
USD	80 000	American Tower Corp., 1,45 % 15 septembre 2026	89 690	93 321	
	835 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	838 843	809 872	
	5 110 000	AT&T Inc., 2,85 %, 25 mai 2024	5 118 805	4 987 973	
USD	1 100 000	Bank of America Corp., taux variable, 13 février 2031	1 357 868	1 220 082	
USD	1 095 000	Bank of America Corp., taux variable, 23 juillet 2031	1 265 153	1 155 382	
USD	425 000	Bank of America Corp., taux variable, 21 septembre 2036	502 799	429 891	
	1 710 000	Banque de Montréal, 2,85 %, 6 mars 2024	1 667 540	1 680 700	
	825 000	Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	849 288	781 791	
	490 000	Bell Canada, 2,5 %, 14 mai 2030	499 228	418 506	
	1 935 000	Bell Canada, 2,7 %, 27 février 2024	1 897 461	1 901 411	
	1 455 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	1 395 956	1 394 986	
	760 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	759 901	734 054	
	800 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	798 984	798 887	
	630 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	628 565	569 945	
	1 075 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	1 111 561	1 035 947	
	3 155 000	Canadian Natural Resources Ltd., 1,45 %, 16 novembre 2023	3 125 027	3 111 474	
	4 040 000	Chemin de fer Canadien Pacifique, 1,59 %, 24 novembre 2023	3 935 132	3 981 573	
	1 040 000	La Société Canadian Tire Limitée, 3,17 %, 6 juillet 2023	1 046 993	1 040 058	
USD	1 705 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,3 %, 1 <sup>er</sup> février 2032	1 821 483	1 710 340	
	630 000	FPI Propriétés de Choix, série B, 4,9 %, 5 juillet 2023	629 345	630 119	
	530 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	530 000	482 322	
USD	15 000	Citigroup Inc., 4 %, 5 août 2024	19 945	19 468	
USD	525 000	Citigroup Inc., taux variable, 3 novembre 2032	649 031	560 529	
USD	495 000	Citigroup Inc., taux variable, 25 janvier 2033	628 221	547 431	
	775 000	Corus Entertainment Inc., 5 %, 11 mai 2028	775 000	558 000	
	620 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	620 000	437 875	
USD	975 000	CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15 novembre 2031	1 236 897	901 707	
	830 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	811 494	787 945	
	2 180 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	2 174 640	2 166 785	
	750 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	747 967	745 373	
	800 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	800 000	798 417	
USD	1 105 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1 <sup>er</sup> mars 2028	1 407 418	1 377 145	
	270 000	Gibson Energy Inc., taux variable, 12 juillet 2083	270 000	272 084	
USD	1 030 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 22 avril 2032	1 217 761	1 118 968	
USD	1 275 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 21 juillet 2032	1 496 854	1 353 028	
	2 425 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 3, 3,87 %, 30 novembre 2023	2 414 456	2 407 262	
USD	570 000	Humana Inc., 2,15 %, 3 février 2032	709 738	595 155	
	425 000	Hydro One Inc., 2,16 %, 28 février 2030	436 224	369 078	
	700 000	Inter Pipeline Ltd., 2,61 %, 13 septembre 2023	693 840	696 162	
	1 505 000	JPMorgan Chase & Co., taux flottant, 5 mars 2028	1 457 908	1 324 876	
USD	970 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 4 février 2032	1 127 154	1 023 896	
USD	220 000	Kyndryl Holdings Inc., 2,05 %, 15 octobre 2026	245 944	251 539	
	1 850 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	1 856 346	1 824 001	
USD	350 000	Mattel Inc., 3,75 %, 1 <sup>er</sup> avril 2029	438 238	408 409	
	2 120 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	2 203 022	2 047 396	
	1 895 000	Metro Inc., série J, 1,92 %, 2 décembre 2024	1 840 354	1 803 153	
	3 385 000	Molson Coors International LP, 2,84 %, 15 juillet 2023	3 338 343	3 381 964	
	905 000	Morgan Stanley, 3 %, 7 février 2024	891 506	892 123	

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 amélioré d'obligations gouvernementales 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
<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)</b>					
USD	550 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2025	701 444	706 193	
USD	565 000	Morgan Stanley, taux variable, 22 janvier 2031	638 471	636 734	
USD	370 000	MSCI Inc., 3,25 %, 15 août 2033	454 045	395 255	
USD	2 955 000	Netflix Inc., 3,63 %, 15 juin 2025	3 839 236	3 774 714	
	1 875 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série L, 1,2 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2023	1 811 075	1 844 321	
	3 430 000	OMERS Realty Corp., série 12, 1,3 %, 22 septembre 2023	3 388 277	3 401 538	
	775 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	774 812	719 442	
	500 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	492 155	493 279	
	1 230 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 2,7 %, 30 septembre 2024	1 215 990	1 182 432	
	795 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	771 357	774 494	
	750 000	FPI RioCan, série AA, 3,21 %, 29 septembre 2023	744 000	745 738	
USD	1 800 000	Rogers Communications Inc., 2,95 %, 15 mars 2025	2 297 989	2 264 094	
	520 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	559 408	488 695	
	960 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 13 mars 2024	961 805	949 384	
	2 405 000	Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	2 420 174	2 390 041	
	1 220 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, restreint, 17 décembre 2081	1 220 000	1 109 731	
	1 170 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	1 155 678	1 057 012	
	1 040 000	Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	1 040 000	1 041 408	
	545 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2080	545 000	505 897	
	1 245 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	1 198 537	1 200 648	
USD	405 000	Scripps Escrow II Inc., 3,88 %, 15 janvier 2029	490 008	433 737	
	5 640 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	5 638 080	5 608 610	
	1 395 000	TELUS Corp., 3,35 %, 1 <sup>er</sup> avril 2024	1 369 025	1 372 424	
	145 000	TELUS Corp., série CAA, 3,15 %, 19 février 2030	153 517	129 173	
	2 005 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	2 018 652	1 891 913	
	400 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,9 %, 11 septembre 2028	339 164	343 474	
	940 000	Banque Toronto Dominion (La), série 1, convertibles, taux variable, 31 octobre 2081	940 000	691 597	
	1 205 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	1 253 839	1 146 403	
	4 765 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	4 687 126	4 603 838	
	825 000	United Parcel Service Inc., 2,13 %, 21 mai 2024	824 802	802 438	
USD	470 000	United Rentals North America Inc., 3,88 %, 15 novembre 2027	583 664	580 008	
	1 035 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	1 032 628	884 087	
	1 200 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	1 199 695	920 227	
USD	375 000	Verizon Communications Inc., 4,33 %, 21 septembre 2028	480 267	479 138	
	1 355 000	Vidéotron ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	1 283 783	1 054 359	
	795 000	Vidéotron ltée, 3,63 %, 15 juin 2028	788 906	691 898	
	1 250 000	Walt Disney Co. (The), 3,06 %, 30 mars 2027	1 235 011	1 161 246	
	1 170 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	1 201 684	1 078 165	
	595 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 <sup>er</sup> mai 2026	560 395	560 090	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>114 426 434</b>	<b>109 408 696</b>	<b>14,3</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			-	-	-
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>771 293 877</b>	<b>747 883 712</b>	<b>97,4</b>
Contrat(s) de change à terme			-	2 753 143	0,4
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>771 293 877</b>	<b>750 636 855</b>	<b>97,8</b>
Autres actifs (passifs) nets			-	17 341 575	2,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>771 293 877</b>	<b>767 978 430</b>	<b>100,0</b>

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 amélioré d'obligations gouvernementales 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+	14 juillet 2023	CAD	343 546 402	USD	257 048 540	1,34	3 071 550
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	27 610 633	CAD	36 890 201	0,75	(318 407)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>2 753 143</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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	3 071	(318)	-	2 753
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>3 071</b>	<b>(318)</b>	<b>-</b>	<b>2 753</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(318)	318	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(318)</b>	<b>318</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	2 357	(234)	-	2 123
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2 357</b>	<b>(234)</b>	<b>-</b>	<b>2 123</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(234)	234	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(234)</b>	<b>234</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	69 299 300	45 899 700	1 515 000	1 680 000
Parts rachetables émises	12 779 600	48 393 000	1 744 000	440 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(8 742 700)	(9 907 000)	(520 000)	(540 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>73 336 200</b>	<b>84 385 700</b>	<b>2 739 000</b>	<b>1 580 000</b>

<sup>†</sup> 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 amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires couvertes	0,550	0,03
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,550	0,03

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	347 959
Garanties (hors trésorerie)	-	366 254

## 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	77	97
Charges	(23)	(37)
Revenu tiré des prêts de titres	54	60
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>37,8</b>

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales 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 - Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	41,6
Obligations - Obligations fédérales américaines et obligations garanties	36,2
Obligations - Obligations de sociétés	11,6
Obligations - Obligations étrangères	8,2
Placement(s) à court terme	1,4
Autres actifs (passifs) nets	0,6
Contrat(s) de change à terme	0,3
Obligations - Obligations provinciales et obligations garanties	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	83,5
AA/Aa/A+	0,2
A	3,0
BBB/Baa/B++	9,2
BB/Ba/B+	1,5
B	0,1
Aucune	0,3
<b>Total</b>	<b>97,8</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	78,1
AA/Aa/A+	3,0
A	3,5
BBB/Baa/B++	13,0
BB/Ba/B+	1,9
<b>Total</b>	<b>99,5</b>

\*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

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	339 837	(303 903)	35 934	4,7
<b>Total</b>	<b>339 837</b>	<b>(303 903)</b>	<b>35 934</b>	<b>4,7</b>

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	289 147	(274 196)	14 951	2,1
<b>Total</b>	<b>289 147</b>	<b>(274 196)</b>	<b>14 951</b>	<b>2,1</b>

~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 3 593 000 \$ (1 495 000 \$ 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

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	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	<b>62 560</b>	<b>110 322</b>	<b>128 271</b>	<b>446 731</b>	<b>747 884</b>

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	<b>72 160</b>	<b>116 322</b>	<b>114 120</b>	<b>396 503</b>	<b>699 105</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt (suite)

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 14 101 000 \$ (11 221 000 \$ 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	-	747 884	-	747 884
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 753	-	2 753
<b>Total</b>	-	750 637	-	750 637

### 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	-	689 137	-	689 137
Placement(s) à court terme	-	9 968	-	9 968
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 123	-	2 123
<b>Total</b>	-	701 228	-	701 228

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 indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	691	379
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	-	9
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	-
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	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	692	388
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	1	1
	2	1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	690	387

## 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 ordinaires	690	387	13,80	7,74	50 000	50 000

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



# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1	-
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	(55)	10
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	359	(499)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>305</b>	<b>(489)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	2
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	3	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>2</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>307</b>	<b>(487)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	-	-
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>3</b>	<b>2</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>304</b>	<b>(489)</b>

## 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 ordinaires	304	(489)	6,06	(9,77)	50 000	50 000

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	387	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	304	(489)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	-	-
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(1)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	303	511
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	690	511

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	304	(489)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	55	(10)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(359)	499
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	326	13
Achat de placements et de dérivés	(336)	(1 002)
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	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(8)</b>	<b>(988)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1)</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9)	12
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	9	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>-</b>	<b>12</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	-
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 indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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
<b>É.-U.</b>					
USD	33	Advanced Micro Devices Inc.	3 771	4 974	
USD	33	Alphabet Inc., catégorie A	4 993	5 227	
USD	3 061	Applied Blockchain Inc.	36 207	37 872	
USD	9 585	Bit Digital Inc.	42 839	51 494	
USD	62	Block Inc.	7 377	5 462	
USD	7 275	CleanSpark Inc.	37 471	41 298	
USD	517	Coinbase Global Inc., catégorie A	46 085	48 949	
	8 099	Galaxy Digital Holdings Ltd.	52 312	46 407	
USD	12	Goldman Sachs Group Inc. (The)	4 724	5 122	
USD	29	JPMorgan Chase & Co.	4 712	5 581	
USD	2 965	Marathon Digital Holdings Inc.	27 104	54 379	
USD	62	Micron Technology Inc.	5 397	5 178	
USD	12	Microsoft Corp.	4 462	5 407	
USD	98	MicroStrategy Inc., catégorie A	39 467	44 405	
USD	11	NVIDIA Corp.	2 943	6 157	
USD	63	Paypal Holdings Inc.	6 875	5 563	
USD	2 689	Riot Blockchain Inc.	22 114	42 058	
USD	427	Robinhood Markets Inc., catégorie A	5 444	5 639	
USD	499	SoFi Technologies Inc.	3 805	5 507	
USD	17	Tesla Inc.	6 109	5 889	
USD	18	Visa Inc., catégorie A	5 155	5 656	
USD	99	Western Alliance Bancorp	4 554	4 778	
			<b>373 920</b>	<b>443 002</b>	<b>64,2</b>
<b>CANADA</b>					
USD	25 107	Bitfarms Ltd. of Canada	39 293	48 838	
USD	9 272	HIVE Blockchain Technologies Ltd.	39 660	56 806	
USD	14 475	Hut 8 Mining Corp.	39 953	63 208	
			<b>118 906</b>	<b>168 852</b>	<b>24,5</b>
<b>ÎLES CAÏMANS</b>					
USD	13 907	Canaan Inc., CAAE	63 860	39 197	5,7
<b>CHINE</b>					
HKD	15 959	Meitu Inc.	4 164	7 977	
HKD	95	Tencent Holdings Ltd.	5 282	5 319	
			<b>9 446</b>	<b>13 296</b>	<b>1,9</b>
<b>JAPON</b>					
JPY	1 035	Rakuten Group Inc.	6 098	4 728	
JPY	213	SBI Holdings Inc.	5 575	5 399	
			<b>11 673</b>	<b>10 127</b>	<b>1,5</b>
<b>CORÉE DU SUD</b>					
USD	3	Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	4 825	5 502	0,8
<b>TAÏWAN</b>					
USD	41	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	4 996	5 475	0,8
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	72	Aker ASA, catégorie A	6 877	5 411	0,8
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>594 503</b>	<b>690 862</b>	<b>100,2</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(1 967)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>592 536</b>	<b>690 862</b>	<b>100,2</b>
Contrat(s) de change à terme				224	-
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>592 536</b>	<b>691 086</b>	<b>100,2</b>
Autres actifs (passifs) nets				(1 296)	(0,2)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>689 790</b>	<b>100,0</b>

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 indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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+	5 juillet 2023	CAD	6 810	HKD	40 258	0,17	12
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	3 636	JPY	384 757	0,01	113
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	3 745	NOK	29 688	0,13	78
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	505 184	USD	381 850	1,32	(100)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	HKD	40 258	CAD	6 805	5,92	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	JPY	384 757	CAD	3 524	109,18	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	NOK	29 688	CAD	3 649	8,14	18
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	381 850	CAD	505 849	0,75	(566)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	13 650	HKD	80 747	0,17	14
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	9 948	JPY	1 081 734	0,01	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	5 299	NOK	43 084	0,12	(26)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	599 221	USD	452 528	1,32	687
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>224</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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	1	(1)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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	1	1
Paiements indirects <sup>†</sup>	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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	-
Parts rachetables émises	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	50 000

<sup>†</sup> 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 indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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 ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	4	-
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	3	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,5</b>	<b>-</b>



# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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 (%)
Actions - É.-U.	82,0
Actions - Îles Caïmans	9,6
Actions - Chine	2,5
Autres actifs (passifs) nets	2,3
Actions - Norvège	1,3
Actions - Taïwan	1,2
Actions - Canada	1,2
Contrat(s) de change à terme	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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 Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity (couvert en \$ CA)	69 077

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity (couvert en \$ CA)	37 828

### 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)		
Dollar américain	616	(599)	17	2,5
Yen japonais	10	(10)	-	0,0
Couronne norvégienne	5	(5)	-	0,0
Dollar de Hong Kong	13	(14)	(1)	(0,1)
<b>Total</b>	<b>644</b>	<b>(628)</b>	<b>16</b>	<b>2,4</b>

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)		
Couronne norvégienne	7	(7)	-	0,0
Dollar de Hong Kong	11	(16)	(5)	(1,3)
Dollar américain	326	(356)	(30)	(7,8)
<b>Total</b>	<b>344</b>	<b>(379)</b>	<b>(35)</b>	<b>(9,1)</b>

~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 2 000 \$ (4 000 \$ 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	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	691	-	-	691
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>691</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>691</b>

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

(auparavant FNB Chaîne de blocs CI Galaxy)

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	379	-	-	379
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>379</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>379</b>

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 indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	1 050	826
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	-	1
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2	-
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	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	1 052	827
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	1	1
	2	4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 050	823

## 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 ordinaires	1 050	823	21,00	16,46	50 000

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	5	1
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	53	10
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	175	(136)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>233</b>	<b>(125)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	2
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>233</b>	<b>(123)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	1	-
Taxe de vente harmonisée	-	-
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>4</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>229</b>	<b>(124)</b>

## 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 ordinaires	229	(124)	4,58	(2,48)	50 000	50 000

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	823	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	229	(124)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(1)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	227	876
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 050	876

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	229	(124)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(53)	(10)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(175)	136
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	204	12
Achat de placements et de dérivés	(205)	(997)
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	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1</b>	<b>(983)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2)</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	17
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>-</b>	<b>17</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	1
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 indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	171	Activision Blizzard Inc.	17 040	19 075	
USD	112	Alphabet Inc., catégorie A	16 605	17 740	
USD	852	AT&T Inc.	20 240	17 982	
USD	860	Bilibili Inc., CAAE	23 061	17 184	
USD	108	Electronic Arts Inc.	17 152	18 536	
HKD	1 888	Kuaishou Technology	18 538	17 072	
USD	7 688	Lumen Technologies Inc.	24 579	22 991	
USD	350	Match Group Inc.	27 468	19 382	
USD	52	Meta Platforms Inc., catégorie A	12 386	19 747	
USD	148	NetEase Inc., CAAE	16 771	18 936	
JPY	692	Nexon Co., Ltd.	18 357	17 403	
USD	352	ROBLOX Corp., catégorie A	15 276	18 771	
USD	215	Sea Ltd., CAAE	20 429	16 512	
USD	643	SK Telecom Co., Ltd., CAAE	17 671	16 600	
USD	1 363	Snap Inc., catégorie A	28 602	21 355	
USD	103	Take-Two Interactive Software Inc.	16 114	20 057	
HKD	320	Tencent Holdings Ltd.	17 771	17 918	
USD	1 794	Tencent Music Entertainment, CAAE	11 277	17 519	
USD	105	T-Mobile US Inc.	18 092	19 299	
EUR	484	Ubisoft Entertainment SA	23 001	18 083	
EUR	664	Universal Music Group NV	19 274	19 507	
USD	386	Verizon Communications Inc.	22 340	18 996	
USD	148	Walt Disney Co. (The)	20 290	17 485	
USD	552	Warner Music Group Corp., catégorie A	20 884	19 057	
			<b>463 218</b>	<b>447 207</b>	<b>42,6</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	31	Adobe Inc.	16 112	20 059	
USD	113	Advanced Micro Devices Inc.	12 556	17 033	
USD	148	Akamai Technologies Inc.	20 304	17 600	
USD	76	Apple Inc.	15 906	19 507	
USD	68	Autodesk Inc.	17 407	18 411	
USD	217	CloudFlare Inc., catégorie A	19 176	18 771	
USD	810	Fastly Inc., catégorie A	15 637	16 903	
USD	430	Intel Corp.	22 817	19 027	
USD	102	International Business Machines Corp.	17 743	18 061	
HKD	14 298	Lenovo Group Ltd.	17 176	19 725	
USD	229	Marvell Technology Inc.	12 726	18 115	
USD	42	Microsoft Corp.	15 555	18 926	
USD	3 430	Nokia OYJ, CAAE	20 981	18 881	
USD	36	NVIDIA Corp.	8 788	20 151	
USD	100	PTC Inc.	14 846	18 830	
USD	396	Pure Storage Inc., catégorie A	14 875	19 294	
USD	118	QUALCOMM Inc.	21 586	18 587	
USD	10	Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	16 469	18 340	
USD	130	Skyworks Solutions Inc.	18 909	19 041	
USD	54	Super Micro Computer Inc.	6 376	17 810	
USD	137	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	16 600	18 295	
USD	377	Unity Software Inc.	23 039	21 661	
			<b>365 584</b>	<b>413 028</b>	<b>39,3</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	210	Block Inc.	23 326	18 499	
USD	249	Coinbase Global Inc., catégorie A	19 524	23 575	
USD	37	Mastercard Inc., catégorie A	17 991	19 256	
USD	61	Visa Inc., catégorie A	17 409	19 169	
			<b>78 250</b>	<b>80 499</b>	<b>7,7</b>

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 indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	159	Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	18 502	17 536	
USD	110	Amazon.com Inc.	17 776	18 975	
USD	535	DraftKings Inc., catégorie A	9 704	18 810	
JPY	142	Sony Group Corp.	15 564	16 855	
			<b>61 546</b>	<b>72 176</b>	<b>6,9</b>
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	18	Equinix Inc.	17 348	18 672	
USD	680	eXp World Holdings Inc.	11 669	18 248	
			<b>29 017</b>	<b>36 920</b>	<b>3,5</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>997 615</b>	<b>1 049 830</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(646)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>996 969</b>	<b>1 049 830</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme				1 076	0,1
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>996 969</b>	<b>1 050 906</b>	<b>100,1</b>
Autres actifs (passifs) nets				(925)	(0,1)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>1 049 981</b>	<b>100,0</b>

## 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+	5 juillet 2023	CAD	31 906	EUR	22 017	1,45	120
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	45 626	HKD	269 732	0,17	81
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	30 245	JPY	3 200 350	0,01	945
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	850 761	USD	643 060	1,32	(168)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	EUR	22 017	CAD	31 756	0,69	30
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	HKD	269 732	CAD	45 592	5,92	(46)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	JPY	3 200 350	CAD	29 313	109,18	(13)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	643 060	CAD	851 882	0,75	(953)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	37 568	EUR	26 021	1,44	(37)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	56 535	HKD	334 431	0,17	56
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	34 942	JPY	3 799 591	0,01	10
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	917 387	USD	692 805	1,32	1 051
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>1 076</b>

\*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 indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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	2	(1)	-	1
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>1</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	-	-	(3)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3)</b>

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	-
Parts rachetables émises	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	50 000

<sup>†</sup> 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 indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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 ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

(auparavant FNB Métavers CI Galaxy)

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 (%)
Actions - Technologies de l'information	45,8
Actions - Services de communication	42,4
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	7,0
Actions - Immobilier	3,6
Actions - Services financiers	1,6
Autres actifs (passifs) nets	0,0
Contrat(s) de change à terme	(0,4)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, l'exposition directe 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 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	(\$)
Indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds (couvert en \$ CA)	104 980

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds (couvert en \$ CA)	82 543

### Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les actifs du Fonds étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, le Fonds n'avait aucune exposition au risque de change.

### 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	1 050	-	-	1 050
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1	-	1
<b>Total</b>	<b>1 050</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>1 051</b>

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	826	-	-	826
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(3)	-	(3)
<b>Total</b>	<b>826</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>823</b>

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 alpha Innovation mondiale 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	2 657	2 417
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	117	81
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	1
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	2
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	2 775	2 501
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	10	13
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
Frais d'administration à payer	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	8	8
	20	23
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 755</b>	<b>2 478</b>

## 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
Série FNB en \$ CA	1 646	1 222	16,46	12,22	100 000	100 000
Série FNB couverte en \$ US	1 109	1 256	16,74*	12,38*	50 000	75 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des série FNB couverte en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB alpha Innovation mondiale 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	7	13
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	(52)	(3 141)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	851	(1 085)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>807</b>	<b>(4 213)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(3)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	19
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1</b>	<b>16</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>808</b>	<b>(4 197)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	10	33
Frais d'administration (note 5)	2	7
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	10
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	1	2
Taxe de vente harmonisée	2	2
Autres frais	5	-
<b>Total des charges</b>	<b>23</b>	<b>55</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>785</b>	<b>(4 252)</b>

## 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
Série FNB en \$ CA	424	(3 355)	4,24	(8,48)	100 000	395 718
Série FNB couverte en \$ US	361	(897)	5,89	(9,35)	61 326	95 856

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

# FNB alpha Innovation mondiale 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)

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 222	12 718	1 256	1 932	2 478	14 650
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	424	(3 355)	361	(897)	785	(4 252)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	-	(21)	-	-	-	(21)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	(21)	-	-	-	(21)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 174	-	955	-	2 129
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(9 027)	(508)	(832)	(508)	(9 859)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	(7 853)	(508)	123	(508)	(7 730)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	424	(11 229)	(147)	(774)	277	(12 003)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 646	1 489	1 109	1 158	2 755	2 647

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

# FNB alpha Innovation mondiale 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	785	(4 252)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	52	3 141
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	10
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(851)	1 085
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	904	10 473
Achat de placements et de dérivés	(784)	(2 756)
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	-	(8)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>110</b>	<b>7 694</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-	(21)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 843
Montant versé au rachat de parts rachetables	(74)	(9 860)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(74)</b>	<b>(8 038)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	36	(344)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	81	506
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>117</b>	<b>162</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6	14
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 alpha Innovation mondiale 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
<b>É.-U.</b>					
USD	415	Activision Blizzard Inc.	40 936	46 346	
USD	99	Adobe Inc.	42 157	64 131	
USD	715	Advanced Micro Devices Inc.	104 513	107 895	
USD	751	Alphabet Inc., catégorie C	117 156	120 352	
USD	810	Amazon.com Inc.	131 612	139 881	
USD	296	Ambarella Inc.	54 214	32 809	
USD	181	Analog Devices Inc.	45 971	46 711	
USD	527	Apple Inc.	109 117	135 419	
USD	252	Arista Networks Inc.	38 059	54 102	
USD	93	Danaher Corp.	33 877	29 568	
USD	638	Edwards Lifesciences Corp.	83 230	79 727	
USD	84	Eli Lilly and Co.	48 629	52 188	
	3 474	Galaxy Digital Holdings Ltd.	83 196	19 906	
USD	88	Intuitive Surgical Inc.	32 969	39 863	
USD	180	IQVIA Holdings Inc.	48 829	53 598	
USD	85	Lam Research Corp.	43 214	72 388	
USD	1 011	Marvell Technology Inc.	77 997	80 065	
USD	116	Mastercard Inc., catégorie A	53 910	60 439	
USD	274	Meta Platforms Inc., catégorie A	62 259	104 168	
USD	296	Microsoft Corp.	106 577	133 535	
USD	241	NVIDIA Corp.	91 621	135 055	
USD	810	ON Semiconductor Corp.	59 028	101 489	
USD	299	Palo Alto Networks Inc.	65 447	101 208	
USD	103	Salesforce Inc.	20 553	28 826	
USD	120	ServiceNow Inc.	71 053	89 336	
USD	109	Thermo Fisher Scientific Inc.	75 463	75 340	
USD	209	Zoetis Inc.	48 822	47 680	
			<b>1 790 409</b>	<b>2 052 025</b>	<b>74,6</b>
<b>CANADA</b>					
	223	Kinaxis Inc.	34 600	42 214	
	1 765	Lightspeed Commerce Inc.	70 662	39 554	
USD	887	Shopify Inc., catégorie A	92 523	75 908	
			<b>197 785</b>	<b>157 676</b>	<b>5,7</b>
<b>JAPON</b>					
JPY	100	Keyence Corp.	75 205	62 292	
JPY	300	Lasertec Corp.	86 830	59 423	
			<b>162 035</b>	<b>121 715</b>	<b>4,4</b>
<b>FRANCE</b>					
EUR	215	Capgemini SE	62 348	53 939	
EUR	1 099	Dassault Systemes SE	78 357	64 540	
			<b>140 705</b>	<b>118 479</b>	<b>4,3</b>
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	63	ASML Holding NV	55 960	60 380	
USD	198	NXP Semiconductors NV	48 355	53 688	
			<b>104 315</b>	<b>114 068</b>	<b>4,1</b>
<b>TAÏWAN</b>					
USD	698	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	85 186	93 318	3,4
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>2 480 435</b>	<b>2 657 281</b>	<b>96,5</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(635)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>2 479 800</b>	<b>2 657 281</b>	<b>96,5</b>
		Contrat(s) de change à terme		(9 934)	(0,4)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>2 479 800</b>	<b>2 647 347</b>	<b>96,1</b>
		Autres actifs (passifs) nets		107 244	3,9
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>2 754 591</b>	<b>100,0</b>

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 alpha Innovation mondiale 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+	14 juillet 2023	CAD	13 889	USD	10 518	1,32	(43)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	13 937	USD	10 610	1,31	(116)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	23 691	USD	18 028	1,31	(188)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	14 988	CAD	19 818	0,76	34
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	10 629	CAD	14 153	0,75	(74)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	20 318	CAD	27 120	0,75	(208)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	809 790	CAD	1 081 949	0,75	(9 339)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(9 934)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB alpha Innovation mondiale 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	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(10)	-	-	(10)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(10)	-	-	(10)

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	1	(1)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	1	(1)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(13)	1	-	(12)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(13)	1	-	(12)

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

# FNB alpha Innovation mondiale 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	1	6
Paiements indirects <sup>†</sup>	-	3

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	625 000	75 000	75 000
Parts rachetables émises	-	75 000	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(575 000)	(25 000)	(50 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	125 000	50 000	75 000

<sup>†</sup> 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 alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série FNB en \$ CA	0,800	0,17
Série FNB couverte en \$ US	0,800	0,17

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	311
Garanties (hors trésorerie)	-	331

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB alpha Innovation mondiale 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 (%)
Actions - É.-U.	72,1
Actions - Japon	9,7
Actions - France	5,2
Actions - Canada	3,7
Actions - Taïwan	3,4
Autres actifs (passifs) nets	3,0
Actions - Allemagne	2,3
Actions - R.-U.	1,1
Contrat(s) de change à terme	(0,5)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 266 000 \$ (242 000 \$ 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	2 269	1 082	3 351	121,6
Euro	180	-	180	6,5
Yen japonais	122	-	122	4,4
<b>Total</b>	<b>2 571</b>	<b>1 082</b>	<b>3 653</b>	<b>132,5</b>

## 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	1 917	1 265	3 182	128,4
Yen japonais	249	-	249	10,0
Euro	190	-	190	7,7
Livre sterling	28	-	28	1,1
<b>Total</b>	<b>2 384</b>	<b>1 265</b>	<b>3 649</b>	<b>147,2</b>

~ 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 365 000 \$ (365 000 \$ 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	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	2 657	-	-	2 657
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(10)	-	(10)
<b>Total</b>	<b>2 657</b>	<b>(10)</b>	<b>-</b>	<b>2 647</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	2 417	-	-	2 417
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(12)	-	(12)
<b>Total</b>	<b>2 417</b>	<b>(12)</b>	<b>-</b>	<b>2 405</b>

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 Secteur financier mondial 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	493 888	790 473
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	-	10 137
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 509	1 407
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	338	575
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	291
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	4 224	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	499 959	802 883
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	1 799	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	845	1 571
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	2 586	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	345	584
Frais d'administration à payer	37	62
Comptes créditeurs et charges à payer	433	707
	6 045	2 924
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	493 914	799 959

## 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 ordinaires	493 914	799 959	21,26	21,43	23 230 113	37 330 113

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

# FNB Secteur financier mondial 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	12 807	21 928
Intérêts aux fins des distributions	127	-
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	(34 737)	22 467
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	29 285	(249 618)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>7 482</b>	<b>(205 223)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(274)	(1 422)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	34	58
Rabais sur frais	2 732	4 617
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	19	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>2 511</b>	<b>3 253</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>9 993</b>	<b>(201 970)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2 780	4 685
Frais d'administration (note 5)	294	496
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	858	2 472
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	34
Retenues d'impôts	862	1 359
Taxe de vente harmonisée	33	57
Autres frais	16	-
<b>Total des charges</b>	<b>4 844</b>	<b>9 104</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 149</b>	<b>(211 074)</b>

## 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 ordinaires	5 149	(211 074)	0,17	(4,47)	30 216 301	47 177 130

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



# FNB Secteur financier mondial 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	799 959	1 231 735
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 149	(211 074)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(7 401)	(4 938)
Profits nets réalisés	-	(23 191)
Remboursement de capital	(4 306)	(56)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(11 707)</b>	<b>(28 185)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	8 217	56 014
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	16 890
Rachat de parts rachetables	(307 704)	(317 398)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(299 487)</b>	<b>(244 494)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(306 045)</b>	<b>(483 753)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>493 914</b>	<b>747 982</b>

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

# FNB Secteur financier mondial 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 149	(211 074)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	34 737	(22 467)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(8)	53
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	858	2 472
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(29 285)	249 618
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	483 694	964 967
Achat de placements et de dérivés	(195 884)	(772 720)
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	291	29
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(239)	(201)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(25)	(21)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(37)	3
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>299 251</b>	<b>210 659</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(11 708)	(11 296)
Produit de l'émission de parts rachetables	8 217	57 506
Montant versé au rachat de parts rachetables	(307 704)	(256 395)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(311 195)</b>	<b>(210 185)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	8	(53)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(11 944)	474
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	10 137	22 200
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>(1 799)</b>	<b>22 621</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	12 235	20 599
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	127	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(34)
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 Secteur financier mondial 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
<b>É.-U.</b>					
USD	70 093	American Express Co.	13 094 449	16 175 463	
USD	43 932	Arthur J. Gallagher & Co.	11 072 469	12 778 736	
USD	466 077	Bank of America Corp.	19 223 155	17 714 225	
USD	44 982	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	17 185 520	20 320 157	
USD	15 743	BlackRock Inc.	13 515 334	14 414 097	
USD	124 156	Citigroup Inc.	7 682 242	7 572 459	
USD	37 959	CME Group Inc.	10 143 313	9 317 527	
USD	71 232	East West Bancorp Inc.	6 306 676	4 981 507	
USD	361 310	Equitable Holdings Inc.	12 704 865	13 000 010	
USD	38 278	Intercontinental Exchange Inc.	5 453 642	5 734 149	
USD	154 374	JPMorgan Chase & Co.	24 256 057	29 743 493	
USD	48 232	Marsh & McLennan Cos., Inc.	10 230 016	12 017 436	
USD	48 698	Mastercard Inc., catégorie A	22 292 961	25 372 835	
USD	24 517	Moody's Corp.	9 333 457	11 293 562	
USD	51 754	Morgan Stanley	5 089 559	5 855 119	
USD	61 987	Progressive Corp. (The)	10 409 225	10 869 864	
USD	22 610	S&P Global Inc.	10 207 971	12 007 697	
USD	76 202	Visa Inc., catégorie A	22 444 836	23 973 273	
USD	330 700	Wells Fargo & Co.	18 335 171	18 697 887	
			<b>248 980 918</b>	<b>271 839 496</b>	<b>55,1</b>
<b>CANADA</b>					
	52 245	Brookfield Asset Management Ltd., catégorie A	1 532 703	2 259 074	
	209 029	Brookfield Corp., catégorie A	11 242 387	9 322 693	
	141 538	Banque Royale du Canada	17 782 884	17 907 388	
	80 431	Financière Sun Life inc.	5 264 474	5 554 565	
	122 581	Banque Toronto-Dominion (La)	10 189 687	10 065 126	
			<b>46 012 135</b>	<b>45 108 846</b>	<b>9,1</b>
<b>R.-U.</b>					
GBP	736 700	HSBC Holdings PLC	7 655 182	7 705 648	
GBP	10 374 422	Lloyds Banking Group PLC	8 424 422	7 608 314	
GBP	63 146	London Stock Exchange Group PLC	8 644 488	8 887 945	
GBP	1 670 429	NatWest Group PLC	6 696 424	6 767 405	
GBP	635 428	Prudential PLC	13 470 008	11 850 583	
			<b>44 890 524</b>	<b>42 819 895</b>	<b>8,7</b>
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	359 915	BAWAG Group AG	24 540 433	21 966 277	4,4
<b>FRANCE</b>					
EUR	124 724	BNP Paribas SA	10 870 469	10 406 738	
EUR	246 467	Société Générale S.A.	8 074 201	8 479 574	
			<b>18 944 670</b>	<b>18 886 312</b>	<b>3,8</b>
<b>SUISSE</b>					
USD	29 054	Chubb Ltd.	7 429 988	7 411 497	
CHF	403 595	UBS Group AG, actions nominatives	8 468 064	10 809 136	
			<b>15 898 052</b>	<b>18 220 633</b>	<b>3,7</b>
<b>GUERNESEY</b>					
USD	900 736	Burford Capital Ltd.	12 124 875	14 533 785	2,9
<b>BERMUDES</b>					
GBP	1 856 923	Conduit Holdings Ltd.	14 415 961	14 402 320	2,9
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	2 951	Adyen NV	6 455 212	6 764 815	
EUR	90 500	ASR Nederland NV	5 091 365	5 395 175	
			<b>11 546 577</b>	<b>12 159 990</b>	<b>2,5</b>
<b>ITALIE</b>					
EUR	3 385 070	Intesa Sanpaolo SpA	12 145 137	11 744 031	2,4
<b>HONG KONG</b>					
HKD	864 370	AIA Group Ltd.	12 374 998	11 558 878	2,3

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 Secteur financier mondial 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
<b>INDE</b>					
INR	140 398	Housing Development Finance Corp., Ltd.	5 938 533	6 397 914	1,3
<b>PÉROU</b>					
USD	129 144	Intercorp Financial Services	5 263 426	4 249 714	0,9
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>473 076 239</b>	<b>493 888 091</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(687 328)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>472 388 911</b>	<b>493 888 091</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme				664 337	0,1
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>472 388 911</b>	<b>494 552 428</b>	<b>100,1</b>
Autres actifs (passifs) nets				(638 599)	(0,1)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>493 913 829</b>	<b>100,0</b>

## 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 de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	7 638 327	USD	5 686 021	1,34	107 375
Banque de Montréal	A-1	18 juillet 2023	CAD	5 921 615	USD	4 391 488	1,35	105 229
Banque de Montréal	A-1	13 septembre 2023	CAD	7 225 306	USD	5 309 699	1,36	199 184
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 juillet 2023	CAD	7 622 594	USD	5 686 021	1,34	91 642
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	1 193 365	USD	877 642	1,36	31 486
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 septembre 2023	CAD	7 223 978	USD	5 309 699	1,36	197 855
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 septembre 2023	CAD	2 692 861	CHF	1 810 000	1,49	(3 509)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 septembre 2023	CAD	3 241 553	HKD	18 885 000	0,17	47 229
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	CAD	7 635 018	USD	5 686 021	1,34	104 066
Citibank N.A., New York	A-1	13 septembre 2023	CAD	4 221 583	USD	3 148 379	1,34	55 452
Banque HSBC, Toronto	A-1	18 juillet 2023	CAD	7 624 755	USD	5 686 021	1,34	93 803
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	5 705 977	USD	4 247 759	1,34	85 078
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	4 221 630	USD	3 148 379	1,34	55 500
Banque HSBC, Toronto	A-1	14 septembre 2023	CAD	13 624 024	EUR	9 422 000	1,45	(29 867)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	14 septembre 2023	CAD	2 522 687	EUR	1 735 000	1,45	8 411
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	14 septembre 2023	GBP	1 837 000	CAD	3 075 531	0,60	12 268
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	7 624 527	USD	5 686 021	1,34	93 575
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	USD	12 554 550	CAD	17 029 556	0,74	(401 458)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 septembre 2023	CAD	18 748 935	GBP	11 282 000	1,66	(214 892)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 septembre 2023	CAD	1 564 280	INR	96 525 000	0,02	11 890
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	5 924 149	USD	4 391 314	1,35	107 995
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	7 631 948	USD	5 686 021	1,34	100 996
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	USD	8 786 000	CAD	11 831 746	0,74	(194 971)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>664 337</b>

\*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 Secteur financier mondial 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	1 509	(334)	-	1 175
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 509</b>	<b>(334)</b>	<b>-</b>	<b>1 175</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(845)	334	-	(511)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(845)</b>	<b>334</b>	<b>-</b>	<b>(511)</b>

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	1 407	(697)	-	710
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 407</b>	<b>(697)</b>	<b>-</b>	<b>710</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 571)	697	-	(874)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1 571)</b>	<b>697</b>	<b>-</b>	<b>(874)</b>

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

# FNB Secteur financier mondial 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	838	2 428
Paiements indirects <sup>†</sup>	296	1 043

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	37 330 113	49 530 113
Parts rachetables émises	350 000	2 250 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(14 450 000)	(14 550 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	23 230 113	37 230 113

<sup>†</sup> 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 Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires	0,850	0,09

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	15 296
Garanties (hors trésorerie)	-	16 961

## 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	48	87
Charges	(14)	(29)
Revenu tiré des prêts de titres	34	58
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,1</b>	<b>33,3</b>

# FNB Secteur financier mondial 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 (%)
Actions - É.-U.	53,9
Actions - R.-U.	12,0
Actions - Guernesey	4,6
Actions - Suisse	2,3
Actions - Canada	7,3
Actions - Autriche	6,3
Actions - Bermudes	4,3
Actions - France	2,4
Actions - Hong Kong	1,5
Autres actifs (passifs) nets	1,2
Actions - Pérou	0,7
Actions - Emirats Arabes Unis	2,3
Actions - Inde	1,1
Contrat(s) de change à terme	(0,0)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 du fonds sous-jacent 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 49 389 000 \$ (79 047 000 \$ 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<sup>~</sup>

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	297 247	(57 721)	239 526	48,5
Euro	66 323	(16 168)	50 155	10,2
Livre sterling	57 067	(15 876)	41 191	8,3
Dollar de Hong Kong	11 559	(3 194)	8 365	1,7
Franc suisse	10 809	(2 696)	8 113	1,6
Roupie indienne	6 533	(1 552)	4 981	1,0
Couronne suédoise	3	-	3	0,0
<b>Total</b>	<b>449 541</b>	<b>(97 207)</b>	<b>352 334</b>	<b>71,3</b>

au 31 décembre 2022<sup>~</sup>

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	479 258	(121 842)	357 416	44,7
Livre sterling	145 002	(62 588)	82 414	10,3
Euro	71 557	(17 508)	54 049	6,8
Franc suisse	18 408	(4 702)	13 706	1,7
Dollar de Hong Kong	11 659	(2 455)	9 204	1,2
Roupie indienne	8 982	(1 927)	7 055	0,9
<b>Total</b>	<b>734 866</b>	<b>(211 022)</b>	<b>523 844</b>	<b>65,6</b>

<sup>~</sup> 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 35 233 000 \$ (52 384 000 \$ 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.



# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	493 888	-	-	493 888
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	664	-	664
<b>Total</b>	<b>493 888</b>	<b>664</b>	<b>-</b>	<b>494 552</b>

### 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	790 473	-	-	790 473
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(164)	-	(164)
<b>Total</b>	<b>790 473</b>	<b>(164)</b>	<b>-</b>	<b>790 309</b>

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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	188 526	14 540
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	149	56
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	121	9
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	188 796	14 605
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	54	4
Comptes créditeurs et charges à payer	44	31
	98	35
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	188 698	14 570

## 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 ordinaires non couvertes	188 698	14 570	20,40	20,81	9 250 000

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

# FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 229	424
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	6	(1 171)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(441)	(2 111)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>794</b>	<b>(2 858)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	53	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	1
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	19	4
<b>Total des autres revenus</b>	<b>74</b>	<b>4</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>868</b>	<b>(2 854)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	191	63
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	95	22
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	1	-
Retenues d'impôts	231	80
Taxe de vente harmonisée	18	8
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>537</b>	<b>174</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>331</b>	<b>(3 028)</b>

## 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 ordinaires						
non couvertes	331	(3 028)	0,06	(1,64)	5 325 967	1 849 718

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

# FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé 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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	14 570	53 349
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	331	(3 028)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(648)	(252)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(17)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(665)	(252)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	177 561	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 099)	(36 889)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	174 462	(36 889)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	174 128	(40 169)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	188 698	13 180

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

# FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	331	(3 028)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(6)	1 171
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	95	22
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	441	2 111
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	7 004	12 874
Achat de placements et de dérivés	(57 332)	(804)
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	(112)	19
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	50	(12)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	13	4
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(49 515)</b>	<b>12 357</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(665)	(252)
Produit de l'émission de parts rachetables	51 156	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(882)	(12 212)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>49 609</b>	<b>(12 464)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	94	(107)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	56	111
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>149</b>	<b>4</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	885	363
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(1)	-
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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
		É.-U.			
USD	33 683	Abbott Laboratories	4 721 961	4 859 134	
USD	34 438	AbbVie Inc.	7 155 574	6 139 657	
USD	1 729	Acadia Healthcare Co., Inc.	169 850	182 208	
USD	5 748	Agilent Technologies Inc.	1 094 930	914 626	
USD	4 148	agilon health Inc.	144 123	95 177	
USD	1 396	Align Technology Inc.	670 605	653 264	
USD	2 407	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	647 107	604 971	
USD	3 273	AmerisourceBergen Corp.	697 609	833 414	
USD	10 374	Amgen Inc.	3 335 033	3 047 756	
USD	1 854	Apellis Pharmaceuticals Inc.	180 878	223 496	
USD	9 827	Baxter International Inc.	569 937	592 443	
USD	5 516	Becton, Dickinson and Co.	1 803 405	1 927 021	
USD	2 796	Biogen Inc.	1 051 970	1 053 890	
USD	3 586	BioMarin Pharmaceutical Inc.	456 819	411 312	
USD	408	Bio-Rad Laboratories Inc., catégorie A	272 076	204 682	
USD	3 013	Bio-Techne Corp.	324 325	325 455	
USD	27 759	Boston Scientific Corp.	1 826 521	1 986 839	
USD	40 847	Bristol-Myers Squibb Co.	3 786 363	3 456 548	
USD	1 911	Bruker Corp.	200 656	186 924	
USD	5 013	Cardinal Health Inc.	505 317	627 326	
USD	3 495	Catalent Inc.	311 621	200 530	
USD	10 713	Centene Corp.	962 063	956 170	
USD	284	Chemed Corp.	202 565	203 561	
USD	5 751	Cigna Corp.	2 076 086	2 135 369	
USD	958	Cooper Cos. Inc. (The)	470 838	486 064	
USD	24 980	CVS Health Corp.	2 661 248	2 285 077	
USD	12 648	Danaher Corp.	4 332 401	4 016 752	
USD	4 155	Dentsply Sirona Inc.	228 257	220 034	
USD	7 495	DexCom Inc.	1 174 065	1 274 531	
USD	11 751	Edwards Lifesciences Corp.	1 324 908	1 466 785	
USD	4 611	Elevance Health Inc.	2 907 297	2 710 838	
USD	16 483	Eli Lilly and Co.	7 450 271	10 228 984	
USD	1 905	Encompass Health Corp.	146 387	170 683	
USD	3 162	Envista Holdings Corp.	166 764	141 591	
USD	3 437	Exact Sciences Corp.	321 514	427 058	
USD	6 159	Exelixis Inc.	153 917	155 745	
USD	7 083	GE HealthCare Technologies Inc.	724 874	761 428	
USD	24 256	Gilead Sciences Inc.	2 653 669	2 473 697	
USD	1 938	Globus Medical Inc., catégorie A	151 477	152 688	
USD	2 613	Halozyne Therapeutics Inc.	144 719	124 718	
USD	4 046	HCA Healthcare Inc.	1 413 455	1 624 792	
USD	2 535	Henry Schein Inc.	273 389	272 045	
USD	4 769	Hologic Inc.	517 937	510 968	
USD	2 428	Humana Inc.	1 637 698	1 436 562	
USD	1 600	IDEXX Laboratories Inc.	1 073 223	1 063 321	
USD	3 074	illumina Inc.	980 293	762 648	
USD	3 627	Incyte Corp.	358 432	298 764	
USD	556	Inspire Medical Systems Inc.	185 812	238 846	
USD	1 349	Insulet Corp.	555 572	514 705	
USD	6 783	Intuitive Surgical Inc.	2 340 424	3 069 118	
USD	2 711	Ionis Pharmaceuticals Inc.	134 224	147 188	
USD	3 528	IQVIA Holdings Inc.	1 001 659	1 049 322	
USD	50 688	Johnson & Johnson	10 793 643	11 101 906	
USD	605	Karuna Therapeutics Inc.	160 290	173 603	
USD	1 720	Laboratory Corp. of America Holdings	548 371	549 265	

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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>É.-U. (cont'd)</b>					
USD	1 287	Lantheus Holdings Inc.	167 562	142 918	
USD	3 179	Legend Biotech Corp., CAAE	207 346	290 382	
USD	942	Masimo Corp.	240 511	205 112	
USD	2 665	McKesson Corp.	1 246 550	1 506 892	
USD	49 420	Merck & Co., Inc.	7 210 938	7 545 931	
USD	424	Mettler-Toledo International Inc.	866 391	735 906	
USD	6 446	Moderna Inc.	1 453 128	1 036 355	
USD	1 115	Molina Healthcare Inc.	417 643	444 457	
USD	1 844	Neurocrine Biosciences Inc.	248 412	230 099	
USD	3 481	Option Care Health Inc.	146 446	149 657	
USD	4 950	Organon & Co.	162 186	136 307	
USD	703	Penumbra Inc.	257 627	320 060	
USD	109 404	Pfizer Inc.	6 106 308	5 310 121	
USD	2 156	Quest Diagnostics Inc.	412 473	401 007	
USD	2 007	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	2 144 772	1 908 272	
USD	1 006	Repligen Corp.	246 384	188 310	
USD	2 825	ResMed Inc.	852 872	816 793	
USD	2 453	Revvity Inc.	442 372	385 584	
USD	1 610	Sarepta Therapeutics Inc.	299 079	243 977	
USD	2 684	Seagen Inc.	685 734	683 542	
USD	700	Shockwave Medical Inc.	204 164	264 368	
USD	6 147	Stryker Corp.	2 306 587	2 481 607	
USD	913	Teleflex Inc.	312 744	292 403	
USD	1 934	Tenet Healthcare Corp.	159 165	208 265	
USD	7 497	Thermo Fisher Scientific Inc.	5 714 636	5 175 971	
USD	885	United Therapeutics Corp.	275 851	258 515	
USD	18 099	UnitedHealth Group Inc.	11 825 790	11 511 088	
USD	1 176	Universal Health Services Inc., catégorie B	204 951	245 513	
USD	5 002	Vertex Pharmaceuticals Inc.	2 028 587	2 329 256	
USD	23 254	Viatris Inc.	326 119	307 093	
USD	13 864	Walgreens Boots Alliance Inc.	675 463	522 664	
USD	1 142	Waters Corp.	487 850	402 782	
USD	1 435	West Pharmaceutical Services Inc.	671 510	726 258	
USD	4 088	Zimmer Biomet Holdings Inc.	702 064	787 615	
USD	9 021	Zoetis Inc.	2 091 509	2 055 677	
			<b>131 956 146</b>	<b>131 982 256</b>	<b>69,8</b>
<b>SUISSE</b>					
CHF	9 575	Alcon Inc.	912 761	1 049 411	
CHF	1 444	Lonza Group AG, enregistré	1 211 528	1 139 224	
CHF	38 304	Novartis AG, actions nominatives	4 632 902	5 098 887	
CHF	13 682	Roche Holding AG	5 493 067	5 534 719	
CHF	559	Roche Holding AG-BR	240 420	242 749	
CHF	949	Sonova Holding AG, actions nominatives	372 177	334 346	
CHF	2 075	Straumann Holding AG	406 515	445 476	
CHF	248	Tecan Group AG	143 380	125 889	
			<b>13 412 750</b>	<b>13 970 701</b>	<b>7,4</b>
<b>R.-U.</b>					
GBP	29 179	AstraZeneca PLC	5 347 172	5 535 189	
GBP	79 723	GSK PLC	1 966 943	1 862 646	
GBP	99 027	Haleon PLC	531 865	536 851	
USD	7 230	Royalty Pharma PLC, catégorie A	348 310	294 093	
GBP	17 011	Smith & Nephew PLC	337 790	362 874	
			<b>8 532 080</b>	<b>8 591 653</b>	<b>4,6</b>

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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>JAPON</b>					
JPY	34 790	Astellas Pharma Inc.	675 859	684 478	
JPY	12 454	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	431 971	465 882	
JPY	37 323	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	1 708 732	1 554 736	
JPY	5 507	Eisai Co., Ltd.	427 806	490 263	
JPY	6 803	Hoya Corp.	1 025 481	1 063 482	
JPY	4 844	Kyowa Kirin Co., Ltd.	147 073	118 143	
JPY	2 307	MatsukiyoCocokara & Co.	156 483	170 595	
JPY	24 420	Olympus Corp.	592 119	506 611	
JPY	8 564	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	240 750	204 324	
JPY	8 623	Otsuka Holdings Co., Ltd.	373 565	416 122	
JPY	5 339	Shimadzu Corp.	221 889	216 439	
JPY	5 713	Shionogi & Co.	357 462	317 484	
JPY	3 091	Systemex Corp.	287 079	277 385	
JPY	29 744	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1 298 077	1 232 761	
JPY	13 987	Terumo Corp.	540 196	584 183	
			<b>8 484 542</b>	<b>8 302 888</b>	<b>4,4</b>
<b>DANEMARK</b>					
USD	1 092	Ascendis Pharma AS, CAAE	140 299	128 965	
DKK	2 400	Coloplast AS, catégorie B	414 733	397 019	
DKK	1 261	Genmab AS	647 347	630 788	
DKK	31 329	Novo Nordisk AS, catégorie B	6 371 055	6 678 072	
			<b>7 573 434</b>	<b>7 834 844</b>	<b>4,2</b>
<b>FRANCE</b>					
EUR	5 511	EssilorLuxottica SA	1 344 742	1 373 213	
EUR	21 509	Sanofi SA	2 993 993	3 049 287	
EUR	474	Sartorius Stedim Biotech	212 885	156 499	
			<b>4 551 620</b>	<b>4 578 999</b>	<b>2,4</b>
<b>IRLANDE</b>					
USD	4 412	Horizon Therapeutics PLC	648 785	600 457	
USD	1 204	Jazz Pharmaceuticals PLC	231 384	197 508	
USD	25 909	Medtronic PLC	2 939 725	3 020 428	
USD	1 928	STERIS PLC	493 946	573 975	
			<b>4 313 840</b>	<b>4 392 368</b>	<b>2,3</b>
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	19 137	Bayer AG, actions nominatives	1 618 816	1 399 882	
EUR	1 812	BioNTech SE, CAAE	338 567	258 976	
EUR	3 877	Fresenius Medical Care AG & Co., KGaA	233 094	244 985	
EUR	8 014	Fresenius SE & Co., KGaA	308 354	293 519	
EUR	2 517	Merck KGaA	639 206	550 688	
EUR	479	Sartorius AG, privilégiées	284 091	219 280	
EUR	5 248	Siemens Healthineers AG	404 891	392 910	
			<b>3 827 019</b>	<b>3 360 240</b>	<b>1,8</b>
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	1 276	Cochlear Ltd.	273 763	257 458	
AUD	9 344	CSL Ltd.	2 518 601	2 282 947	
AUD	3 527	Ramsay Health Care Ltd.	216 713	174 874	
AUD	8 742	Sonic Healthcare Ltd.	279 301	273 894	
			<b>3 288 378</b>	<b>2 989 173</b>	<b>1,6</b>
<b>PAYS-BAS</b>					
USD	1 085	argenx SE, CAAE	519 280	559 545	
EUR	16 725	Koninklijke Philips N.V.	424 550	478 270	
USD	4 416	QIAGEN NV	276 561	263 132	
			<b>1 220 391</b>	<b>1 300 947</b>	<b>0,7</b>
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	2 340	UCB SA	285 229	274 308	<b>0,1</b>

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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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
<b>ISRAËL</b>					
ILS	21 523	Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	272 646	214 507	0,1
<b>NOUVELLE ZÉLANDE</b>					
NZD	10 683	Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	243 689	212 185	0,1
<b>CHINE</b>					
HKD	163 287	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	231 147	187 764	0,1
<b>FINLANDE</b>					
EUR	2 059	Orion OYJ, catégorie B	129 723	113 015	0,1
<b>JERSEY</b>					
USD	2 014	Novocure Ltd.	191 304	110 599	0,1
<b>HONG KONG</b>					
HKD	190 983	Sino Biopharmaceutical Ltd.	145 176	109 967	0,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>188 659 114</b>	<b>188 526 414</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(275 750)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>188 383 364</b>	<b>188 526 414</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				171 395	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>188 697 809</b>	<b>100,0</b>

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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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	87	5
Paiements indirects <sup>†</sup>	31	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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	700 000	2 545 000
Parts rachetables émises	8 700 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(150 000)	(1 845 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>9 250 000</b>	<b>700 000</b>

<sup>†</sup> 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 Chefs de file mondiaux des soins de santé 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 ordinaires non couvertes	0,350

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	353	88
Garanties (hors trésorerie)	371	98

## 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	2
Charges	(1)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	2	1
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>51,5</b>

# FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé 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 (%)
Actions - É.-U.	70,3
Actions - Suisse	7,1
Actions - R.-U.	4,3
Actions - Japon	4,2
Actions - Danemark	3,6
Actions - Allemagne	3,2
Actions - France	2,2
Actions - Irlande	2,1
Actions - Australie	1,6
Actions - Pays-Bas	0,6
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Actions - Israël	0,1
Actions - Belgique	0,1
Actions - Chine	0,1
Actions - Nouvelle Zélande	0,1
Actions - Jersey	0,1
Actions - Hong Kong	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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 Solactive Developed Markets Healthcare 150	18 836 453

## Autre risque de prix (suite)

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive Developed Markets Healthcare 150	1 446 957

### 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	137 852	-	137 852	73,1
Franc suisse	13 973	-	13 973	7,4
Euro	8 807	-	8 807	4,7
Yen japonais	8 323	-	8 323	4,4
Livre sterling	8 319	-	8 319	4,4
Couronne danoise	7 707	-	7 707	4,1
Dollar australien	2 991	-	2 991	1,6
Dollar de Hong Kong	304	-	304	0,2
Shekel israélien	216	-	216	0,1
Dollar néo-zélandais	216	-	216	0,1
Couronne suédoise	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>188 709</b>	<b>-</b>	<b>188 709</b>	<b>100,1</b>

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	10 679	-	10 679	73,3
Franc suisse	1 030	-	1 030	7,1
Euro	840	-	840	5,8
Yen japonais	614	-	614	4,2
Livre sterling	596	-	596	4,1
Couronne danoise	507	-	507	3,5
Dollar australien	236	-	236	1,6
Dollar de Hong Kong	30	-	30	0,2
Shekel israélien	21	-	21	0,1
Dollar néo-zélandais	17	-	17	0,1
Couronne suédoise	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>14 571</b>	<b>-</b>	<b>14 571</b>	<b>100,0</b>

~ 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 18 871 000 \$ (1 457 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	188 526	-	-	188 526
<b>Total</b>	<b>188 526</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>188 526</b>

### 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	14 540	-	-	14 540
<b>Total</b>	<b>14 540</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>14 540</b>

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.

# Fonds de lingots d'or CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Lingots à leur juste valeur	59 737	46 046
Trésorerie	-	3
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Profit latent sur les contrats de change à terme	21	6
Montant à recevoir pour la vente de lingots	-	9
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	59 758	46 064
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats de change à terme	25	5
Montant à payer pour l'achat de lingots	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	8	7
Comptes créditeurs et charges à payer	3	2
	36	14
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>59 722</b>	<b>46 050</b>

## 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
Série FNB en \$ US	30 659	22 957	19,04	18,08	1 610 000	1 270 000
Série FNB couverte en \$ CA	17 447	13 513	24,05*	22,89*	960 000	800 000
Série FNB non couverte en \$ CA	11 616	9 580	25,20*	24,49*	610 000	530 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, des série FNB couverte en \$ CA et série FNB non couverte en \$ CA est présenté en dollars canadiens.

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

# Fonds de lingots d'or CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les lingots et les dérivés		
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de lingots et de dérivés	708	14 327
Variation de la plus-value (moins-value) latente des lingots et des dérivés	1 850	(10 702)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les lingots et les dérivés</b>	<b>2 561</b>	<b>3 625</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	1	7
Rabais sur frais	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1</b>	<b>7</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2 562</b>	<b>3 632</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	41	95
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	2	2
Taxe de vente harmonisée	3	9
Frais d'inscription	-	-
Frais de licence	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>47</b>	<b>107</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 515</b>	<b>3 525</b>

## 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
Série FNB en \$ US	983	3 809	0,71	0,84	1 388 232	4 513 315
Série FNB						
couverte en \$ CA	1 056	(139)	1,20	(0,11)	876 575	1 270 166
Série FNB non						
couverte en \$ CA	476	(145)	0,85	(0,18)	563 039	827 790

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

# Fonds de lingots d'or CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## 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)

	Série FNB en \$ US		Série FNB couverte en \$ CA		Série FNB non couverte en \$ CA	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	22 957	276 740	13 513	24 141	9 580	13 628
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	983	3 809	1 056	(139)	476	(145)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	-	(762)	-	(368)	-	(275)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	(762)	-	(368)	-	(275)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	9 464	2 734	2 878	4 110	1 560	2 285
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	762	-	368	-	275
Rachat de parts rachetables	(2 745)	(254 828)	-	(6 669)	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	6 719	(251 332)	2 878	(2 191)	1 560	2 560
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	7 702	(248 285)	3 934	(2 698)	2 036	2 140
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	30 659	28 455	17 447	21 443	11 616	15 768

	Total du Fonds	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	46 050	314 509
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 515	3 525
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	-	(1 405)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	(1 405)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	13 902	9 129
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	1 405
Rachat de parts rachetables	(2 745)	(261 497)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	11 157	(250 963)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	13 672	(248 843)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	59 722	65 666

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



# Fonds de lingots d'or CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 515	3 525
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de lingots et de dérivés	(708)	(14 327)
(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 lingots et des dérivés	(1 850)	10 702
Produit de la vente et de l'échéance de lingots et de dérivés	860	839
Achat de lingots et de dérivés	(822)	(723)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	(34)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	(3)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(3)	(20)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Produit de l'émission de parts	-	-
Montant versé au rachat de parts	-	-
Distributions versées, déduction faite des distributions réinvesties	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	-	-
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	(20)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3	15
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	-	(5)
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(2)	(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.

# Fonds de lingots d'or CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité) (exprimé en \$ US)

Nombre de d'onces	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>LINGOTS</b>				
31 239	Lingots d'or 400 oz	57 016 181	59 736 520	100,0
<b>Total Lingots</b>		<b>57 016 181</b>	<b>59 736 520</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>		<b>57 016 181</b>	<b>59 736 520</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme			(4 153)	-
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>57 016 181</b>	<b>59 732 367</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets			(10 790)	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>59 721 577</b>	<b>100,0</b>

## 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+	5 juillet 2023	CAD	547 013	USD	412 973	1,32	413
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	516 987	USD	392 029	1,32	(1 334)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	22 453 858	USD	16 972 067	1,32	(3 348)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	17 777 069	CAD	23 549 852	0,75	(19 910)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	1 août 2023	CAD	23 104 475	USD	17 448 073	1,32	20 026
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(4 153)</b>

\*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.

# Fonds de lingots d'or CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## 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	21	(21)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	21	(21)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(25)	21	-	(4)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(25)	21	-	(4)

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	6	(5)	-	1
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	6	(5)	-	1
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(5)	5	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(5)	5	-	-

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

# Fonds de lingots d'or CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ US		Série FNB couverte en \$ CA		Série FNB non couverte en \$ CA	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 270 000	15 230 000	800 000	1 320 000	530 000	750 000
Parts rachetables émises	480 000	140 000	160 000	220 000	80 000	120 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(140 000)	(13 800 000)	-	(340 000)	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 610 000</b>	<b>1 570 000</b>	<b>960 000</b>	<b>1 200 000</b>	<b>610 000</b>	<b>870 000</b>

<sup>†</sup> 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.

# Fonds de lingots d'or CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Série FNB en \$ US	0,155
Série FNB couverte en \$ CA	0,155
Série FNB non couverte en \$ CA	0,155

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# Fonds de lingots d'or CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## 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 (%)
Lingots	100,0
Contrat(s) de change à terme	0,0
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 était principalement investi dans l'or et par conséquent, le Fonds était sensible aux variations du prix de l'or.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur de l'or 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 5 973 000 \$ (4 605 000 \$ 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 canadien	-	17 444	17 444	29,2
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>17 444</b>	<b>17 444</b>	<b>29,2</b>

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 canadien	7	13 527	13 534	29,4
<b>Total</b>	<b>7</b>	<b>13 527</b>	<b>13 534</b>	<b>29,4</b>

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

### Risque de change (suite)

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 1 744 000 \$ (1 353 000 \$ 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 lingots.

## 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Lingots d'or	59 737	-	-	59 737
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(4)	-	(4)
<b>Total</b>	<b>59 737</b>	<b>(4)</b>	<b>-</b>	<b>59 733</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Lingots	46 046	-	-	46 046
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1	-	1
<b>Total</b>	<b>46 046</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>46 047</b>

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 Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	130 243	186 012
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	248	493
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	3	29
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	67
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	130 494	186 601
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	8	2
Swaps, options sur swaps et options	214	893
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	73	105
Comptes créditeurs et charges à payer	56	76
	351	1 076
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	130 143	185 525

## 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 ordinaires couvertes	127 835	183 328	10,00	10,60	12 788 041	17 288 041
Parts ordinaires couvertes en \$ US	2 308	2 197	7,74*	8,11*	225 000	200 000

\*Net assets attributable to holders of redeemable units per unit for Hedged US\$ Common Units are presented in U.S. dollars.

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 512	4 171
Intérêts aux fins des distributions	16	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	3 495	-
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	(6 042)	(9 350)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	873	10 176
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>854</b>	<b>4 997</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(20)	(44)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	14	15
Rabais sur frais	130	598
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	2	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>126</b>	<b>569</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>980</b>	<b>5 566</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	583	1 075
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	397	590
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	2
Retenues d'impôts	200	312
Taxe de vente harmonisée	47	47
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>1 228</b>	<b>2 027</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(248)</b>	<b>3 539</b>

## 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 ordinaires couvertes	(167)	3 874	(0,01)	0,14	16 218 428	27 651 715
Parts ordinaires couvertes en \$ US	(81)	(335)	(0,38)	(2,85)	209 530	117 174

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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 ordinaires		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	183 328	473 648	2 197	-	185 525	473 648
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(167)	3 874	(81)	(335)	(248)	3 539
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(2 288)	(2 741)	(69)	(44)	(2 357)	(2 785)
Profits nets réalisés	-	(3 789)	-	-	-	(3 789)
Remboursement de capital	(4 813)	(4 006)	(44)	-	(4 857)	(4 006)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(7 101)</b>	<b>(10 536)</b>	<b>(113)</b>	<b>(44)</b>	<b>(7 214)</b>	<b>(10 580)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	47 620	23 559	594	1 615	48 214	25 174
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(95 845)	(300 148)	(289)	-	(96 134)	(300 148)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(48 225)</b>	<b>(276 589)</b>	<b>305</b>	<b>1 615</b>	<b>(47 920)</b>	<b>(274 974)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(55 493)</b>	<b>(283 251)</b>	<b>111</b>	<b>1 236</b>	<b>(55 382)</b>	<b>(282 015)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>127 835</b>	<b>190 397</b>	<b>2 308</b>	<b>1 236</b>	<b>130 143</b>	<b>191 633</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(248)	3 539
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	6 042	9 350
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	397	590
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(873)	(10 176)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	44 842	121 911
Achat de placements et de dérivés	(41 799)	(80 435)
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	67	281
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(32)	(167)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	7	(14)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>8 403</b>	<b>44 879</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(7 214)	(10 580)
Produit de l'émission de parts rachetables	125	1 602
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 559)	(36 325)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(8 648)</b>	<b>(45 303)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(245)	(424)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	493	643
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>248</b>	<b>219</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 379	4 139
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	16	-
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 Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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
		<b>MATÉRIAUX</b>			
	135 434	Mines Agnico Eagle Limitée	9 490 515	8 958 959	
	560 326	Alamos Gold Inc., catégorie A	8 719 264	8 841 945	
USD	283 891	AngloGold Ashanti Ltd., CAAE	7 942 879	7 931 624	
	1 903 215	B2Gold Corp.	10 683 863	8 983 175	
	412 117	Société aurifère Barrick	11 496 876	9 235 541	
	264 707	Endeavour Mining PLC	7 656 045	8 404 447	
	46 785	Franco-Nevada Corp.	8 450 507	8 833 476	
USD	459 605	Gold Fields Ltd., CAAE	6 259 741	8 420 558	
	1 405 177	Kinross Gold Corp.	9 170 656	8 880 719	
USD	158 382	Newmont Corp.	11 158 202	8 950 774	
	451 965	Pan American Silver Corp.	12 334 110	8 722 925	
USD	58 075	Royal Gold Inc.	9 259 147	8 830 583	
USD	931 102	Sibanye Stillwater Ltd., CAAE	13 508 272	7 696 899	
USD	468 420	SSR Mining Inc.	11 203 773	8 799 248	
	152 773	Wheaton Precious Metals Corp.	8 440 739	8 752 365	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>145 774 589</b>	<b>130 243 238</b>	<b>100,1</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(520 753)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>145 253 836</b>	<b>130 243 238</b>	<b>100,1</b>
		Contrat(s) de change à terme		(8 132)	-
		Position(s) vendeur sur option(s)		(214 163)	(0,2)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>145 253 836</b>	<b>130 020 943</b>	<b>99,9</b>
		Autres actifs (passifs) nets		122 041	0,1
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>130 142 984</b>	<b>100,0</b>

## 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+	24 juillet 2023	CAD	57 118	USD	43 208	1,32	(104)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	42 139	USD	31 916	1,32	(129)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	1 119 836	CAD	1 490 940	0,75	(7 899)
		<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>						<b>(8 132)</b>

\*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 Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI

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

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par		Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
		contrat						
(337)	Agnico Eagle Mines Ltd., (option d'achat) – 70,00	100		21 juillet 2023	70,00	CAD	(44 147)	(13 648)
(1 398)	Alamos Gold Inc., catégorie A, (option d'achat) – 17,00	100		21 juillet 2023	17,00	CAD	(39 843)	(15 378)
(708)	AngloGold Ashanti Ltd., CAAE, (option d'achat) – 25,00	100		21 juillet 2023	25,00	USD	(57 014)	(4 690)
(4 748)	B2Gold Corp., (option d'achat) – 5,00	100		21 juillet 2023	5,00	CAD	(52 228)	(30 862)
(1 028)	Barrick Gold Corp., (option d'achat) – 23,00	100		21 juillet 2023	23,00	CAD	(32 896)	(30 840)
(660)	Endeavour Mining PLC, (option d'achat) – 35,00	100		21 juillet 2023	35,00	CAD	(42 240)	(8 910)
(116)	Franco-Nevada Corp., (option d'achat) – 200,00	100		21 juillet 2023	200,00	CAD	(34 568)	(7 830)
(1 146)	Gold Fields Ltd., CAAE, (option d'achat) – 16,00	100		21 juillet 2023	16,00	USD	(46 899)	(3 795)
(3 506)	Kinross Gold Corp., (option d'achat) – 6,75	100		21 juillet 2023	6,75	CAD	(49 084)	(17 530)
(395)	Newmont Corp., (option d'achat) – 45,00	100		21 juillet 2023	45,00	USD	(54 231)	(18 576)
(1 127)	Pan American Silver Corp., (option d'achat) – 21,00	100		21 juillet 2023	21,00	CAD	(59 731)	(16 905)
(144)	Royal Gold Inc., (option d'achat) – 125,00	100		21 juillet 2023	125,00	USD	(30 416)	(5 723)
(2 323)	Sibanye Stillwater Ltd., CAAE, (option d'achat) – 7,50	100		21 juillet 2023	7,50	USD	(92 001)	(7 693)
(1 168)	SSR Mining Inc., (option d'achat) – 15,00	100		21 juillet 2023	15,00	USD	(65 486)	(23 210)
(381)	Wheaton Precious Metals Corp., (option d'achat) – 62,00	100		21 juillet 2023	62,00	CAD	(41 148)	(8 573)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>							<b>(741 932)</b>	<b>(214 163)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(8)	-	-	(8)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(8)	-	-	(8)

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(2)	-	-	(2)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(2)	-	-	(2)

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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	386	567
Paiements indirects <sup>†</sup>	136	244

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	17 288 041	42 013 041	200 000	-
Parts rachetables émises	4 225 000	2 050 000	50 000	125 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(8 725 000)	(24 700 000)	(25 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>12 788 041</b>	<b>19 363 041</b>	<b>225 000</b>	<b>125 000</b>

<sup>†</sup> 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 Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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 ordinaires	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	4 753
Garanties (hors trésorerie)	-	5 023

## 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	22	30
Charges	(8)	(15)
Revenu tiré des prêts de titres	14	15
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>39,1</b>	<b>49,2</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - Matériaux	100,3
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,5</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,5)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,5)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 13 024 000 \$ (18 601 000 \$ 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	50 567	1 320	51 887	39,9
<b>Total</b>	<b>50 567</b>	<b>1 320</b>	<b>51 887</b>	<b>39,9</b>

## 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	75 196	952	76 148	41,0
<b>Total</b>	<b>75 196</b>	<b>952</b>	<b>76 148</b>	<b>41,0</b>

~ 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 5 189 000 \$ (7 615 000 \$ 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.

## 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	130 243	-	-	130 243
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(8)	-	(8)
<b>Total</b>	<b>130 243</b>	<b>(8)</b>	<b>-</b>	<b>130 235</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Option(s)	(214)	-	-	(214)
<b>Total</b>	<b>(214)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(214)</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	186 012	-	-	186 012
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(2)	-	(2)
<b>Total</b>	<b>186 012</b>	<b>(2)</b>	<b>-</b>	<b>186 010</b>

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions vendeur 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)
Option(s)	(893)	-	-	(893)
<b>Total</b>	<b>(893)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(893)</b>

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 Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	103 796	90 139
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	279	270
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	459	158
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	5	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	90	79
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	42	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	104 671	90 646
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	29
Swaps, options sur swaps et options	524	475
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	42	-
Montant à payer pour le rachat de parts	5	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	57	49
Comptes créditeurs et charges à payer	54	38
	682	591
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>103 989</b>	<b>90 055</b>

## 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 ordinaires couvertes	86 773	82 126	11,42	11,99	7 600 000	6 850 000
Parts ordinaires non couvertes	15 931	6 554	12,25	13,11	1 300 000	500 000
Parts ordinaires couvertes en \$ US	1 285	1 375	9,70*	10,15*	100 000	100 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 168	721
Intérêts aux fins des distributions	11	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	1 793	-
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	3 630	666
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(8 645)	(3 507)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(2 043)</b>	<b>(2 120)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(15)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	58	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>43</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(2 000)</b>	<b>(2 121)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	366	194
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	36	34
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	169	98
Taxe de vente harmonisée	33	20
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>605</b>	<b>347</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(2 605)</b>	<b>(2 468)</b>

## 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 ordinaires couvertes	(1 952)	(2 306)	(0,26)	(0,51)	7 626 243	4 493 370
Parts ordinaires non couvertes	(575)	(134)	(0,30)	(0,30)	1 922 376	452 486
Parts ordinaires couvertes en \$ US	(78)	(28)	(0,71)	(0,21)	109 392	134 348

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	82 126	44 139	6 554	5 674	1 375	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 952)	(2 306)	(575)	(134)	(78)	(28)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(295)	(281)	(86)	(126)	(4)	(24)
Profits nets réalisés	(147)	(1 282)	(62)	(40)	(2)	-
Remboursement de capital	(1 680)	(114)	(750)	-	(24)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(2 122)</b>	<b>(1 677)</b>	<b>(898)</b>	<b>(166)</b>	<b>(30)</b>	<b>(24)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	19 565	22 214	58 579	1 234	660	1 930
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(10 844)	(1 211)	(47 729)	(638)	(642)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>8 721</b>	<b>21 003</b>	<b>10 850</b>	<b>596</b>	<b>18</b>	<b>1 930</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>4 647</b>	<b>17 020</b>	<b>9 377</b>	<b>296</b>	<b>(90)</b>	<b>1 878</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>86 773</b>	<b>61 159</b>	<b>15 931</b>	<b>5 970</b>	<b>1 285</b>	<b>1 878</b>
	<b>Total du Fonds</b>					
	<b>2023</b>	<b>2022</b>				
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	90 055	49 813				
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 605)	(2 468)				
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(385)	(431)				
Profits nets réalisés	(211)	(1 322)				
Remboursement de capital	(2 454)	(114)				
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(3 050)</b>	<b>(1 867)</b>				
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	78 804	25 378				
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-				
Rachat de parts rachetables	(59 215)	(1 849)				
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>19 589</b>	<b>23 529</b>				
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>13 934</b>	<b>19 194</b>				
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>103 989</b>	<b>69 007</b>				

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 605)	(2 468)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(3 630)	(666)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	36	34
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	8 645	3 507
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	20 161	14 661
Achat de placements et de dérivés	(18 857)	(13 957)
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	(11)	(49)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	7	10
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	12	3
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>3 758</b>	<b>1 075</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 050)	(1 867)
Produit de l'émission de parts rachetables	(31)	1 322
Montant versé au rachat de parts rachetables	(668)	(3)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(3 749)</b>	<b>(548)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	9	527
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	270	47
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>279</b>	<b>574</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	988	573
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	11	-
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 Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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
<b>É.-U.</b>					
USD	36 866	Abbott Laboratories	5 294 954	5 324 344	
USD	28 241	AbbVie Inc.	5 563 335	5 040 554	
USD	16 971	Amgen Inc.	5 465 196	4 991 528	
USD	15 081	Becton, Dickinson and Co.	4 887 377	5 274 539	
USD	59 529	Bristol-Myers Squibb Co.	5 421 372	5 043 164	
USD	14 540	Cigna Corp.	5 185 070	5 404 880	
USD	57 061	CVS Health Corp.	6 302 890	5 225 643	
USD	16 046	Danaher Corp.	5 289 016	5 101 665	
USD	8 838	Elevance Health Inc.	5 373 300	5 201 809	
USD	8 641	Eli Lilly and Co.	3 845 703	5 368 492	
USD	49 270	Gilead Sciences Inc.	5 158 666	5 030 392	
USD	13 482	HCA Healthcare Inc.	4 252 545	5 420 237	
USD	23 703	Johnson & Johnson	5 068 130	5 197 419	
USD	35 610	Merck & Co., Inc.	4 716 191	5 443 447	
USD	96 935	Pfizer Inc.	5 642 489	4 710 249	
USD	13 110	Stryker Corp.	4 274 871	5 298 642	
USD	7 252	Thermo Fisher Scientific Inc.	5 102 462	5 012 498	
USD	8 497	UnitedHealth Group Inc.	5 225 457	5 410 278	
USD	22 767	Zoetis Inc.	5 128 032	5 193 954	
			<b>97 197 056</b>	<b>98 693 734</b>	<b>95,0</b>
<b>IRLANDE</b>					
USD	43 717	Medtronic PLC	5 222 841	5 102 232	4,9
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>102 419 897</b>	<b>103 795 966</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(41 696)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>102 378 201</b>	<b>103 795 966</b>	<b>99,9</b>
Contrat(s) de change à terme				459 412	0,4
Position(s) vendeur sur option(s)				(524 142)	(0,5)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>102 378 201</b>	<b>103 731 236</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				258 079	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>103 989 315</b>	<b>100,0</b>

## 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+	24 juillet 2023	CAD	87 251 281	USD	65 537 152	1,33	457 960
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	870 422	CAD	1 151 158	0,76	1 575
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	424 891	CAD	562 822	0,75	(123)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>459 412</b>

\*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 Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

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

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par		Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
		contrat						
(94)	Abbott Laboratories, (option d'achat) – 110,00	100		21 juillet 2023	110,00	USD	(10 176)	(18 181)
(72)	AbbVie Inc., (option d'achat) – 140,00	100		21 juillet 2023	140,00	USD	(17 727)	(3 338)
(43)	Amgen Inc., (option d'achat) – 230,00	100		21 juillet 2023	230,00	USD	(31 136)	(5 696)
(38)	Becton, Dickinson and Co., (option d'achat) – 260,00	100		21 juillet 2023	260,00	USD	(25 007)	(31 211)
(152)	Bristol-Myers Squibb Co., (option d'achat) – 67,50	100		21 juillet 2023	67,50	USD	(9 832)	(1 208)
(37)	Cigna Corp., (option d'achat) – 270,00	100		21 juillet 2023	270,00	USD	(33 630)	(64 456)
(145)	CVS Health Corp., (option d'achat) – 70,00	100		21 juillet 2023	70,00	USD	(20 578)	(16 424)
(40)	Danaher Corp., (option d'achat) – 250,00	100		21 juillet 2023	250,00	USD	(25 796)	(7 021)
(22)	Elevance Health Inc., (option d'achat) – 450,00	100		21 juillet 2023	450,00	USD	(30 161)	(24 336)
(22)	Eli Lilly and Co., (option d'achat) – 460,00	100		21 juillet 2023	460,00	USD	(26 966)	(44 445)
(125)	Gilead Sciences Inc., (option d'achat) – 80,00	100		21 juillet 2023	80,00	USD	(24 340)	(5 547)
(34)	HCA Healthcare Inc., (option d'achat) – 290,00	100		21 juillet 2023	290,00	USD	(37 635)	(73 418)
(60)	Johnson & Johnson, (option d'achat) – 165,00	100		21 juillet 2023	165,00	USD	(22 931)	(22 216)
(111)	Medtronic PLC, (option d'achat) – 90,00	100		21 juillet 2023	90,00	USD	(21 614)	(8 382)
(90)	Merck & Co. Inc., (option d'achat) – 110,00	100		21 juillet 2023	110,00	USD	(32 139)	(71 835)
(247)	Pfizer Inc., (option d'achat) – 42,50	100		21 juillet 2023	42,50	USD	(7 174)	(491)
(33)	Stryker Corp., (option d'achat) – 300,00	100		21 juillet 2023	300,00	USD	(23 460)	(35 192)
(18)	Thermo Fisher Scientific Inc., (option d'achat) – 540,00	100		21 juillet 2023	540,00	USD	(34 895)	(7 332)
(21)	UnitedHealth Group Inc., (option d'achat) – 460,00	100		21 juillet 2023	460,00	USD	(37 245)	(69 967)
(58)	Zoetis Inc., (option d'achat) – 175,00	100		21 juillet 2023	175,00	USD	(21 800)	(13 446)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>							<b>(494 242)</b>	<b>(524 142)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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	459	-	-	459
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>459</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>459</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	158	(29)	-	129
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>(29)</b>	<b>-</b>	<b>129</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(29)	29	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(29)</b>	<b>29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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	27	14
Paiements indirects <sup>†</sup>	9	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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	6 850 000	3 550 000	500 000	450 000	100 000	-
Parts rachetables émises	1 700 000	1 850 000	4 600 000	100 000	50 000	150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(950 000)	(100 000)	(3 800 000)	(50 000)	(50 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7 600 000</b>	<b>5 300 000</b>	<b>1 300 000</b>	<b>500 000</b>	<b>100 000</b>	<b>150 000</b>

<sup>†</sup> 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 Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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 ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - É.-U.	95,0
Actions - Irlande	5,1
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Contrat(s) de change à terme	0,2
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,5</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,5)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,5)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 10 380 000 \$ (9 014 000 \$ 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	103 897	(85 602)	18 295	17,6
<b>Total</b>	<b>103 897</b>	<b>(85 602)</b>	<b>18 295</b>	<b>17,6</b>

## 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	90 268	(82 357)	7 911	8,8
<b>Total</b>	<b>90 268</b>	<b>(82 357)</b>	<b>7 911</b>	<b>8,8</b>

~ 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 1 830 000 \$ (791 000 \$ 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	103 796	-	-	103 796
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	459	-	459
<b>Total</b>	<b>103 796</b>	<b>459</b>	<b>-</b>	<b>104 255</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Option(s)	(524)	-	-	(524)
<b>Total</b>	<b>(524)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(524)</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé 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	90 139	-	-	90 139
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	129	-	129
<b>Total</b>	<b>90 139</b>	<b>129</b>	<b>-</b>	<b>90 268</b>

### Positions vendeur 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)
Option(s)	(475)	-	-	(475)
<b>Total</b>	<b>(475)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(475)</b>

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'épargne à intérêt élevé 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	7 398 337	5 273 294
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	116 155	18 999
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	2 088	1 279
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	1 041	682
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	20 014	22 523
	7 537 635	5 316 777
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	-	243
Frais de gestion à payer	2 516	1 546
Comptes créditeurs et charges à payer	2 409	1 476
	4 925	3 265
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 532 710</b>	<b>5 313 512</b>

## 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 ordinaires	7 532 710	5 313 512	50,03	50,05	150 550 000	106 150 000

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	163 608	13 047
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	-	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	-	-
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>163 608</b>	<b>13 047</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	3 857	1 185
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>3 857</b>	<b>1 185</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>167 465</b>	<b>14 232</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	4 645	1 525
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	11	4
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	100	43
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>4 757</b>	<b>1 572</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>162 708</b>	<b>12 660</b>

## 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 ordinaires	162 708	12 660	1,22	0,29	133 536 188	43 907 735

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	5 313 512	2 085 395
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	162 708	12 660
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(166 863)	(9 861)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(1 559)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(168 422)</b>	<b>(9 861)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	2 858 300	835 775
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(633 388)	(310 151)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>2 224 912</b>	<b>525 624</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 219 198</b>	<b>528 423</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7 532 710</b>	<b>2 613 818</b>

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	162 708	12 660
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	-	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 891 713	321 320
Achat de placements et de dérivés	(4 016 755)	(838 779)
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	(359)	(98)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	970	69
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	124	8
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(1 961 599)</b>	<b>(504 820)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(168 666)	(9 861)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 860 809	825 760
Montant versé au rachat de parts rachetables	(633 388)	(310 151)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>2 058 755</b>	<b>505 748</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	97 156	928
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	18 999	(929)
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>116 155</b>	<b>(1)</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	163 249	12 949
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(11)	(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 d'épargne à intérêt élevé 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
<b>COMPTES D'ÉPARGNE À INTÉRÊT ÉLEVÉ</b>				
604 062 276	Banque de Montréal, compte d'épargne à intérêt élevé	604 062 278	604 062 278	
1 510 380 641	Banque Canadienne Impériale de Commerce, compte d'épargne à intérêt élevé	1 510 380 643	1 510 380 643	
2 518 734 303	Banque Nationale du Canada, compte d'épargne à intérêt élevé	2 518 734 304	2 518 734 304	
2 765 159 969	Banque Scotia, compte d'épargne à intérêt élevé	2 765 159 970	2 765 159 970	
	<b>Total comptes d'épargne à intérêt élevé</b>	<b>7 398 337 195</b>	<b>7 398 337 195</b>	<b>98,2</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>7 398 337 195</b>	<b>7 398 337 195</b>	<b>98,2</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>7 398 337 195</b>	<b>7 398 337 195</b>	<b>98,2</b>
Autres actifs (passifs) nets			134 372 623	1,8
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>7 532 709 818</b>	<b>100,0</b>

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'épargne à intérêt élevé 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	106 150 000	41 700 000
Parts rachetables émises	57 050 000	16 700 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(12 650 000)	(6 200 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	150 550 000	52 200 000

<sup>†</sup> 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'épargne à intérêt élevé 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 ordinaires	0,140

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

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

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB d'épargne à intérêt élevé 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 (%)
Comptes d'épargne à intérêt élevé	99,2
Autres actifs (passifs) nets	0,8
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 (%)
A	98,2
<b>Total</b>	<b>98,2</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
A	100,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

\*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

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 détenue dans des comptes d'épargne à intérêt élevé.

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	299 192	313 120
Placements donnés en garantie	6 334	7 621
Trésorerie	207	8 057
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	295	415
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	2 494	2 275
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	1 512	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	2 358	2 706
Montant à recevoir pour la vente de placements	400	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	364	-
	313 156	334 194
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	185	255
Swaps, options sur swaps et options	1 099	327
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	400	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	184
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	155	194
Frais d'administration à payer	10	12
Comptes créditeurs et charges à payer	-	9
	1 849	981
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>311 307</b>	<b>333 213</b>

## 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 ordinaires couvertes	291 358	311 939	9,14	9,17	31 881 688	34 029 588
Parts ordinaires couvertes en \$ US	19 949	21 274	8,67*	8,65*	1 736 000	1 816 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	6 140	10 319
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(666)	(438)
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	(9)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(9 929)	(12 054)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	11 624	(75 623)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>7 169</b>	<b>(77 805)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(176)	94
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	9	10
Rabais sur frais	-	169
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	19	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(148)</b>	<b>273</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>7 021</b>	<b>(77 532)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 064	2 055
Frais d'administration (note 5)	65	126
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	35
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	14
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	125	228
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>1 262</b>	<b>2 459</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 759</b>	<b>(79 991)</b>

## 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 ordinaires couvertes	5 778	(76 696)	0,17	(1,27)	33 265 468	60 319 624
Parts ordinaires couvertes en \$ US	(19)	(3 295)	(0,01)	(1,33)	1 838 320	2 478 652

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	311 939	747 060	21 274	36 539	333 213	783 599
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 778	(76 696)	(19)	(3 295)	5 759	(79 991)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(5 701)	(7 909)	(373)	(465)	(6 074)	(8 374)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(671)	(3 729)	-	-	(671)	(3 729)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(6 372)</b>	<b>(11 638)</b>	<b>(373)</b>	<b>(465)</b>	<b>(6 745)</b>	<b>(12 103)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	13 448	13 969	3 521	1 915	16 969	15 884
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(33 435)	(179 829)	(4 454)	(10 055)	(37 889)	(189 884)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(19 987)</b>	<b>(165 860)</b>	<b>(933)</b>	<b>(8 140)</b>	<b>(20 920)</b>	<b>(174 000)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(20 581)</b>	<b>(254 194)</b>	<b>(1 325)</b>	<b>(11 900)</b>	<b>(21 906)</b>	<b>(266 094)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>291 358</b>	<b>492 866</b>	<b>19 949</b>	<b>24 639</b>	<b>311 307</b>	<b>517 505</b>

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 759	(79 991)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	9 929	12 054
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	100	(279)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	35
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(11 624)	75 623
Augmentation (diminution) des intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	5
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	91 993	312 916
Achat de placements et de dérivés	(74 319)	(142 835)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	(219)	5 316
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	(1 512)	(589)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	348	1 398
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(39)	(168)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	(10)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(9)	(20)
Amortissement des produits d'intérêts	51	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>20 463</b>	<b>183 455</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(6 744)	(12 103)
Produit de l'émission de parts rachetables	16 603	15 883
Montant versé au rachat de parts rachetables	(38 072)	(189 695)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(28 213)</b>	<b>(185 915)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(100)	279
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(7 750)	(2 460)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 057	5 994
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>207</b>	<b>3 813</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 538	11 717
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(18)
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 de qualité supérieure 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
		<b>CANADA</b>			
	520 000	407 International Inc., 3,14 %, 6 mars 2030	519 714	479 611	
	960 000	407 International Inc., 3,67 %, 8 mars 2049	958 781	820 761	
	500 000	407 International Inc., 3,98 %, 11 septembre 2052	539 460	449 179	
	685 000	Aéroports de Montréal, 3,44 %, 26 avril 2051	685 000	564 831	
	1 000 000	Aéroports de Montréal, série N, 3,36 %, 24 avril 2047	1 000 000	824 847	
	780 000	Aéroports de Montréal, série R, 3,03 %, 21 avril 2050	780 000	596 353	
	1 713 187	Alberta PowerLine LP, 4,07 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	1 713 187	1 521 349	
	910 000	Algonquin Power & Utilities Corp., 5,25 %, 18 janvier 2082	910 000	721 136	
	2 050 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	2 049 836	1 707 799	
	1 000 000	Algonquin Power Co., 4,09 %, 17 février 2027	999 290	947 581	
USD	330 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 2,95 %, 25 janvier 2030	432 787	375 873	
	225 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	218 723	219 232	
	225 000	Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	228 454	217 834	
	1 000 000	FPI Allied Properties, série C, 3,64 %, 21 avril 2025	1 000 000	955 439	
	500 000	FPI Allied Properties, série D, 3,39 %, 15 août 2029	500 000	426 882	
	2 170 000	FPI Allied Properties, série F, 3,12 %, 21 février 2030	2 076 891	1 795 380	
	860 000	AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	860 000	742 801	
	435 000	AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	435 000	407 599	
	1 295 000	AltaGas Ltd., 2,48 %, 30 novembre 2030	1 295 000	1 066 800	
	995 000	AltaGas Ltd., convertibles, taux variable, 11 janvier 2082	995 000	793 317	
	690 000	AltaGas Ltd., convertibles, taux variable, 17 août 2082	690 000	664 063	
	745 000	AltaLink LP, 3,72 %, 3 décembre 2046	745 000	654 077	
	520 000	AltaLink LP, série 20-1, 1,51 %, 11 septembre 2030	520 000	424 961	
	2 255 000	ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	2 255 000	2 076 827	
	5 505 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	5 505 000	4 834 360	
	1 530 000	Banque de Montréal, taux variable, 26 novembre 2080	1 530 000	1 405 145	
	3 975 000	Banque de Nouvelle-Écosse, série 1, convertibles, taux variable, 27 juillet 2081	3 975 000	2 876 058	
	495 000	Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 3 juillet 2029	495 000	479 725	
	2 805 000	BCI QuadReal Realty, 1,75 %, 24 juillet 2030	2 807 432	2 265 208	
	900 000	Bell Canada, 2,9 %, 10 septembre 2029	898 839	801 488	
	620 000	Bell Canada, 3,5 %, 30 septembre 2050	619 392	463 860	
	1 180 000	Bell Canada, 4,45 %, 27 février 2047	1 325 860	1 049 893	
	2 110 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 2,86 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2032	2 110 000	1 707 370	
	500 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,32 %, 22 février 2024	500 000	493 019	
	770 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 4,19 %, 11 septembre 2028	774 250	729 225	
	1 530 000	Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 24 août 2025	1 530 000	1 399 506	
	1 770 000	Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 15 janvier 2027	1 770 000	1 503 711	
	690 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,33 %, 13 août 2050	689 483	493 327	
	1 000 000	Bruce Power LP, série 19, 4,75 %, 21 juin 2049	999 910	937 410	
	2 530 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, convertibles, taux variable, 28 octobre 2080	2 530 000	2 324 923	
	1 205 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 juillet 2030	1 213 358	1 114 714	
	1 985 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 1 <sup>er</sup> août 2047	1 991 959	1 686 577	
	1 425 000	Canadian Natural Resources Ltd., 4,85 %, 30 mai 2047	1 425 000	1 293 301	
	1 325 000	Capital Power Corp., 3,15 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2032	1 325 000	1 099 411	
	525 000	Capital Power Corp., taux variable, 9 septembre 2082	525 000	514 324	
	1 770 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	1 770 000	1 657 834	
	545 000	Cenovus Energy Inc., 3,5 %, 7 février 2028	544 962	511 297	
	1 980 000	Central 1 Credit Union, 2,58 %, 6 décembre 2023	1 980 000	1 954 951	
	1 285 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	1 282 995	1 115 079	
	2 465 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	2 465 000	2 402 359	
	2 500 000	FPI Propriétés de Choix, série L, 4,18 %, 8 mars 2028	2 500 000	2 373 749	
	1 600 000	FPI Propriétés de Choix, série M, 3,53 %, 11 juin 2029	1 616 315	1 456 881	
	2 555 000	FPI Propriétés de Choix, série N, 2,98 %, 4 mars 2030	2 555 000	2 213 137	
	1 560 000	CNH Industrial Capital Canada Ltd., 1,5 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2024	1 559 002	1 478 262	
	535 000	Cogeco Communications Inc., 2,99 %, 22 septembre 2031	535 000	451 205	
	7 860 000	Services financiers Co-operators limitée, 3,33 %, 13 mai 2030	7 860 000	6 676 420	

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 de qualité supérieure 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
<b>CANADA (suite)</b>				
670 000	Corus Entertainment Inc., 5 %, 11 mai 2028	670 000	482 400	
650 000	Corus Entertainment Inc., restreint, 6 %, 28 février 2030	650 000	459 063	
335 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	332 072	318 026	
1 425 000	Dollarama Inc., 1,51 %, 20 septembre 2027	1 425 000	1 236 704	
480 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	486 480	477 039	
1 710 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	1 669 469	1 544 717	
2 995 000	FPI industriel Dream, série C, 2,06 %, 17 juin 2027	2 995 000	2 611 871	
1 905 000	Dream Summit Industrial LP, série C, 2,25 %, 12 janvier 2027	1 699 413	1 693 886	
384 850	Autorité aéroportuaire régionale d'Edmonton, série D, 3,72 %, 20 mai 2051	384 850	323 000	
2 320 000	L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, série 1, taux variable, 17 avril 2026	2 320 000	1 790 317	
835 000	Enbridge Gas Inc., 3,65 %, 1 <sup>er</sup> avril 2050	840 086	704 255	
1 170 000	Enbridge Inc., 4,1 %, 21 septembre 2051	1 166 186	934 375	
1 210 000	Enbridge Inc., convertibles, taux variable, 27 septembre 2077	1 210 000	1 109 751	
3 260 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,95 %, 3 mars 2031	3 268 020	2 833 130	
910 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,23 %, 14 juin 2029	909 563	842 925	
1 870 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 décembre 2027	1 798 990	1 760 371	
1 000 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	995 885	981 612	
1 360 000	FPI First Capital, série S, 4,32 %, 31 juillet 2025	1 365 508	1 307 689	
1 235 000	First National Financial Corp., série 2, 3,58 %, 25 novembre 2024	1 235 000	1 181 012	
2 140 000	First National Financial Corp., série 3, 2,96 %, 17 novembre 2025	2 140 000	1 961 403	
1 859 003	First Nations ETF LP, série 1A, 4,14 %, 31 décembre 2041	1 859 003	1 698 225	
2 310 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 3,5 %, 30 novembre 2023	2 310 000	2 281 654	
400 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 6,78 %, 15 septembre 2025	400 000	399 208	
1 480 000	Fortis Inc., 2,18 %, 15 mai 2028	1 479 230	1 311 938	
1 040 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,7 %, 9 juillet 2025	1 037 306	956 691	
1 775 000	Genworth MI Canada Inc., 2,96 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	1 774 982	1 574 740	
850 000	Gibson Energy Inc., 2,45 %, 14 juillet 2025	848 334	796 853	
2 540 000	Gibson Energy Inc., 2,85 %, 14 juillet 2027	2 539 365	2 308 551	
1 265 000	Gibson Energy Inc., série 20-A, convertibles, taux variable, 22 décembre 2080	1 265 000	1 048 299	
1 030 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2026	927 227	928 200	
3 230 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	2 967 061	2 970 712	
1 170 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2030	952 310	951 982	
30 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 <sup>er</sup> février 2024	29 219	29 299	
1 250 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2026	1 143 880	1 140 794	
5 140 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 <sup>er</sup> juin 2027	4 674 448	4 642 085	
1 360 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	1 246 353	1 239 596	
3 120 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> juin 2030	2 715 098	2 713 396	
2 640 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	2 537 485	2 540 034	
1 450 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2026	1 353 715	1 349 661	
790 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2031	688 305	689 422	
710 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2031	610 955	615 687	
9 170 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2053	6 563 444	6 768 018	
6 100 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2028	5 702 403	5 686 418	
645 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2032	579 468	580 472	
615 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 <sup>er</sup> juin 2025	593 291	590 291	
1 380 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2027	1 333 977	1 326 242	
1 510 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> juin 2033	1 427 252	1 445 264	
600 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2048	543 138	560 332	
350 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 19-2, 2,75 %, 17 octobre 2039	349 517	277 891	
390 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 21-1, 3,15 %, 5 octobre 2051	389 321	306 957	
6 405 000	Great-West Lifeco Inc., série 1, taux variable, 31 décembre 2081	6 405 000	4 734 433	
1 000 000	FPI H&R, 3,37 %, 30 janvier 2024	1 007 750	986 594	
1 070 000	Hydro One Inc., 2,71 %, 28 février 2050	934 633	764 658	
1 175 000	Hydro One Ltd., 1,41 %, 15 octobre 2027	1 174 612	1 027 337	
1 090 000	Hyundai Capital Canada Inc., série A, 2,01 %, 12 mai 2026	1 062 474	984 647	
2 500 000	Société financière IGM Inc., 6 %, 10 décembre 2040	3 087 013	2 750 530	

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 de qualité supérieure 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
<b>CANADA (suite)</b>				
3 810 000	L'Ordre Indépendant des Forestiers, série 20-1, taux variable, 15 octobre 2035	3 810 000	3 116 457	
1 090 000	Intact Corporation financière, 2,95 %, 16 décembre 2050	1 090 000	793 483	
1 375 000	Intact Corporation financière, convertibles, taux variable, restreint, 31 mars 2081	1 375 000	1 173 717	
500 000	Inter Pipeline Ltd., 2,73 %, 18 avril 2024	500 000	488 502	
1 890 000	Inter Pipeline Ltd., 4,23 %, 1 <sup>er</sup> juin 2027	1 890 000	1 801 266	
1 585 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	1 585 000	1 393 666	
435 000	Inter Pipeline Ltd., série 19-A, convertibles, taux variable, 26 mars 2079	443 699	408 398	
560 000	Keyera Corp., 3,96 %, 29 mai 2030	560 000	514 214	
735 000	Keyera Corp., 5,02 %, 28 mars 2032	735 000	709 912	
1 870 000	Keyera Corp., convertibles, taux flottant, 13 juin 2079	1 870 000	1 755 513	
680 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 2,28 %, 7 mai 2030	680 000	578 466	
8 350 000	Société Financière Manuvie, série 1, taux variable, 19 juin 2081	8 349 999	6 143 956	
2 150 000	MCAP Commercial LP, 3,38 %, 26 novembre 2027	2 150 000	1 882 472	
1 690 000	MCAP Commercial LP, 3,74 %, 25 août 2025	1 690 000	1 582 353	
930 000	Metro Inc., 3,39 %, 6 décembre 2027	929 451	873 985	
1 715 000	Metro Inc., 3,41 %, 28 février 2050	1 715 000	1 310 978	
2 515 000	Metro Inc., 4,27 %, 4 décembre 2047	2 512 460	2 238 911	
1 520 000	Administration portuaire de Montréal, série A, 3,24 %, 22 mars 2051	1 520 000	1 214 505	
1 910 000	Banque Nationale du Canada, convertibles, taux variable, 15 août 2081	1 910 000	1 431 770	
1 960 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	1 960 000	1 894 813	
685 000	Nissan Canada Inc., 2,1 %, 22 septembre 2025	685 000	623 108	
1 652 440	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série C, 3,75 %, 31 mars 2033	1 652 440	1 515 447	
1 377 326	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série D, 3,74 %, 31 décembre 2032	1 377 326	1 270 225	
480 000	OMERS Realty Corp., série 11, 3,63 %, 5 juin 2030	487 113	440 413	
150 000	PACCAR Financial Ltd., 0,99 %, 14 mai 2024	150 000	144 317	
1 140 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	1 139 714	1 058 276	
1 840 000	Pembina Pipeline Corp., 4,54 %, 3 avril 2049	1 950 786	1 563 513	
5 465 000	Pembina Pipeline Corp., convertibles, taux variable, 25 janvier 2081	5 465 000	4 463 316	
1 500 000	Pembina Pipeline Corp., série 4, 4,81 %, 25 mars 2044	1 486 335	1 342 117	
2 750 000	Pembina Pipeline Corp., série 15, 3,31 %, 1 <sup>er</sup> février 2030	2 747 910	2 452 207	
1 065 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 2,7 %, 30 septembre 2024	1 062 827	1 023 813	
1 480 000	Power Corporation du Canada, 4,46 %, 27 juillet 2048	1 483 015	1 369 235	
805 000	Reliance LP, 2,68 %, 1 <sup>er</sup> décembre 2027	804 855	712 771	
1 885 000	FPI RioCan, série AC, 2,36 %, 10 mars 2027	1 885 000	1 662 767	
545 000	Rogers Communications Inc., 6,56 %, 22 mars 2041	674 321	595 838	
1 070 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, restreint, 17 décembre 2081	1 070 000	973 289	
5 345 000	Banque Royale du Canada, série 2, taux variable, 24 février 2081	5 345 000	4 732 521	
1 475 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 25 juillet 2029	1 475 000	1 425 664	
1 900 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 23 décembre 2029	1 899 829	1 816 249	
2 885 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 28 janvier 2033	2 885 000	2 416 584	
980 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2080	980 000	909 686	
795 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2081	795 000	583 491	
7 250 000	Sagen MI Canada Inc., 3,26 %, 5 mars 2031	7 250 000	5 910 966	
2 135 000	Saputo Inc., 1,42 %, 19 juin 2026	2 135 000	1 913 565	
515 000	Saputo Inc., 2,24 %, 16 juin 2027	515 000	463 186	
2 195 000	Shaw Communications Inc., 3,3 %, 10 décembre 2029	2 184 618	1 952 560	
750 000	Shaw Communications Inc., 4,25 %, 9 décembre 2049	746 093	604 424	
1 375 000	Shaw Communications Inc., 6,75 %, 9 novembre 2039	1 666 066	1 523 220	
815 000	SmartCentres REIT, série U, 3,53 %, 20 décembre 2029	815 000	713 030	
115 000	SmartCentres REIT, série V, 3,19 %, 11 juin 2027	115 000	104 405	
1 580 000	SmartCentres REIT, série Y, 2,31 %, 18 décembre 2028	1 275 724	1 321 023	
760 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,15 %, 16 novembre 2048	758 807	619 137	
600 000	Superior Plus LP, 4,25 %, 18 mai 2028	600 000	534 625	
620 000	TELUS Corp., série CAA, 3,15 %, 19 février 2030	616 100	552 324	
1 685 000	TELUS Corp., série CY, 3,3 %, 2 mai 2029	1 671 099	1 538 649	
2 050 000	Teranet Holdings LP, série 20, 3,54 %, 11 juin 2025	2 050 000	1 958 737	

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 de qualité supérieure 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
		<b>CANADA (suite)</b>			
	1 775 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	1 775 000	1 674 886	
	870 000	Groupe TMX Limitée, série E, 3,78 %, 5 juin 2028	870 000	828 223	
	350 000	Industries Toromont Limitée, 3,84 %, 27 octobre 2027	350 000	334 116	
	6 750 000	Banque Toronto Dominion (La), série 1, convertibles, taux variable, 31 octobre 2081	6 750 000	4 966 255	
	3 545 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	3 545 000	3 372 612	
	2 070 000	Tourmaline Oil Corp., série 1, 2,08 %, 25 janvier 2028	2 070 000	1 811 006	
	1 525 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,8 %, 5 avril 2027	1 522 575	1 452 113	
	3 040 000	TransCanada Trust, série 2017-A, convertibles, taux variable, 18 mai 2077	3 119 126	2 707 082	
	770 000	Transcontinental Inc., 2,28 %, 13 juillet 2026	770 000	692 689	
	3 475 000	Vidéotron Ltée, 3,13 %, 15 janvier 2031	3 458 725	2 703 984	
	555 000	Vidéotron Ltée, 3,63 %, 15 juin 2028	553 034	483 023	
	900 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	898 110	829 358	
	1 165 000	WSP Global Inc., 2,41 %, 19 avril 2028	1 165 000	1 032 315	
			<b>297 712 128</b>	<b>263 748 615</b>	<b>84,7</b>
		<b>É.-U.</b>			
USD	575 000	American Tower Corp., 1,88 %, 15 octobre 2030	764 430	601 735	
	600 000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc., 4,32 %, 15 mai 2047	595 894	542 116	
	2 040 000	Athene Global Funding, 2,1 %, 24 septembre 2025	2 037 491	1 866 251	
USD	465 000	Bank of America Corp., série N, taux variable, 11 mars 2032	587 783	510 265	
	2 040 000	Bank of America Corp., taux variable, 25 avril 2025	2 043 596	1 994 934	
	1 000 000	Bank of America Corp., taux variable, 20 septembre 2025	1 000 000	970 958	
USD	60 000	Bank of America Corp., taux variable, 23 juillet 2031	76 017	63 309	
USD	230 000	Bank of America Corp., taux variable, 24 octobre 2051	303 370	199 919	
USD	780 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 2,3 %, 1 <sup>er</sup> février 2032	849 813	782 443	
USD	660 000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 5,38 %, 1 <sup>er</sup> mai 2047	899 354	723 701	
USD	855 000	Citigroup Inc., taux variable, 3 novembre 2032	1 056 994	912 861	
USD	210 000	Citigroup Inc., taux variable, 25 janvier 2033	262 868	232 243	
USD	145 000	Comcast Corp., 2,89 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2051	166 079	128 694	
USD	780 000	Cox Communications Inc., 2,6 %, 15 juin 2031	937 127	843 604	
USD	620 000	Cox Communications Inc., 2,95 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2050	811 463	515 757	
USD	100 000	Equinix Inc., 1 %, 15 septembre 2025	133 405	119 665	
USD	635 000	Equinix Inc., 1,55 %, 15 mars 2028	847 207	704 075	
USD	170 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1 <sup>er</sup> mars 2028	220 362	211 868	
	2 750 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 31 octobre 2025	2 750 000	2 656 890	
USD	420 000	Great-West Lifeco US Finance 2020 LP, 0,9 %, 12 août 2025	559 083	500 059	
USD	125 000	Masco Corp., 3,13 %, 15 février 2051	157 753	104 368	
USD	705 000	Molson Coors Beverage Co., 4,2 %, 15 juillet 2046	976 997	773 359	
USD	535 000	MSCI Inc., 3,25 %, 15 août 2033	653 744	571 517	
USD	90 000	T-Mobile USA Inc., 4,5 %, 15 avril 2050	126 768	102 194	
USD	215 000	United Rentals North America Inc., 3,88 %, 15 novembre 2027	274 357	265 323	
USD	1 400 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 mai 2033	1 852 737	1 787 854	
USD	210 000	Obligation du Trésor américain, 3,38 %, 15 août 2042	251 513	252 231	
USD	475 000	Obligation du Trésor américain, 3,5 %, 15 février 2033	638 475	612 738	
USD	2 150 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	2 802 536	2 729 833	
USD	365 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 mai 2053	471 356	463 966	
USD	710 000	Obligation du Trésor américain, 3,88 %, 15 mai 2043	936 981	916 323	
USD	395 000	Utah Acquisition Sub Inc., 5,25 %, 15 juin 2046	383 618	412 427	
	770 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	768 576	657 726	
USD	1 435 000	Verizon Communications Inc., 2,88 %, 20 novembre 2050	1 870 239	1 237 421	
	370 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	365 660	283 737	
USD	630 000	Verizon Communications Inc., 4,33 %, 21 septembre 2028	806 849	804 952	
USD	255 000	Viatis Inc., 1,65 %, 22 juin 2025	346 317	310 929	
USD	685 000	Viatis Inc., 2,7 %, 22 juin 2030	929 435	734 398	
USD	455 000	Viatis Inc., 4 %, 22 juin 2050	617 690	398 658	

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 de qualité supérieure 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
		<b>É.-U. (suite)</b>			
	1 190 000	Wells Fargo & Co., 3,18 %, 8 février 2024	1 167 985	1 173 273	
	1 630 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 1 <sup>er</sup> mai 2026	1 630 000	1 534 363	
USD	640 000	Western Midstream Operating LP, taux échelonné, 1 <sup>er</sup> février 2050	839 312	695 746	
			<b>35 771 234</b>	<b>31 904 683</b>	<b>10,2</b>
		<b>R.-U.</b>			
	2 980 000	Aviva PLC, 4 %, 2 octobre 2030	2 977 080	2 661 527	
	635 000	Lloyds Banking Group PLC, 3,5 %, 3 février 2025	635 000	607 185	
	1 865 000	National Grid Electricity Transmission PLC, 2,3 %, 22 juin 2029	1 865 000	1 602 423	
			<b>5 477 080</b>	<b>4 871 135</b>	<b>1,6</b>
		<b>PAYS-BAS</b>			
USD	765 000	Viterra Finance B.V., 2 %, 21 avril 2026	956 166	905 458	
USD	1 525 000	Viterra Finance B.V., 3,2 %, 21 avril 2031	1 905 356	1 690 831	
			<b>2 861 522</b>	<b>2 596 289</b>	<b>0,8</b>
		<b>JERSEY</b>			
	315 000	Heathrow Funding Ltd., 3,4 %, 8 mars 2030	314 575	291 269	
	1 280 000	Heathrow Funding Ltd., 3,78 %, 4 septembre 2032	1 280 000	1 165 766	
			<b>1 594 575</b>	<b>1 457 035</b>	<b>0,5</b>
		<b>AUSTRALIE</b>			
	575 000	Macquarie Group Ltd., taux variable, 21 août 2029	575 000	493 105	
					<b>0,2</b>
		<b>BERMUDES</b>			
USD	365 000	Bacardi Ltd., 5,3 %, 15 mai 2048	466 040	455 063	
					<b>0,1</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>344 457 579</b>	<b>305 525 925</b>	<b>98,1</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-	
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>344 457 579</b>	<b>305 525 925</b>	<b>98,1</b>
		Contrat(s) de change à terme		109 829	-
		Swap(s) sur défaillance		(1 098 781)	(0,3)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>344 457 579</b>	<b>304 536 973</b>	<b>97,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		6 769 573	2,2
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>311 306 546</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie <sup>*</sup>	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position contractuel	Taux	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	30 151 116	USD	22 559 690	1,34	269 572
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	228 286	USD	173 459	1,32	(1 470)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	660 300	USD	500 000	1,32	(1 977)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	CAD	453 628	USD	344 032	1,32	(2 062)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	EUR	3 211 440	CAD	4 625 636	0,69	18 283
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	379 884	CAD	500 000	0,76	3 178
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	344 032	CAD	453 628	0,76	2 062
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	173 459	CAD	228 286	0,76	1 470
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	14 juillet 2023	USD	15 541 674	CAD	20 765 024	0,75	(179 227)
		<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>						<b>109 829</b>

<sup>\*</sup>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'obligations de qualité supérieure CI

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

## Swap(s) sur défaillance

Swap(s)	Nombre de contrats	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
Verse tous les trimestres 1,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX CDX-NAIGS40 V1 5Y P 1 %	1	Citigroup Global Market Inc.	A+	20 juin 2028	5 945 000	(117 825)
Verse tous les trimestres 5,00 % du montant nominal et ne reçoit un paiement qu'en cas d'un défaut de l'indice de CDX iTraxx Europe Crossover S39 V1 5Y P 5 %	1	Citigroup Global Market Inc.	A+	20 juin 2028	17 135 000	(980 956)
<b>Valeur totale du (des) swap(s) sur défaillance</b>						<b>(1 098 781)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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	295	(185)	-	110
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>295</b>	<b>(185)</b>	<b>-</b>	<b>110</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(185)	185	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(1 099)	-	-	(1 099)
<b>Total</b>	<b>(1 284)</b>	<b>185</b>	<b>-</b>	<b>(1 099)</b>

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	333	(255)	-	78
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>333</b>	<b>(255)</b>	<b>-</b>	<b>78</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(255)	255	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(327)	-	-	(327)
<b>Total</b>	<b>(582)</b>	<b>255</b>	<b>-</b>	<b>(327)</b>

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	34 029 588	68 716 788	1 816 000	2 836 000
Parts rachetables émises	1 445 000	1 398 000	300 000	160 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(3 592 900)	(17 936 100)	(380 000)	(840 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>31 881 688</b>	<b>52 178 688</b>	<b>1 736 000</b>	<b>2 156 000</b>

<sup>†</sup> 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 de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires couvertes	0,650	0,04
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650	0,04

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	20 391
Garanties (hors trésorerie)	-	21 521

## 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	13	17
Charges	(4)	(7)
Revenu tiré des prêts de titres	9	10
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>40,7</b>

# FNB d'obligations de qualité supérieure 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 - Canada	82,0
Obligations - É.-U.	9,9
Autres actifs (passifs) nets	3,8
Obligations - R.-U.	2,4
Obligations - Jersey	0,9
Obligations - Pays-Bas	0,7
Obligations - Bermudes	0,2
Obligations - Australie	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,0
Contrat(s) à terme standardisé(s)	0,0
Obligations - Obligations provinciales et obligations garanties	0,0
Swap(s) sur défaillance	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	14,9
AA/Aa/A+	3,1
A	12,4
BBB/Baa/B++	54,4
BB/Ba/B+	10,0
B	1,7
CCC/Caa/C++	1,0
CC/Ca/C+	0,1
Aucune	0,6
<b>Total</b>	<b>98,2</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,5
AA/Aa/A+	2,6
A	16,8
BBB/Baa/B++	68,4
BB/Ba/B+	8,1
<b>Total</b>	<b>96,4</b>

\* 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

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	30 890	(9 573)	21 317	6,8
Euro	(3 814)	3 663	(151)	0,0
<b>Total</b>	<b>27 076</b>	<b>(5 910)</b>	<b>21 166</b>	<b>6,8</b>

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	33 853	(12 052)	21 801	6,5
Euro	(3 035)	3 104	69	0,0
<b>Total</b>	<b>30 818</b>	<b>(8 948)</b>	<b>21 870</b>	<b>6,5</b>

~ 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 2 117 000 \$ (2 187 000 \$ 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

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	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	<b>9 446</b>	<b>49 746</b>	<b>52 460</b>	<b>193 874</b>	<b>305 526</b>

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	<b>4 182</b>	<b>43 031</b>	<b>47 952</b>	<b>225 576</b>	<b>320 741</b>

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt (suite)

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 6 675 000X \$ (7 021 000 \$ 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	-	305 526	-	305 526
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	110	-	110
Swap(s)	-	(1 099)	-	(1 099)
<b>Total</b>	-	304 537	-	304 537

### 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	-	320 741	-	320 741
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	78	-	78
<b>Total</b>	-	320 819	-	320 819

### Positions vendeur 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)
Contrat(s) à terme standardisé(s) (montant net)	82	-	-	82
Swap(s)	-	(327)	-	(327)
<b>Total</b>	82	(327)	-	(245)

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 Morningstar Canada Momentum 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	574 914	640 963
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	381	946
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	143	198
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	1 009	1 512
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	3	-
	576 450	643 619
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	282	345
Comptes créditeurs et charges à payer	174	237
	456	582
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	575 994	643 037

## 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 ordinaires	575 994	643 037	24,83	24,00	23 199 315

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

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	6 017	13 286
Intérêts aux fins des distributions	32	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	13 983	64 798
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	8 595	(130 500)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>28 627</b>	<b>(52 415)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	12	103
Rabais sur frais	950	1 990
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>961</b>	<b>2 092</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>29 588</b>	<b>(50 323)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 813	2 865
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	233	188
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	2
Taxe de vente harmonisée	82	83
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>2 129</b>	<b>3 139</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>27 459</b>	<b>(53 462)</b>

## 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 ordinaires	27 459	(53 462)	1,11	(1,40)	24 688 818	38 236 608

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

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	643 037	823 488
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	27 459	(53 462)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1 783)	(3 094)
Profits nets réalisés	(3 704)	(18 723)
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(5 487)	(21 817)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	32 386	261 386
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	16 469
Rachat de parts rachetables	(121 401)	(151 254)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(89 015)	126 601
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(67 043)	51 322
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	575 994	874 810

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

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	27 459	(53 462)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(13 983)	(64 798)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	233	188
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(8 595)	130 500
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	253 370	352 815
Achat de placements et de dérivés	(253 427)	(385 363)
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	503	(704)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(63)	48
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(7)	4
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>5 490</b>	<b>(20 772)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(5 487)	(5 348)
Produit de l'émission de parts rachetables	152	83 583
Montant versé au rachat de parts rachetables	(720)	(57 252)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(6 055)</b>	<b>20 983</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(565)	211
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	946	927
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>381</b>	<b>1 138</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 520	12 580
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	32	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 Morningstar Canada Momentum 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
186 601	BRP Inc. du Canada	15 266 517	20 897 447	
226 582	Dollarama Inc.	12 701 579	20 328 938	
476 161	Gildan Activewear Inc.	21 824 912	20 336 837	
187 569	Restaurant Brands International Inc.	18 924 257	19 265 212	
403 282	Uni-Sélect inc.	14 994 219	18 974 418	
		<b>83 711 484</b>	<b>99 802 852</b>	<b>17,3</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
324 812	ATS Corp.	14 443 478	19 797 291	
316 666	Bombardier Inc., catégorie B	17 808 534	20 681 457	
1 205 969	Mullen Group Ltd.	18 051 482	18 306 609	
518 839	Métaux Russel Inc.	16 939 174	19 041 391	
134 236	TFI International Inc.	13 627 865	20 260 239	
		<b>80 870 533</b>	<b>98 086 987</b>	<b>17,0</b>
<b>MATÉRIAUX</b>				
1 980 327	Dundee Precious Metals Inc.	19 304 229	17 327 861	
4 787 049	IAMGOLD Corp.	18 635 123	16 802 542	
877 068	Redevances aurifères Osisko Ltée	18 069 387	17 857 104	
294 923	Stella-Jones Inc.	14 301 525	20 119 647	
918 609	Torex Gold Resources Inc.	14 850 762	17 288 221	
		<b>85 161 026</b>	<b>89 395 375</b>	<b>15,5</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
6 961	Constellation Software Inc.	11 586 043	19 106 274	
191 405	Descartes Systems Group Inc. (The)	20 330 186	20 311 899	
334 753	Open Text Corp.	16 938 375	18 444 890	
229 765	Shopify Inc., catégorie A	19 653 564	19 672 479	
		<b>68 508 168</b>	<b>77 535 542</b>	<b>13,5</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
942 541	Element Fleet Management Corp.	17 884 743	19 020 477	
19 226	Fairfax Financial Holdings Ltd.	15 433 728	19 077 768	
195 522	Banque Nationale du Canada	15 375 778	19 298 021	
509 979	Trisura Group Ltd.	21 578 850	19 159 911	
		<b>70 273 099</b>	<b>76 556 177</b>	<b>13,3</b>
<b>ÉNERGIE</b>				
956 437	Enerplus Corp.	12 138 973	18 363 590	
665 009	Parex Resources Inc.	18 066 895	17 662 639	
1 129 140	ShawCor Ltd.	19 319 476	21 634 323	
		<b>49 525 344</b>	<b>57 660 552</b>	<b>10,0</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
291 316	Alimentation Couche-Tard Inc.	17 305 199	19 789 096	
161 542	Les Compagnies Loblaw limitée	19 626 860	19 591 814	
		<b>36 932 059</b>	<b>39 380 910</b>	<b>6,8</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
575 677	Québecor Inc., catégorie B	17 243 204	18 795 854	3,3
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
1 427 398	TransAlta Corp.	18 907 122	17 699 735	3,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>511 132 039</b>	<b>574 913 984</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(285 598)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>510 846 441</b>	<b>574 913 984</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets			1 080 417	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>575 994 401</b>	<b>100,0</b>

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 Morningstar Canada Momentum 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	228	179
Paiements indirects <sup>†</sup>	81	77

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	26 799 315	33 349 315
Parts rachetables émises	1 300 000	10 300 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(4 900 000)	(6 050 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>23 199 315</b>	<b>37 599 315</b>

<sup>†</sup> 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 Morningstar Canada Momentum 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 ordinaires	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	52 918
Garanties (hors trésorerie)	-	55 908

## 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	19	233
Charges	(7)	(130)
Revenu tiré des prêts de titres	12	103
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>35,9</b>	<b>55,9</b>

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum 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 (%)
Actions - Énergie	17,4
Actions - Services financiers	16,5
Actions - Produits industriels	16,5
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	16,2
Actions - Biens de consommation de base	12,9
Actions - Matériaux	6,8
Actions - Services publics	6,4
Actions - Services de communication	3,6
Actions - Technologies de l'information	3,4
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Actions - Immobilier	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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	(\$)
Morningstar® Canada Target Momentum Total Return Index™	57 299 097

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Canada Target Momentum Total Return Index™	63 562 339

### 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	574 914	-	-	574 914
<b>Total</b>	<b>574 914</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>574 914</b>

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	640 963	-	-	640 963
<b>Total</b>	<b>640 963</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>640 963</b>

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 Morningstar Canada Valeur 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	317 711	407 053
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	1 060	992
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	129	164
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	821	858
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	319 721	409 067
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	6	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	170	215
Comptes créditeurs et charges à payer	148	188
	324	403
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>319 397</b>	<b>408 664</b>

## 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 ordinaires	319 397	408 664	20,49	19,95	15 588 640	20 488 640

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

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	6 676	4 817
Intérêts aux fins des distributions	19	-
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	1 855	15 286
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	8 636	(45 782)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>17 186</b>	<b>(25 679)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	34	34
Rabais sur frais	887	721
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>920</b>	<b>755</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>18 106</b>	<b>(24 924)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 149	1 022
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	320	163
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	24	28
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>1 494</b>	<b>1 214</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>16 612</b>	<b>(26 138)</b>

## 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 ordinaires	16 612	(26 138)	0,89	(1,61)	18 712 673	16 208 806

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

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	408 664	261 597
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	16 612	(26 138)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(3 126)	(3 847)
Profits nets réalisés	(2 292)	(664)
Remboursement de capital	-	(21)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(5 418)	(4 532)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	11 462	199 262
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(111 923)	(33 355)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(100 461)	165 907
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(89 267)	135 237
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	319 397	396 834

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

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	16 612	(26 138)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 855)	(15 286)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	320	163
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(8 636)	45 782
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	156 052	99 931
Achat de placements et de dérivés	(134 007)	(275 242)
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	37	69
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(45)	84
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(5)	7
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>28 473</b>	<b>(170 630)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(5 419)	(4 532)
Produit de l'émission de parts rachetables	40	175 974
Montant versé au rachat de parts rachetables	(23 026)	(284)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(28 405)</b>	<b>171 158</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	68	528
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	992	531
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 060</b>	<b>1 059</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 713	4 886
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	19	-
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 Morningstar Canada Valeur 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
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
157 696	EQB Inc.	9 189 565	11 038 720	
277 494	Great-West Lifeco Inc.	9 036 772	10 675 194	
119 057	iA Société financière inc.	7 891 119	10 744 894	
410 749	Société Financière Manuvie	9 759 243	10 285 155	
303 941	Power Corporation du Canada	10 444 183	10 838 536	
		<b>46 320 882</b>	<b>53 582 499</b>	<b>16,8</b>
<b>ÉNERGIE</b>				
373 446	Parex Resources Inc.	8 875 538	9 918 726	
309 918	Corporation Parkland	10 525 801	10 227 294	
1 723 368	Secure Energy Services Inc.	10 555 909	10 926 153	
261 297	Suncor Énergie Inc.	10 344 033	10 154 001	
3 201 282	Trican Well Service Ltd.	9 563 906	11 300 526	
		<b>49 865 187</b>	<b>52 526 700</b>	<b>16,4</b>
<b>MATÉRIAUX</b>				
1 112 038	Dundee Precious Metals Inc.	10 845 414	9 730 332	
182 600	Methanex Corp.	8 541 179	9 995 524	
250 299	Stelco Holdings Inc.	12 738 683	10 817 923	
186 263	Ressources Teck Limitée, catégorie B	8 949 805	10 382 300	
515 842	Torex Gold Resources Inc.	8 306 280	9 708 146	
		<b>49 381 361</b>	<b>50 634 225</b>	<b>15,9</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
63 095	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	10 076 624	11 427 767	
157 037	Linamar Corp.	9 344 828	10 932 916	
835 792	Martinrea International Inc.	11 313 695	11 074 244	
226 466	Uni-Sélect inc.	8 528 542	10 655 225	
		<b>39 263 689</b>	<b>44 090 152</b>	<b>13,8</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
427 025	AltaGas Ltd.	10 082 400	10 163 195	
257 499	ATCO Ltd., catégorie I	10 808 936	10 155 760	
292 476	Canadian Utilities Ltd., catégorie A	10 422 452	10 034 852	
231 368	Capital Power Corp.	9 271 788	9 740 593	
		<b>40 585 576</b>	<b>40 094 400</b>	<b>12,6</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
311 542	Empire Co., Ltd., catégorie A	11 889 858	11 723 325	
69 016	George Weston Limitée	9 365 996	10 809 286	
90 739	Les Compagnies Loblaw limitée	8 551 314	11 004 826	
		<b>29 807 168</b>	<b>33 537 437</b>	<b>10,5</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
269 159	Finning International Inc.	7 955 703	10 968 229	
677 190	Mullen Group Ltd.	10 105 776	10 279 744	
291 359	Métaux Russel Inc.	9 279 539	10 692 876	
		<b>27 341 018</b>	<b>31 940 849</b>	<b>10,0</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
159 919	Cogeco Communications Inc.	14 143 438	11 304 674	3,5
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>296 708 319</b>	<b>317 710 936</b>	<b>99,5</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(348 563)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>296 359 756</b>	<b>317 710 936</b>	<b>99,5</b>
Autres actifs (passifs) nets			1 686 063	0,5
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>319 396 999</b>	<b>100,0</b>

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 Morningstar Canada Valeur 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	318	158
Paiements indirects <sup>†</sup>	112	68

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	20 488 640	12 638 640
Parts rachetables émises	550 000	9 400 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(5 450 000)	(1 600 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	15 588 640	20 438 640

<sup>†</sup> 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 Morningstar Canada Valeur 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 ordinaires	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	21 252
Garanties (hors trésorerie)	-	22 631

## 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	63	69
Charges	(29)	(35)
Revenu tiré des prêts de titres	34	34
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>46,1</b>	<b>50,3</b>

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur 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 (%)
Actions - Énergie	17,3
Actions - Matériaux	17,1
Actions - Services financiers	16,7
Actions - Services publics	13,0
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	12,5
Actions - Produits industriels	9,9
Actions - Biens de consommation de base	9,6
Actions - Services de communication	3,5
Autres actifs (passifs) nets	0,4
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Canada Target Value Total Return Index™	31 593 418

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Canada Target Value Total Return Index™	40 530 336

### 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	317 711	-	-	317 711
<b>Total</b>	<b>317 711</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>317 711</b>

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	407 053	-	-	407 053
<b>Total</b>	<b>407 053</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>407 053</b>

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 Morningstar International Momentum 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	55 697	56 300
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	134	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	439	188
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	7	9
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	78	83
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	28	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	56 383	56 580
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	16
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	59	359
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	38	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	28	29
Comptes créditeurs et charges à payer	177	145
	302	549
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>56 081</b>	<b>56 031</b>

## 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 ordinaires couvertes	31 157	28 706	35,45	32,66	878 902
Parts ordinaires non couvertes	24 924	27 325	32,67	31,67	762 975	862 975

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 745	3 700
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	1 447	(24 184)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 981	(49 813)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>5 174</b>	<b>(70 297)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(18)	(99)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	15	35
Rabais sur frais	48	482
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	13	115
<b>Total des autres revenus</b>	<b>58</b>	<b>533</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>5 232</b>	<b>(69 764)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	165	617
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	111	315
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	14
Retenues d'impôts	194	560
Taxe de vente harmonisée	18	24
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>489</b>	<b>1 531</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>4 743</b>	<b>(71 295)</b>

## 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 ordinaires couvertes	3 096	(15 229)	3,64	(9,93)	851 278	1 532 880
Parts ordinaires non couvertes	1 647	(56 066)	2,06	(14,12)	799 992	3 969 605

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	28 706	36 929	27 325	262 009	56 031	298 938
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 096	(15 229)	1 647	(56 066)	4 743	(71 295)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(700)	(78)	(663)	(201)	(1 363)	(279)
Profits nets réalisés	-	(617)	-	(909)	-	(1 526)
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(700)	(695)	(663)	(1 110)	(1 363)	(1 805)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	3 398	34 859	-	3 825	3 398	38 684
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 343)	(26 681)	(3 385)	(182 145)	(6 728)	(208 826)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	55	8 178	(3 385)	(178 320)	(3 330)	(170 142)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 451	(7 746)	(2 401)	(235 496)	50	(243 242)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	31 157	29 183	24 924	26 513	56 081	55 696

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 743	(71 295)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 447)	24 184
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	2	(8)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	111	315
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 981)	49 813
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	45 647	293 978
Achat de placements et de dérivés	(42 267)	(130 573)
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	338
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(112)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	35	13
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>4 846</b>	<b>166 653</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 364)	(1 804)
Produit de l'émission de parts rachetables	3 398	38 683
Montant versé au rachat de parts rachetables	(6 728)	(205 579)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(4 694)</b>	<b>(168 700)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	8
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	152	(2 047)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(16)	2 287
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>134</b>	<b>248</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 556	3 477
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(14)
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 Morningstar International Momentum 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
<b>JAPON</b>					
JPY	1 658	Advantest Corp.	129 305	290 685	
JPY	7 062	ASAHY YUKIZAI Corp.	285 720	282 215	
JPY	4 908	Capcom Co., Ltd.	160 136	255 898	
JPY	32 136	Citizen Watch Co., Ltd.	258 135	254 788	
JPY	1 406	Disco Corp.	190 871	291 041	
JPY	841	Fast Retailing Co., Ltd.	216 136	282 727	
JPY	11 039	Fields Corp.	220 480	301 880	
JPY	24 957	Fujikura Ltd.	222 186	274 755	
JPY	2 257	GOLDWIN Inc.	177 046	252 093	
JPY	1 336	Hikari Tsushin Inc.	240 361	251 966	
JPY	3 700	Horiba Ltd.	281 940	278 820	
JPY	10 128	I'LL Inc.	275 322	275 761	
JPY	5 567	ITOCHU Corp.	239 457	289 850	
JPY	6 245	JACCS Co., Ltd.	219 414	287 015	
JPY	9 167	Japan Tobacco Inc.	245 931	264 618	
JPY	57 897	JVCKENWOOD Corp.	274 854	261 850	
JPY	5 356	KAGA ELECTRONICS CO., LTD.	212 894	312 355	
JPY	8 907	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	153 058	286 959	
JPY	26 982	Kitz Corp.	279 344	268 023	
JPY	24 720	KOSHIDAKA HOLDINGS Co., Ltd.	282 020	272 259	
JPY	2 646	Kotobuki Spirits Co., Ltd.	242 753	254 844	
JPY	5 664	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc.	201 948	308 020	
JPY	13 562	Marubeni Corp.	175 325	302 958	
JPY	4 724	Mitsubishi Corp.	305 176	299 717	
JPY	7 002	Mitsuboshi Belting Ltd.	282 722	282 382	
JPY	5 955	Mitsui & Co., Ltd.	201 849	295 004	
JPY	8 891	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	204 634	281 315	
JPY	6 659	NIPPON PILLAR PACKING CO., LTD.	247 296	283 486	
JPY	5 897	Nippon Soda Co., Ltd.	248 385	279 120	
JPY	9 993	Nippon Steel Corp.	236 137	274 830	
JPY	9 436	Nippon Yusen Kabushiki Kaisha	225 711	275 580	
JPY	10 270	NSD CO., LTD.	246 119	271 260	
JPY	4 063	Okuma Corp.	281 314	285 864	
JPY	3 227	Omron Corp.	279 210	259 041	
JPY	7 527	Organo Corp.	239 247	291 840	
JPY	7 879	Pal Co., Ltd.	281 115	280 241	
JPY	8 602	Plus Alpha Consulting Co., Ltd.	282 218	261 461	
JPY	14 117	Relo Holdings Inc.	313 314	252 673	
JPY	9 338	ROHTO Pharmaceutical Co., Ltd.	196 378	277 078	
JPY	2 489	Sanken Electric Co., Ltd.	283 547	306 034	
JPY	4 824	Sankyo Co., Ltd.	263 269	257 039	
JPY	16 513	Sanwa Shutter Corp.	241 117	282 027	
JPY	10 660	Sanyo Special Steel Co., Ltd.	267 550	276 876	
JPY	1 920	SCREEN Holdings Co., Ltd.	292 224	285 467	
JPY	10 058	Sega Sammy Holdings Inc.	277 530	282 880	
JPY	10 292	Sumitomo Corp.	235 192	286 540	
JPY	8 803	Sumitomo Forestry Co., Ltd.	196 896	280 707	
JPY	7 036	Takeuchi Mfg. Co., Ltd.	281 022	285 364	
JPY	12 032	UNITED ARROWS Ltd.	272 117	273 737	
JPY	11 260	WingArc1st Inc.	276 586	243 803	
JPY	7 693	Yamaha Motor Co., Ltd.	260 911	290 317	
JPY	4 932	Yamato Kogyo Co., Ltd.	212 309	276 791	
JPY	4 828	ZENSHO Holdings Co., Ltd.	286 183	282 933	
			<b>12 901 914</b>	<b>14 762 787</b>	<b>26,3</b>

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 Morningstar International Momentum 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
<b>R.-U.</b>					
GBP	8 288	3i Group PLC	183 531	271 680	
GBP	3 302	4imprint Group PLC	190 742	266 362	
GBP	7 570	Alpha Group International PLC	284 083	270 621	
GBP	30 738	B&M European Value Retail SA	287 817	288 030	
GBP	17 651	BAE Systems PLC	220 541	275 268	
GBP	44 954	Balfour Beatty PLC	234 738	257 736	
EUR	15 160	CNH Industrial NV	321 375	289 005	
GBP	14 296	Dunelm Group PLC	267 902	269 605	
GBP	164 015	Evraz PLC	1 464 762	-	
GBP	11 936	GSK PLC	340 416	278 872	
GBP	86 568	Marks & Spencer Group PLC	280 125	280 638	
GBP	29 758	Groupe bancaire Paragon PLC	255 711	265 831	
GBP	109 399	Rolls-Royce Holdings PLC	259 534	277 998	
GBP	11 938	Softcat PLC	297 708	284 382	
GBP	8 891	SSE PLC	251 541	275 367	
NOK	8 442	Stolt-Neilsen Ltd.	230 509	284 653	
DKK	8 684	TORM PLC	339 415	276 466	
			<b>5 710 450</b>	<b>4 412 514</b>	<b>7,9</b>
<b>SUÈDE</b>					
SEK	9 557	AddTech AB, actions B	278 152	274 907	
SEK	14 051	Atlas Copco AB, actions A	273 020	267 500	
SEK	9 599	Avanza Bank Holding AB	291 334	258 123	
SEK	20 813	Betsson AB, catégorie B	235 679	292 714	
SEK	6 129	Bufab AB	274 238	276 915	
SEK	1 585	Evolution AB	281 497	265 205	
SEK	8 453	Indutrade AB	272 678	251 538	
SEK	16 830	Groupe Munters AB	258 693	252 160	
SEK	26 535	NCAB Group AB	279 459	273 226	
SEK	22 692	Groupe New Wave AB, catégorie B	305 814	263 651	
SEK	14 029	Nordnet AB	289 708	248 004	
SEK	8 453	Paradox Interactive AB	222 306	281 881	
SEK	11 917	Sectra AB, catégorie B	280 099	264 102	
SEK	28 865	SSAB AB, série A	237 685	270 944	
SEK	12 433	Swedbank AB, série A	284 887	276 984	
			<b>4 065 249</b>	<b>4 017 854</b>	<b>7,2</b>
<b>FRANCE</b>					
EUR	1 512	Airbus SE	251 431	288 918	
EUR	17 966	ALD SA	253 923	254 311	
EUR	11 786	Beneteau SA	265 774	263 393	
EUR	14 693	Coface SA	273 864	267 693	
EUR	101	Hermes International	192 777	290 162	
EUR	3 125	Inter Parfums	273 243	294 560	
EUR	4 072	Ipsos	267 645	299 515	
EUR	2 140	Legrand SA	283 307	280 522	
EUR	235	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	215 077	292 783	
EUR	9 520	Rexel SA	302 618	310 744	
EUR	4 138	Rothschild & Co.	193 304	278 085	
EUR	1 097	Groupe Sopra Steria	302 021	289 501	
EUR	9 993	Technip Energies NV	224 493	304 544	
EUR	5 754	Verallia	312 251	285 590	
			<b>3 611 728</b>	<b>4 000 321</b>	<b>7,1</b>
<b>SUISSE</b>					
CHF	5 449	ABB Ltd., enregistré	285 529	283 532	
CHF	862	Bossard Holding AG	291 341	253 462	
CHF	472	Bucher Industries AG, actions nominatives	281 733	275 758	

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 Morningstar International Momentum 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
<b>SUISSE (suite)</b>					
CHF	2 067	Burkhalter Holding AG	281 633	281 266	
CHF	138	Forbo Holding AG, actions nominatives	276 583	262 079	
CHF	3 228	Holcim Ltd.	268 894	287 421	
CHF	186	Inficon Holding AG, enregistré	294 953	297 115	
CHF	738	Kuehne + Nagel International AG, actions nominatives	284 786	288 934	
CHF	88	Lem Holding SA	293 509	291 554	
CHF	1 506	SFS Group AG	272 071	262 397	
EUR	4 437	STMicroelectronics NV	256 236	291 869	
CHF	1 037	Swissquote Group Holding S.A.	241 230	284 826	
GBP	5 913	Wizz Air Holdings PLC	295 836	272 065	
			<b>3 624 334</b>	<b>3 632 278</b>	<b>6,5</b>
<b>ITALIE</b>					
EUR	23 318	Banca Mediolanum SPA	265 420	278 800	
EUR	19 667	BFF Banking Group SPA	261 242	284 778	
EUR	76 557	BPER Banca SPA	256 662	307 474	
EUR	2 354	Brunello Cucinelli SpA	243 528	273 910	
EUR	28 489	Credito Emiliano S.p.A.	278 746	293 247	
EUR	692	Ferrari NV	247 341	299 206	
EUR	83 006	Intesa Sanpaolo SpA	269 699	287 599	
EUR	56 758	Maire Tecnimont SPA	298 624	290 066	
EUR	52 575	Piaggio & C SPA	226 337	288 423	
EUR	5 167	Sanlorenzo SPA	261 140	293 901	
EUR	10 343	UniCredit SpA	244 566	317 525	
EUR	12 023	Zignago Vetro SPA	297 722	271 119	
			<b>3 151 027</b>	<b>3 486 048</b>	<b>6,2</b>
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	930	Logiciel Atoss AG	284 996	278 591	
EUR	1 789	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	288 216	290 607	
EUR	10 061	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	256 933	290 146	
EUR	2 770	Elmos Semiconductor SE	319 358	300 721	
EUR	2 369	Hochtief AG	274 976	270 868	
EUR	1 787	Krones AG	270 584	286 619	
EUR	2 638	Mercedes-Benz Group AG	266 892	280 564	
EUR	1 206	Siemens AG, actions nominatives	284 711	265 581	
EUR	1 747	Sixt SE	298 666	276 673	
EUR	11 544	Suedzucker AG	206 235	272 151	
			<b>2 751 567</b>	<b>2 812 521</b>	<b>5,0</b>
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	22 744	Brambles Ltd.	248 870	288 681	
AUD	11 827	Brickworks Ltd.	253 116	277 730	
AUD	43 552	Data#3 Ltd.	250 195	276 203	
AUD	69 153	Deterra Royalties Ltd.	284 574	280 193	
AUD	15 230	Fortescue Metals Group Ltd.	299 437	297 542	
AUD	48 429	Qantas Airways Ltd.	234 757	264 475	
AUD	27 124	Super Cheap Auto Group Ltd.	291 261	273 079	
AUD	18 837	Technology One Ltd.	239 951	259 665	
AUD	98 726	Viva Energy Group Ltd.	227 527	261 750	
AUD	4 014	Wisetech Global Ltd.	202 671	282 178	
			<b>2 532 359</b>	<b>2 761 496</b>	<b>4,9</b>
<b>POLOGNE</b>					
PLN	9 818	Bank Handlowy w Warszawie SA	279 123	276 272	
PLN	8 088	Bank Polska Kasa Opieki SA	293 157	291 865	
PLN	2 482	Budimex SA	282 219	290 199	
PLN	1 869	Dino Polska SA	220 398	289 015	
PLN	1 495	Grupa Kety SA	295 459	299 932	

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 Morningstar International Momentum 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
<b>POLOGNE (suite)</b>					
PLN	6 526	Logiciel LiveChat SA	305 846	273 756	
PLN	65	LPP SA	301 808	296 587	
PLN	2 309	Santander Bank Polska SA	290 661	292 532	
PLN	20 690	X-Trade Brokers Dom Maklerski SA	215 582	279 781	
			<b>2 484 253</b>	<b>2 589 939</b>	<b>4,6</b>
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	14 701	Atea ASA	296 625	283 257	
NOK	32 007	Europris ASA	215 240	283 052	
NOK	35 477	Hoegh Autoliners ASA	308 413	266 634	
NOK	50 916	Kitron ASA	224 330	273 874	
NOK	5 070	Kongsberg Gruppen ASA	285 697	305 713	
NOK	109 352	MPC Container Ships AS	276 497	247 300	
NOK	183 289	Norwegian Air Shuttle ASA	276 617	233 175	
NOK	13 236	Protector Forsikring ASA	236 196	270 069	
			<b>2 119 615</b>	<b>2 163 074</b>	<b>3,9</b>
<b>SINGAPOUR</b>					
NOK	22 913	BW LPG Ltd.	266 678	303 379	
NOK	43 551	Hafnia Ltd.	267 666	282 132	
SGD	43 600	Keppel Corp., Ltd.	301 941	286 049	
SGD	208 936	Raffles Medical Group Ltd.	278 915	277 833	
SGD	51 952	SembCorp Industries Ltd.	166 113	292 080	
SGD	171 335	Sheng Siong Group Ltd.	263 224	274 740	
			<b>1 544 537</b>	<b>1 716 213</b>	<b>3,1</b>
<b>DANEMARK</b>					
DKK	4 092	Dampskibsselskabet NORDEN AS	218 833	270 069	
DKK	1 050	DSV AS	275 831	291 732	
DKK	1 304	Novo Nordisk AS, catégorie B	143 745	277 960	
DKK	3 204	NTG Nordic Transport Group AS	271 263	268 054	
DKK	13 223	Spar Nord Bank AS	280 201	273 554	
DKK	4 544	Sydbank AS	244 364	277 698	
			<b>1 434 237</b>	<b>1 659 067</b>	<b>2,9</b>
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	29 464	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	264 000	299 113	
EUR	8 093	Compania de Distribucion Integral Logista Holdings SA	278 083	288 351	
EUR	5 684	Industria de Diseño Textil SA	240 675	290 978	
EUR	2 192	Vidrala S.A.	301 596	273 731	
			<b>1 084 354</b>	<b>1 152 173</b>	<b>2,0</b>
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	13 787	ABN AMRO Bank NV	285 246	283 231	
EUR	4 210	AMG Advanced Metallurgical Group NV	217 604	288 636	
EUR	286	ASML Holding NV	272 170	273 745	
EUR	4 111	TKH Group NV	275 021	269 564	
			<b>1 050 041</b>	<b>1 115 176</b>	<b>2,0</b>
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	3 620	Andritz AG	309 778	266 791	
EUR	1 562	DO & CO., AG	227 959	282 327	
EUR	5 948	voestalpine AG	274 871	282 509	
EUR	6 936	Wienerberger AG	269 450	280 772	
			<b>1 082 058</b>	<b>1 112 399</b>	<b>2,0</b>
<b>ISRAËL</b>					
ILS	5 818	Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	259 928	255 796	
ILS	1 757	Nova Measuring Instruments Ltd.	258 133	262 633	
ILS	6 570	Perion Network Ltd.	244 938	271 288	
GBP	11 159	Plus500 Ltd.	279 060	275 024	
			<b>1 042 059</b>	<b>1 064 741</b>	<b>1,9</b>

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 Morningstar International Momentum 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
<b>FINLANDE</b>					
EUR	22 839	Caverion Corp.	279 998	281 251	
EUR	12 478	Kemira OYJ	266 919	262 825	
EUR	35 865	Outokumpu OYJ, série A	272 206	253 811	
EUR	6 624	Valmet Corp.	284 897	243 661	
			<b>1 104 020</b>	<b>1 041 548</b>	<b>1,9</b>
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	3 054	KBC Group NV	264 973	281 821	
EUR	2 162	Melexis NV	273 610	280 596	
EUR	1 817	Solvay SA	258 723	268 347	
			<b>797 306</b>	<b>830 764</b>	<b>1,5</b>
<b>PORTUGAL</b>					
EUR	7 958	Jeronimo Martins SGPS SA	236 450	289 975	<b>0,5</b>
<b>É.-U.</b>					
HKD	76 248	Samsonite International SA	270 106	284 535	<b>0,5</b>
<b>MACAO</b>					
HKD	175 604	MGM China Holdings Ltd.	285 846	271 016	<b>0,5</b>
<b>GÉORGIE</b>					
GBP	5 394	Bank of Georgia Group PLC	231 433	265 426	<b>0,5</b>
<b>CHINE</b>					
HKD	211 744	Wynn Macau Ltd.	275 076	254 926	<b>0,4</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>53 390 019</b>	<b>55 696 791</b>	<b>99,3</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(64 000)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>53 326 019</b>	<b>55 696 791</b>	<b>99,3</b>
Contrat(s) de change à terme				379 579	<b>0,7</b>
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>53 326 019</b>	<b>56 076 370</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				4 836	<b>0,0</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>56 081 206</b>	<b>100,0</b>

## 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+	24 juillet 2023	AUD	59 031	CAD	52 019	1,13	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	AUD	1 495 378	CAD	1 353 411	1,10	(35 850)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	2 911 980	AUD	3 204 131	0,91	88 855
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	779 123	CHF	524 774	1,48	1 532
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	936 358	CHF	633 812	1,48	(2 800)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	809 804	DKK	4 171 065	0,19	340
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	22 104	DKK	113 935	0,19	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	262 364	DKK	1 353 076	0,19	(224)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	9 902 816	EUR	6 846 587	1,45	11 581
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	3 360 018	GBP	1 991 449	1,69	10 310
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	468 347	HKD	2 767 202	0,17	1 045
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	8 379 135	JPY	884 850 958	0,01	255 051
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	202 759	JPY	22 075 000	0,01	82
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	1 946 125	NOK	15 448 987	0,13	37 132
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	34 539	NOK	279 638	0,12	(15)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	46 459	PLN	142 872	0,33	(8)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	528 716	PLN	1 636 255	0,32	(3 452)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	882 362	PLN	2 729 336	0,32	(5 314)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	1 135 538	SEK	9 104 800	0,12	19 424
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	1 128 793	SEK	9 176 260	0,12	3 918
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	53 368	SEK	437 088	0,12	(213)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	701 839	SGD	708 810	0,99	8 496

\*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 Morningstar International Momentum 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+	24 juillet 2023	CAD	14 728	SGD	15 063	0,98	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CHF	37 374	CAD	55 200	0,68	180
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	DKK	187 133	CAD	36 122	5,18	194
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	EUR	203 573	CAD	294 160	0,69	(59)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	EUR	468 701	CAD	677 245	0,69	(114)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	29 090	CAD	48 770	0,60	161
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	525 322	CAD	888 148	0,59	(4 532)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	HKD	68 991	CAD	11 597	5,95	54
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	HKD	65 816	CAD	11 073	5,94	42
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	JPY	20 251 158	CAD	185 934	108,92	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	JPY	22 450 488	CAD	211 429	106,18	(5 304)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	427 668	CAD	52 618	8,13	228
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	352 273	CAD	43 495	8,10	34
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	1 749 958	CAD	216 863	8,07	(625)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	PLN	89 527	CAD	28 920	3,10	197
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SEK	567 924	CAD	69 569	8,16	50
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SEK	385 841	CAD	47 376	8,14	(78)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SGD	22 255	CAD	21 875	1,02	(106)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SGD	74 075	CAD	73 068	1,01	(610)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>379 579</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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	439	(59)	-	380
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>439</b>	<b>(59)</b>	<b>-</b>	<b>380</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(59)	59	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(59)</b>	<b>59</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	188	(188)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>(188)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(359)	188	-	(171)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(359)</b>	<b>188</b>	<b>-</b>	<b>(171)</b>

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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	78	243
Paiements indirects <sup>†</sup>	28	104

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	878 902	848 902	862 975	5 992 975
Parts rachetables émises	100 000	800 000	-	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(770 000)	(100 000)	(5 230 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	878 902	878 902	762 975	862 975

<sup>†</sup> 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 Morningstar International Momentum 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 ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	655	4 592
Garanties (hors trésorerie)	692	5 096

## 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	22	58
Charges	(7)	(23)
Revenu tiré des prêts de titres	15	35
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>31,0</b>	<b>39,6</b>



# FNB Indice Morningstar International Momentum 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 (%)
Actions - Japon	30,7
Actions - Australie	11,6
Actions - R.-U.	9,6
Actions - Norvège	5,3
Actions - France	4,6
Actions - Allemagne	4,5
Actions - Israël	4,4
Actions - Suède	3,5
Actions - Singapour	3,1
Actions - Espagne	2,6
Actions - Italie	2,6
Actions - Finlande	2,6
Actions - Portugal	2,5
Actions - Danemark	2,2
Actions - Autriche	2,0
Actions - Suisse	2,0
Actions - Pays-Bas	1,4
Actions - É.-U.	1,0
Actions - Géorgie	1,0
Actions - Luxembourg	0,6
Actions - Pologne	0,6
Actions - Afrique du Sud	0,5
Actions - Belgique	0,5
Actions - Guernesey	0,5
Actions - Nouvelle Zélande	0,5
Actions - Île de Man	0,5
Autres actifs (passifs) nets	(0,2)
Contrat(s) de change à terme	(0,3)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	0,8
<b>Total</b>	<b>0,8</b>

\*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 était principalement investi 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	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Developed Markets ex-North America Target Momentum Total Return Index <sup>™</sup>	5 466 441

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Developed Markets ex-North America Target Momentum Total Return Index <sup>™</sup>	5 491 681

### 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	16 423	(8 920)	7 503	13,4
Yen japonais	14 833	(7 935)	6 898	12,3
Livre sterling	4 404	(2 417)	1 987	3,5
Couronne suédoise	4 019	(2 178)	1 841	3,3
Franc suisse	3 071	(1 661)	1 410	2,5
Couronne norvégienne	3 034	(1 631)	1 403	2,5
Dollar australien	2 770	(1 454)	1 316	2,3
Zloty polonais	2 591	(1 437)	1 154	2,1
Couronne danoise	1 937	(1 058)	879	1,6
Shekel israélien	791	-	791	1,4
Dollar de Singapour	1 132	(614)	518	0,9
Dollar de Hong Kong	811	(445)	366	0,7
Lari géorgien	16	-	16	0,0
Dollar américain	5	-	5	0,0
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>55 838</b>	<b>(29 750)</b>	<b>26 088</b>	<b>46,5</b>

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022<sup>~</sup>

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Yen japonais	17 247	(9 129)	8 118	14,5
Euro	13 849	(7 067)	6 782	12,1
Livre sterling	6 751	(3 379)	3 372	6,0
Dollar australien	6 493	(3 344)	3 149	5,6
Couronne norvégienne	3 816	(1 950)	1 866	3,3
Shekel israélien	2 173	(1 072)	1 101	2,0
Couronne suédoise	1 954	(994)	960	1,7
Couronne danoise	1 500	(764)	736	1,3
Dollar de Singapour	1 169	(608)	561	1,0
Franc suisse	581	(294)	287	0,5
Zloty polonais	309	(158)	151	0,3
Dollar de Hong Kong	293	(148)	145	0,3
Dollar néo-zélandais	269	(139)	130	0,2
Dollar américain	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>56 405</b>	<b>(29 046)</b>	<b>27 359</b>	<b>48,8</b>

<sup>~</sup> 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 2 609 000 \$ (2 736 000 \$ 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	55 697	-	-	55 697
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	380	-	380
<b>Total</b>	<b>55 697</b>	<b>380</b>	<b>-</b>	<b>56 077</b>

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

## 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	56 300	-	-	56 300
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(171)	-	(171)
<b>Total</b>	<b>56 300</b>	<b>(171)</b>	<b>-</b>	<b>56 129</b>

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

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

# FNB Indice Morningstar International Momentum 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 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)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Actions	93	-	(196)	221	-	(190)	72	-
<b>Total</b>	<b>93</b>	<b>-</b>	<b>(196)</b>	<b>221</b>	<b>-</b>	<b>(190)</b>	<b>72</b>	<b>-</b>

\*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 31 décembre 2022 s'est établie à (1 464 763 \$).

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, des placements ayant une juste valeur de 221 000 \$ ont été transférés du niveau 2 au niveau 3 puisque des données observables sur le marché sont devenues 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 Morningstar International Valeur 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	289 731	327 334
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	1 846	371
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	214	48
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	130	160
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	473	496
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	213	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	292 607	328 409
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	14	193
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	213	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	146	174
Comptes créditeurs et charges à payer	352	354
	725	721
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>291 882</b>	<b>327 688</b>

## 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 ordinaires couvertes	13 731	12 218	27,52	24,49	498 952
Parts ordinaires non couvertes	278 151	315 470	25,15	23,84	11 059 099	13 234 099

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

# FNB Indice Morningstar International Valeur 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	9 639	16 496
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	10 285	(18 889)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	8 353	(61 454)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>28 280</b>	<b>(63 847)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(334)	(293)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	124	170
Rabais sur frais	835	1 548
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	72	88
<b>Total des autres revenus</b>	<b>697</b>	<b>1 513</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>28 977</b>	<b>(62 334)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	922	1 637
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	315	291
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	7
Retenues d'impôts	1 321	2 418
Taxe de vente harmonisée	15	21
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>2 574</b>	<b>4 375</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>26 403</b>	<b>(66 709)</b>

## 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 ordinaires couvertes	1 814	(903)	3,64	(0,97)	498 952	927 958
Parts ordinaires non couvertes	24 589	(65 806)	2,12	(3,03)	11 616 834	21 691 171

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

# FNB Indice Morningstar International Valeur 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	12 218	30 505	315 470	589 386	327 688	619 891
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 814	(903)	24 589	(65 806)	26 403	(66 709)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(301)	(400)	(7 589)	(12 494)	(7 890)	(12 894)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(301)	(400)	(7 589)	(12 494)	(7 890)	(12 894)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	3 130	24 896	602	24 896	3 732
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(19 518)	(79 215)	(116 344)	(79 215)	(135 862)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	(16 388)	(54 319)	(115 742)	(54 319)	(132 130)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 513	(17 691)	(37 319)	(194 042)	(35 806)	(211 733)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	13 731	12 814	278 151	395 344	291 882	408 158

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

# FNB Indice Morningstar International Valeur 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	26 403	(66 709)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(10 285)	18 889
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	10	8
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	315	291
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(8 353)	61 454
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	175 900	287 567
Achat de placements et de dérivés	(120 320)	(156 889)
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	23	(439)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(28)	(96)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	29	27
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>63 694</b>	<b>144 103</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(7 889)	(12 894)
Produit de l'émission de parts rachetables	24 895	3 732
Montant versé au rachat de parts rachetables	(79 215)	(134 778)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(62 209)</b>	<b>(143 940)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(10)	(8)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 485	163
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	371	1 341
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 846</b>	<b>1 496</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	8 341	13 639
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(7)
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 Morningstar International Valeur 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
<b>JAPON</b>					
JPY	151 100	AISAN INDUSTRY CO., LTD.	1 596 713	1 618 524	
JPY	36 099	AISIN Corp.	1 618 811	1 463 099	
JPY	62 444	ARCS CO., LTD.	1 655 642	1 405 211	
JPY	217 015	Belluna Co., Ltd.	1 466 809	1 412 629	
JPY	124 111	Daicel Corp.	1 074 752	1 461 235	
JPY	55 645	Daiwabo Holdings Co., Ltd.	941 201	1 413 957	
JPY	119 031	DCM Japan Holdings Co., Ltd.	1 497 691	1 329 501	
JPY	107 341	EDION Corp.	1 359 769	1 429 873	
JPY	72 443	Electric Power Development Co., Ltd.	1 447 299	1 405 388	
JPY	68 973	Exedy Corp.	1 471 518	1 526 878	
JPY	47 311	Ferrotec Corp.	1 503 977	1 574 474	
JPY	130 664	Fujikura Ltd.	1 212 321	1 438 500	
JPY	45 933	Fukuyama Transporting Co., Ltd.	1 571 799	1 682 107	
JPY	62 043	Furukawa Electric Co., Ltd.	1 508 414	1 441 060	
JPY	14 412	Fuyo General Lease Co., Ltd.	1 127 318	1 456 673	
JPY	109 700	G-TEKT Corp.	1 519 028	1 729 453	
JPY	55 194	H.U. Group Holdings Inc.	1 468 424	1 390 370	
JPY	34 743	HANWA Co., Ltd.	1 398 918	1 439 311	
JPY	35 987	Honda Motor Co., Ltd.	1 495 348	1 430 225	
JPY	86 008	Hosiden Corp.	1 455 604	1 416 573	
JPY	52 587	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	1 707 656	1 389 452	
JPY	29 144	ITOCHU Corp.	1 008 875	1 517 404	
JPY	19 553	Iwatani International Corp.	1 179 513	1 361 208	
JPY	34 622	Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	1 409 001	1 362 980	
JPY	79 968	JFE Holdings Inc.	1 297 371	1 500 856	
JPY	126 363	JTEKT Corp.	1 547 269	1 509 730	
JPY	303 118	JVCKENWOOD Corp.	1 436 028	1 370 906	
JPY	70 466	Kanamoto Co., Ltd.	1 843 684	1 414 129	
JPY	140 075	Kandenko Co., Ltd.	1 410 051	1 483 757	
JPY	38 504	Kaneka Corp.	1 604 709	1 417 453	
JPY	80 592	Kanematsu Corp.	1 289 774	1 480 840	
JPY	42 783	Kawasaki Heavy Industries Ltd.	1 217 576	1 439 061	
JPY	46 634	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	1 141 385	1 502 418	
JPY	122 738	Kobe Steel Ltd.	955 390	1 483 837	
JPY	42 906	Kohnan Shoji Co., Ltd.	1 426 537	1 374 849	
JPY	51 106	KOMERI CO., LTD.	1 567 890	1 372 780	
JPY	113 354	Kuraray Co., Ltd.	1 131 436	1 451 337	
JPY	33 462	KYB Corp.	1 053 180	1 544 014	
JPY	28 306	Makino Milling Machine Co., Ltd.	1 387 148	1 446 044	
JPY	71 001	Marubeni Corp.	1 050 760	1 586 073	
JPY	60 969	Maruha Nichiro Corp.	1 390 166	1 351 365	
JPY	117 490	Mazda Motor Corp.	1 263 359	1 498 914	
JPY	66 081	Medipal Holdings Corp.	1 507 599	1 422 323	
JPY	24 730	Mitsubishi Corp.	1 104 650	1 569 012	
JPY	313 592	Mitsubishi Motors Corp.	1 546 684	1 438 660	
JPY	42 540	Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	1 418 915	1 442 961	
JPY	31 176	Mitsui & Co., Ltd.	805 801	1 544 425	
JPY	46 547	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	931 818	1 472 768	
JPY	43 278	MITSUBI-SOKO Co., Ltd.	1 575 777	1 384 788	
JPY	38 248	Nachi-Fujikoshi Corp.	1 482 657	1 428 689	
JPY	154 086	NHK Spring Co., Ltd.	1 456 011	1 479 110	
JPY	52 320	Nippon Steel Corp.	1 161 001	1 438 920	
JPY	235 219	Nippon Suisan Kaisha Ltd.	1 268 522	1 391 365	
JPY	115 764	Nippon Television Holdings Inc.	1 356 918	1 450 928	
JPY	49 403	Nippon Yusen Kabushiki Kaisha	1 004 733	1 442 822	
JPY	132 280	Nishi-Nippon Financial Holding Inc.	1 185 230	1 544 092	

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 Morningstar International Valeur 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
<b>JAPON (suite)</b>					
JPY	62 444	Nishi-Nippon Railroad Co.	1 554 585	1 397 493	
JPY	46 359	NISHIO RENT ALL CO., LTD.	1 375 910	1 438 807	
JPY	283 117	Nissan Motor Co., Ltd.	1 434 737	1 524 614	
JPY	139 423	Nisshinbo Holdings Inc.	1 362 195	1 518 974	
JPY	29 888	Noritake Co., Ltd.	1 412 782	1 494 027	
JPY	275 106	Oji Holdings Corp.	1 498 739	1 354 030	
JPY	79 186	Pressance Corp.	1 179 860	1 464 430	
JPY	175 731	Rengo Co., Ltd.	1 684 204	1 425 286	
JPY	158 623	SENKO Co., Ltd.	1 683 416	1 503 057	
JPY	268 834	SKY Perfect JSAT Holdings Inc.	1 525 428	1 405 365	
JPY	51 786	Sojitz Corp.	1 045 752	1 506 255	
JPY	54 372	STARTS CORP., INC.	1 661 569	1 464 989	
JPY	53 883	Sumitomo Corp.	1 265 071	1 500 158	
JPY	46 088	Sumitomo Forestry Co., Ltd.	1 141 103	1 469 637	
JPY	65 389	Sumitomo Warehouse Co., Ltd. (The)	1 551 375	1 417 605	
JPY	298 883	SURUGA bank Ltd.	1 116 174	1 578 868	
JPY	60 526	TOHO GAS Co., Ltd.	1 592 185	1 381 166	
JPY	56 283	Toho Holdings Co., Ltd.	1 011 297	1 363 955	
JPY	47 902	Tokyo Gas Co., Ltd.	1 244 942	1 378 373	
JPY	107 649	Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	1 496 375	1 338 378	
JPY	48 744	Toppan Inc.	1 039 041	1 383 413	
JPY	97 045	TV Asahi Corp.	1 381 312	1 457 977	
JPY	78 604	Valor Holdings Co., Ltd.	1 959 611	1 435 676	
JPY	49 160	Yokohama Rubber Co., Ltd. (The)	1 194 808	1 417 723	
			<b>108 928 901</b>	<b>116 395 567</b>	<b>40,0</b>
<b>FRANCE</b>					
EUR	17 632	BNP Paribas SA	1 208 719	1 469 246	
EUR	33 052	Bouygues SA	1 655 754	1 467 745	
EUR	60 381	Carrefour SA	1 335 350	1 512 835	
EUR	76 927	Coface SA	1 047 730	1 401 538	
EUR	92 241	Crédit Agricole SA	1 181 764	1 447 772	
EUR	198 378	Derichebourg SA	1 464 292	1 457 733	
EUR	10 986	Eramet	1 463 125	1 326 698	
EUR	162 338	Eutelsat Communications SA	1 994 950	1 400 312	
EUR	52 536	Nexity SA	1 418 070	1 403 122	
EUR	93 657	Orange SA	1 429 030	1 447 011	
EUR	13 759	Publicis Groupe	861 753	1 459 960	
EUR	30 780	Renault SA	1 602 803	1 714 341	
EUR	49 841	Rexel SA	1 356 603	1 626 873	
EUR	21 663	Rothschild & Co.	1 243 500	1 455 811	
EUR	44 264	Société Générale S.A.	1 723 715	1 520 878	
EUR	153 499	Télévision Française 1 SA	1 521 339	1 394 980	
EUR	38 126	Vicat SA	1 749 054	1 601 699	
			<b>24 257 551</b>	<b>25 108 554</b>	<b>8,6</b>
<b>ITALIE</b>					
EUR	619 316	A2A SpA	1 166 483	1 495 805	
EUR	55 278	Assicurazioni Generali SpA	1 231 610	1 485 931	
EUR	271 224	Banca Popolare di Sondrio Scrl	1 478 505	1 494 181	
EUR	261 719	Banco BPM SPA	1 032 699	1 605 798	
EUR	400 807	BPER Banca SPA	1 055 053	1 609 752	
EUR	139 195	Cementir Holding NV	1 437 280	1 491 057	
EUR	149 153	Credito Emiliano S.p.A.	1 187 925	1 535 282	
EUR	43 232	Danieli & C. Officine Meccaniche SPA	1 327 830	1 369 956	
EUR	76 515	Eni SPA	1 280 211	1 456 111	
EUR	137 211	Iveco Group NV	1 044 281	1 634 612	
EUR	100 081	Poste Italiane SPA	1 374 699	1 432 699	

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 Morningstar International Valeur 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
<b>ITALIE (suite)</b>					
EUR	854 302	Saras Raffinerie	1 386 504	1 400 442	
EUR	54 151	UniCredit SpA	1 505 498	1 662 411	
EUR	208 070	Unipol Gruppo SPA	1 346 409	1 469 176	
EUR	439 725	UnipolSai SPA	1 515 937	1 441 032	
			<b>19 370 924</b>	<b>22 584 245</b>	<b>7,7</b>
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	94 954	T&I AG	2 403 483	1 381 785	
EUR	12 611	Aurubis AG	1 230 353	1 429 905	
EUR	9 364	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	1 065 687	1 521 100	
EUR	101 874	Commerzbank AG	949 883	1 492 781	
EUR	52 674	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	1 285 301	1 519 048	
EUR	38 671	Fresenius SE & Co., KGaA	1 916 527	1 416 356	
EUR	14 120	HeidelbergCement AG	1 486 981	1 532 918	
EUR	14 589	Hornbach Holding AG & Co., KGaA	1 569 765	1 521 703	
EUR	113 407	KloECKner & Co., SE	1 518 704	1 460 398	
EUR	13 810	Mercedes-Benz Group AG	1 390 735	1 468 761	
EUR	29 751	Salzgitter AG	1 259 575	1 423 380	
EUR	170 787	Schaeffler AG	1 506 192	1 391 828	
EUR	19 100	Talanx AG	1 030 965	1 449 015	
EUR	8 049	Volkswagen AG, privilégiées	2 161 602	1 428 571	
			<b>20 775 753</b>	<b>20 437 549</b>	<b>7,0</b>
<b>R.-U.</b>					
GBP	678 219	Airtel Africa Ltd.	1 027 089	1 229 973	
GBP	543 466	Barclays PLC	1 449 721	1 402 323	
GBP	575 431	BT Group PLC	1 271 274	1 184 416	
GBP	49 753	Imperial Brands PLC	1 363 025	1 455 127	
GBP	1 889 654	Lloyds Banking Group PLC	1 290 091	1 385 722	
GBP	453 218	Marks & Spencer Group PLC	1 089 216	1 469 252	
GBP	650 515	Premier Foods PLC	1 137 151	1 394 228	
GBP	127 594	Standard Chartered PLC	1 330 677	1 466 081	
NOK	44 195	Stolt-Neilsen Ltd.	1 188 506	1 490 200	
GBP	552 687	Virgin Money UK PLC	1 301 287	1 390 505	
			<b>12 448 037</b>	<b>13 867 827</b>	<b>4,8</b>
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	100 282	Acerinox SA	1 482 500	1 407 779	
EUR	154 256	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1 119 453	1 565 985	
EUR	1 003 424	Banco de Sabadell S.A.	952 205	1 526 834	
EUR	311 683	Banco Santander SA	1 270 737	1 523 135	
EUR	231 777	Gestamp Automocion SA	1 207 047	1 442 163	
EUR	34 451	Grupo Catalana Occidente SA	1 566 163	1 400 061	
EUR	528 413	Mapfre SA	1 387 085	1 387 627	
EUR	74 300	Repsol SA	1 154 632	1 429 834	
			<b>10 139 822</b>	<b>11 683 418</b>	<b>4,0</b>
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	31 631	Erste Group Bank AG	1 362 234	1 465 377	
EUR	25 590	OMV AG	1 369 619	1 434 882	
EUR	72 105	Raiffeisen Bank International AG	1 263 688	1 511 466	
EUR	25 531	Strabag SE	1 405 385	1 372 969	
EUR	145 467	Telekom Austria AG	1 362 466	1 423 839	
EUR	42 140	Vienna Insurance Group	1 412 457	1 457 024	
EUR	31 139	voestalpine AG	880 392	1 478 997	
EUR	36 314	Wienerberger AG	1 221 813	1 470 005	
			<b>10 278 054</b>	<b>11 614 559</b>	<b>4,0</b>
<b>HONG KONG</b>					
HKD	174 515	CK Hutchison Holdings Ltd.	1 695 171	1 410 032	
HKD	2 737 106	First Pacific Co., Ltd.	1 192 073	1 252 492	

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 Morningstar International Valeur 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
<b>HONG KONG (suite)</b>					
USD	5 920 572	Hutchison Port Holdings Trust	1 441 813	1 512 040	
USD	21 488	Jardine Matheson Holdings Ltd.	1 422 394	1 426 818	
HKD	3 219 508	K Wah International Holdings Ltd.	1 891 204	1 364 512	
HKD	933 657	Kerry Logistics Network Ltd.	1 640 010	1 458 288	
HKD	2 064 598	VST Holdings Ltd.	1 943 556	1 404 930	
HKD	1 991 212	WH Group Ltd.	1 935 033	1 395 339	
			<b>13 161 254</b>	<b>11 224 451</b>	<b>3,8</b>
<b>POLOGNE</b>					
PLN	106 369	Jastrzebska Spolka Weglowa SA	1 615 346	1 387 452	
PLN	39 388	KGHM Polska Miedz SA	1 323 742	1 441 885	
PLN	605 564	Orange Polska SA	1 339 310	1 377 809	
PLN	68 896	Polski Koncern Naftowy Orlen SA	1 379 156	1 445 266	
PLN	109 460	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	1 454 874	1 404 955	
PLN	1 863 778	Tauron Polska Energia SA	1 115 069	1 669 273	
			<b>8 227 497</b>	<b>8 726 640</b>	<b>3,0</b>
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	72 183	ABN AMRO Bank NV	1 105 183	1 482 882	
EUR	12 436	EXOR NV	1 453 480	1 466 436	
EUR	34 007	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 244 131	1 534 702	
EUR	66 881	Stellantis NV	1 599 304	1 553 550	
			<b>5 402 098</b>	<b>6 037 570</b>	<b>2,1</b>
<b>SUÈDE</b>					
SEK	239 780	AcadeMedia AB	2 139 146	1 479 035	
SEK	111 150	Mekonomen AB	1 646 750	1 516 912	
SEK	151 122	SSAB AB, série A	1 108 974	1 418 521	
SEK	259 259	Volvo Car AB, catégorie B	1 447 875	1 360 023	
			<b>6 342 745</b>	<b>5 774 491</b>	<b>2,0</b>
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	80 737	Bluescope Steel Ltd.	1 539 883	1 461 411	
AUD	203 221	GrainCorp Ltd., catégorie A	1 328 508	1 401 581	
AUD	627 920	Stanmore Coal Ltd.	1 811 186	1 426 960	
AUD	142 003	Super Cheap Auto Group Ltd.	1 506 394	1 429 656	
			<b>6 185 971</b>	<b>5 719 608</b>	<b>2,0</b>
<b>SINGAPOUR</b>					
NOK	119 961	BW LPG Ltd.	945 988	1 588 340	
SGD	5 450 480	Golden Agri-Resources Ltd.	1 031 415	1 305 668	
SGD	43 807	Jardine Cycle & Carriage Ltd.	996 026	1 490 577	
SGD	1 719 500	Yanlord Land Group Ltd.	1 685 680	1 286 161	
			<b>4 659 109</b>	<b>5 670 746</b>	<b>1,9</b>
<b>DANEMARK</b>					
DKK	618	A.P. Moller-Maersk AS, catégorie B	1 457 807	1 434 871	
DKK	21 425	Dampskibsselskabet NORDEN AS	1 117 606	1 414 032	
DKK	28 676	DFDS AS	1 327 919	1 381 080	
			<b>3 903 332</b>	<b>4 229 983</b>	<b>1,4</b>
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	23 954	Bekaert SA	1 073 120	1 435 136	
EUR	133 870	Proximus SA	1 632 285	1 318 830	
EUR	9 513	Solvay SA	1 057 206	1 404 946	
			<b>3 762 611</b>	<b>4 158 912</b>	<b>1,4</b>
<b>PORTUGAL</b>					
EUR	287 590	NOS SGPS SA	1 438 098	1 351 839	
EUR	1 091 401	Sonae SGPS S.A.	1 461 457	1 419 632	
			<b>2 899 555</b>	<b>2 771 471</b>	<b>0,9</b>

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 Morningstar International Valeur 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
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	443 110	Elkem ASA	1 751 953	1 359 476	
NOK	185 737	Hoegh Autoliners ASA	1 583 813	1 395 943	
			<b>3 335 766</b>	<b>2 755 419</b>	<b>0,9</b>
<b>LUXEMBOURG</b>					
EUR	31 178	Aperam S.A.	1 292 371	1 286 403	
EUR	39 961	ArcelorMittal SA	1 465 905	1 438 220	
			<b>2 758 276</b>	<b>2 724 623</b>	<b>0,9</b>
<b>ISRAËL</b>					
ILS	9 019	Delek Group Ltd.	1 408 868	1 354 255	
ILS	99 929	Phoenix Holdings Ltd. (The)	1 449 935	1 327 317	
			<b>2 858 803</b>	<b>2 681 572</b>	<b>0,9</b>
<b>É.-U.</b>					
AUD	107 237	Sims Ltd.	1 463 424	1 487 692	0,5
<b>SUISSE</b>					
CHF	3 671	Bell Food Group AG, actions nominatives	1 321 546	1 381 850	0,5
<b>IRLANDE</b>					
EUR	108 266	Bank of Ireland Group PLC	1 032 993	1 365 749	0,5
<b>FINLANDE</b>					
EUR	187 770	Outokumpu OYJ, série A	1 310 855	1 328 820	0,5
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>274 824 877</b>	<b>289 731 316</b>	<b>99,3</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(338 921)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>274 485 956</b>	<b>289 731 316</b>	<b>99,3</b>
Contrat(s) de change à terme				200 232	0,1
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>274 485 956</b>	<b>289 931 548</b>	<b>99,4</b>
Autres actifs (passifs) nets				1 950 828	0,6
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>291 882 376</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie <sup>*</sup>	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+	24 juillet 2023	AUD	12 896	CAD	11 338	1,14	24
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	AUD	7 970	CAD	7 119	1,12	(97)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	250 187	AUD	275 287	0,91	7 634
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	95 433	AUD	105 444	0,91	2 528
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	9 740	AUD	11 059	0,88	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	207 666	CHF	139 872	1,48	408
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	116 574	DKK	600 439	0,19	49
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	84 084	DKK	433 643	0,19	(72)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	4 707 775	EUR	3 254 851	1,45	5 506
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	425 224	EUR	294 285	1,44	71
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	102 855	EUR	71 213	1,44	(27)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	746 979	GBP	442 727	1,69	2 292
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	402 755	HKD	2 379 661	0,17	899
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	29 653	HKD	175 788	0,17	(32)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	5 892 467	JPY	622 254 556	0,01	179 360
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	312 565	NOK	2 481 243	0,13	5 964
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	6 523	NOK	52 524	0,12	33
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	498 711	PLN	1 543 399	0,32	(3 256)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	273 230	SEK	2 190 770	0,12	4 674
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	5 398	SEK	44 208	0,12	(22)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	211 628	SGD	213 730	0,99	2 562
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	132 894	USD	100 417	1,32	58
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	6 101	USD	4 602	1,33	14

<sup>\*</sup>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 Morningstar International Valeur 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+	24 juillet 2023	CHF	95 439	CAD	140 996	0,68	422
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	DKK	25 714	CAD	4 993	5,15	(3)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	EUR	73 335	CAD	105 377	0,70	570
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	8 311	CAD	13 934	0,60	46
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	7 327	CAD	12 296	0,60	28
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	8 885	CAD	15 012	0,59	(67)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	GBP	76 586	CAD	129 482	0,59	(661)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	HKD	74 962	CAD	12 625	5,94	34
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	HKD	145 091	CAD	24 508	5,92	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	JPY	51 046 397	CAD	477 601	106,88	(8 929)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	60 171	CAD	7 403	8,13	32
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	55 422	CAD	6 817	8,13	31
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	47 173	CAD	5 824	8,10	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	84 237	CAD	10 439	8,07	(30)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	NOK	165 705	CAD	20 717	8,00	(241)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	PLN	270 898	CAD	87 578	3,09	527
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SEK	52 711	CAD	6 457	8,16	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SEK	42 780	CAD	5 276	8,11	(32)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SGD	6 894	CAD	6 707	1,03	37
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SGD	4 661	CAD	4 581	1,02	(21)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	SGD	9 741	CAD	9 609	1,01	(80)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>200 232</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB Indice Morningstar International Valeur 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	214	(14)	-	200
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	214	(14)	-	200
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(14)	14	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(14)	14	-	-

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	48	(48)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	48	(48)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(193)	48	-	(145)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(193)	48	-	(145)

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

# FNB Indice Morningstar International Valeur 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	269	190
Paiements indirects <sup>†</sup>	95	82

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	498 952	1 223 952	13 234 099	23 404 099
Parts rachetables émises	-	125 000	975 000	25 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(800 000)	(3 150 000)	(4 995 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	498 952	548 952	11 059 099	18 434 099

<sup>†</sup> 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 Morningstar International Valeur 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 ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	6 838	39 302
Garanties (hors trésorerie)	7 186	43 744

## 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	177	274
Charges	(53)	(104)
Revenu tiré des prêts de titres	124	170
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,1</b>	<b>38,1</b>

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



# FNB Indice Morningstar International Valeur 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 (%)
Actions - Japon	40,4
Actions - France	8,9
Actions - Italie	6,3
Actions - Allemagne	5,4
Actions - Espagne	4,6
Actions - Hong Kong	4,5
Actions - R.-U.	4,3
Actions - Autriche	3,9
Actions - Pays-Bas	2,4
Actions - Suède	2,4
Actions - Pologne	3,1
Actions - Danemark	2,1
Actions - Belgique	2,0
Actions - Singapour	2,0
Actions - Norvège	1,6
Actions - Suisse	1,5
Actions - Luxembourg	1,0
Actions - Portugal	1,0
Actions - Israël	0,9
Actions - Australie	0,5
Actions - Finlande	0,5
Actions - Irlande	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	0,1
Aucune	0,5
<b>Total</b>	<b>0,6</b>

\*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 était principalement investi 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	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Developed Markets ex-North America Target Value Total Return Index <sup>™</sup>	28 178 010

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar <sup>®</sup> Developed Markets ex-North America Target Value Total Return Index <sup>™</sup>	32 583 127

### 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)		
Yen japonais	116 848	(5 244)	111 604	38,2
Euro	109 817	(5 124)	104 693	35,9
Livre sterling	12 504	(575)	11 929	4,1
Zloty polonais	8 728	(414)	8 314	2,8
Dollar de Hong Kong	8 554	(394)	8 160	2,8
Dollar australien	7 208	(327)	6 881	2,4
Couronne norvégienne	5 835	(262)	5 573	1,9
Couronne suédoise	5 793	(262)	5 531	1,9
Couronne danoise	4 231	(196)	4 035	1,4
Dollar de Singapour	4 084	(188)	3 896	1,3
Dollar américain	2 997	(139)	2 858	1,0
Shekel israélien	2 687	-	2 687	0,9
Franc suisse	1 384	(66)	1 318	0,5
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>290 672</b>	<b>(13 191)</b>	<b>277 481</b>	<b>95,1</b>

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

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2022<sup>~</sup>

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Yen japonais	133 236	(5 040)	128 196	39,1
Euro	120 064	(4 513)	115 551	35,3
Livre sterling	12 535	(460)	12 075	3,7
Dollar de Hong Kong	11 558	(432)	11 126	3,4
Zloty polonais	10 090	(373)	9 717	3,0
Couronne norvégienne	8 395	(313)	8 082	2,5
Couronne suédoise	7 926	(294)	7 632	2,3
Couronne danoise	6 821	(254)	6 567	2,0
Franc suisse	4 786	(177)	4 609	1,4
Dollar de Singapour	4 780	(179)	4 601	1,4
Dollar américain	3 227	(122)	3 105	0,9
Shekel israélien	2 915	(107)	2 808	0,9
Dollar australien	1 594	(59)	1 535	0,5
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>327 929</b>	<b>(12 323)</b>	<b>315 606</b>	<b>96,4</b>

<sup>~</sup> 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 27 148 100 \$ (31 561 000 \$ 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	289 731	-	-	289 731
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	200	-	200
<b>Total</b>	<b>289 731</b>	<b>200</b>	<b>-</b>	<b>289 931</b>

## 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	327 334	-	-	327 334
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(145)	-	(145)
<b>Total</b>	<b>327 334</b>	<b>(145)</b>	<b>-</b>	<b>327 189</b>

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 Morningstar Banque Nationale Québec 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	66 017	67 174
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	779	87
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	174	183
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	66 970	67 444
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	27	30
Comptes créditeurs et charges à payer	9	9
	36	39
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	66 934	67 405

## 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 ordinaires	66 934	67 405	26,52	23,87	2 523 791	2 823 791

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

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	623	824
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	2 944	2 964
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4 144	(15 295)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>7 714</b>	<b>(11 507)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	29	40
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>29</b>	<b>40</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>7 743</b>	<b>(11 467)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	165	196
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	8
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	23	28
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>191</b>	<b>233</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 552</b>	<b>(11 700)</b>

## 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 ordinaires	7 552	(11 700)	2,92	(3,66)	2 587 051	3 199 758

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

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	67 405	83 781
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 552	(11 700)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(78)	(91)
Profits nets réalisés	(324)	(451)
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(402)	(542)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 621)	(2 417)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(7 621)	(2 417)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(471)	(14 659)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	66 934	69 122

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

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 552	(11 700)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 944)	(2 964)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	8
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4 144)	15 295
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 235	6 093
Achat de placements et de dérivés	(1 581)	(6 293)
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	9	1
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(3)	(6)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 126</b>	<b>434</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(402)	(542)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(32)	(8)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(434)</b>	<b>(550)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	692	(116)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	87	121
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>779</b>	<b>5</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	632	825
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 Morningstar Banque Nationale Québec 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
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
113 827	Air Canada	1 875 723	2 844 537	
27 725	Bombardier Inc., catégorie B	739 633	1 810 720	
99 533	CAE Inc.	1 991 540	2 951 153	
20 612	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	2 006 564	3 306 577	
4 376	GDI Integrated Facility Services Inc.	125 973	182 567	
9 757	Héroux-Devtek Inc.	116 832	149 672	
31 197	Pyrogenèse Canada Inc.	179 226	28 701	
16 474	Richelieu Hardware Ltd.	388 243	690 261	
16 307	Savaria Corp.	223 952	275 588	
56 562	Groupe SNC-Lavalin inc.	2 126 757	1 965 530	
21 540	TFI International Inc.	862 934	3 251 032	
12 134	Transat A.T. Inc.	87 737	59 821	
19 455	WSP Global Inc.	1 246 557	3 405 014	
49 750	Xebec Adsorption Inc.	217 113	498	
		<b>12 188 784</b>	<b>20 921 671</b>	<b>31,4</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
19 968	Corporation Fiera Capital	210 557	128 994	
32 895	iA Société financière inc.	1 634 213	2 968 774	
13 590	Banque Laurentienne du Canada	575 758	449 286	
33 746	Banque Nationale du Canada	1 768 962	3 330 730	
20 868	Nuvei Corp.	2 709 262	816 356	
94 229	Power Corporation du Canada	2 997 013	3 360 206	
		<b>9 895 765</b>	<b>11 054 346</b>	<b>16,5</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
48 689	Alimentation Couche-Tard Inc.	1 316 504	3 307 444	
964	Industries Lassonde Inc., catégorie A	158 493	100 796	
43 182	Metro inc.	1 871 347	3 230 877	
75 965	Saputo inc.	2 529 631	2 254 641	
		<b>5 875 975</b>	<b>8 893 758</b>	<b>13,3</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
11 224	BRP Inc. du Canada	530 840	1 256 976	
39 637	Dollarama Inc.	1 562 700	3 556 231	
9 388	Dorel Industries Inc., catégorie B	113 924	43 091	
58 005	Gildan Activewear Inc.	1 664 508	2 477 394	
6 244	MTY Food Group Inc.	253 350	378 324	
12 511	Uni-Select inc.	259 642	588 642	
		<b>4 384 964</b>	<b>8 300 658</b>	<b>12,4</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
51 417	BCE Inc.	2 758 238	3 105 587	
5 630	Cogeco Communications Inc.	400 695	397 985	
2 481	Cogeco inc.	156 880	138 613	
47 611	Québecor Inc., catégorie B	1 086 509	1 554 499	
10 882	Stingray Group Inc.	65 833	56 042	
		<b>4 468 155</b>	<b>5 252 726</b>	<b>7,8</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
24 851	CGI inc.	1 507 087	3 471 685	
17 040	Coveo Solutions Inc.	135 332	140 750	
44 446	Lightspeed Commerce Inc.	1 981 836	996 035	
3 806	TECSYS Inc.	86 134	106 035	
		<b>3 710 389</b>	<b>4 714 505</b>	<b>7,0</b>
<b>MATÉRIAUX</b>				
26 793	5N Plus Inc.	57 523	87 345	
34 081	Aya Gold & Silver Inc.	257 683	289 348	
24 206	Cascades Inc.	251 958	282 968	
37 859	NanoXplore Inc.	215 252	122 663	

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 Morningstar Banque Nationale Québec 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
<b>MATÉRIAUX (suite)</b>				
57 697	Redevances aurifères Osisko Ltée	811 913	1 174 711	
18 606	Stella-Jones Inc.	647 942	1 269 301	
22 747	Transcontinental Inc., catégorie A	371 261	333 471	
		<b>2 613 532</b>	<b>3 559 807</b>	<b>5,3</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
31 679	Boralex Inc., catégorie A	792 729	1 142 662	
48 421	Innergex énergie renouvelable inc.	742 498	597 515	
		<b>1 535 227</b>	<b>1 740 177</b>	<b>2,6</b>
<b>SOINS DE SANTÉ</b>				
112 226	Bausch Health Cos., Inc.	3 333 983	1 189 595	
19 256	Dialogue Health Technologies Inc.	93 005	59 694	
24 063	Knight Therapeutics Inc.	188 614	118 871	
30 125	Opsens Inc.	83 698	49 104	
		<b>3 699 300</b>	<b>1 417 264</b>	<b>2,1</b>
<b>IMMOBILIER</b>				
27 180	BTB REIT	82 256	87 519	
14 275	PRO REIT	85 335	74 944	
		<b>167 591</b>	<b>162 463</b>	<b>0,2</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>48 539 682</b>	<b>66 017 375</b>	<b>98,6</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(33 405)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>48 506 277</b>	<b>66 017 375</b>	<b>98,6</b>
Autres actifs (passifs) nets			916 417	1,4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>66 933 792</b>	<b>100,0</b>

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 Morningstar Banque Nationale Québec 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	6
Paiements indirects <sup>†</sup>	1	3

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 823 791	3 223 791
Parts rachetables émises	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(300 000)	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2 523 791	3 123 791

<sup>†</sup> 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 Morningstar Banque Nationale Québec 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 ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	8 434
Garanties (hors trésorerie)	-	8 911

## 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	44	68
Charges	(15)	(28)
Revenu tiré des prêts de titres	29	40
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>32,8</b>	<b>41,9</b>

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec 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 (%)
Actions - Produits industriels	30,1
Actions - Services financiers	15,4
Actions - Biens de consommation de base	15,0
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	12,0
Actions - Services de communication	8,6
Actions - Technologies de l'information	8,1
Actions - Matériaux	4,2
Actions - Services publics	3,5
Actions - Soins de santé	2,5
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Actions - Immobilier	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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	(\$)
Morningstar® National Bank Québec Total Return Index™	6 595 452

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar® National Bank Québec Total Return Index™	6 706 340

### 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)		
Dollar américain	691	-	691	1,0
<b>Total</b>	<b>691</b>	<b>-</b>	<b>691</b>	<b>1,0</b>

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

Au 30 juin 2022, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 69 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	66 017	-	-	66 017
<b>Total</b>	<b>66 017</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>66 017</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	67 174	-	-	67 174
<b>Total</b>	<b>67 174</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>67 174</b>

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 Morningstar États-Unis Momentum 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	21 852	25 307
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	18	40
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	15	1
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	10	125
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	107	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	22 002	25 473
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	46	24
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	58	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	10	13
Comptes créditeurs et charges à payer	9	8
	123	45
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>21 879</b>	<b>25 428</b>

## 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	au	au	au	au	au
	30 juin 2023	31 déc. 2022	30 juin 2023	31 déc. 2022	30 juin 2023	31 déc. 2022
Parts ordinaires couvertes	9 781	13 187	20,05	17,87	487 816	737 816
Parts ordinaires non couvertes	12 098	12 241	28,34	25,67	426 902	476 902

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	166	262
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	1 605	2 568
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	680	(11 508)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2 452</b>	<b>(8 678)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	3
Rabais sur frais	-	62
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1</b>	<b>63</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2 453</b>	<b>(8 615)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	72	134
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	17
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	23	36
Taxe de vente harmonisée	8	8
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>111</b>	<b>196</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 342</b>	<b>(8 811)</b>

## 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 ordinaires couvertes	1 132	(2 775)	1,63	(4,28)	695 827	648 589
Parts ordinaires non couvertes	1 210	(6 036)	2,79	(4,97)	434 084	1 215 024

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	13 187	16 863	12 241	38 743	25 428	55 606
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 132	(2 775)	1 210	(6 036)	2 342	(8 811)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(29)	(1)	(20)	(9)	(49)	(10)
Profits nets réalisés	-	(19)	-	(100)	-	(119)
Remboursement de capital	-	-	(5)	-	(5)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(29)	(20)	(25)	(109)	(54)	(129)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	941	921	-	1 154	941	2 075
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(5 450)	(4 974)	(1 328)	(6 656)	(6 778)	(11 630)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(4 509)	(4 053)	(1 328)	(5 502)	(5 837)	(9 555)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(3 406)	(6 848)	(143)	(11 647)	(3 549)	(18 495)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	9 781	10 015	12 098	27 096	21 879	37 111

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 342	(8 811)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 605)	(2 568)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	7	17
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(680)	11 508
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	9 948	21 353
Achat de placements et de dérivés	(10 002)	(21 325)
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	115	(5)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(3)	(6)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	(1)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>122</b>	<b>162</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(55)	(129)
Produit de l'émission de parts rachetables	(4)	28
Montant versé au rachat de parts rachetables	(86)	(64)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(145)</b>	<b>(165)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(23)	(3)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	40	52
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>18</b>	<b>49</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	258	221
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 Morningstar États-Unis Momentum 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
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	2 083	Axcelis Technologies Inc.	366 593	505 891	
USD	6 271	Bel Fuse Inc., catégorie B	419 494	476 934	
USD	16 020	Extreme Networks Inc.	448 720	552 846	
USD	913	Gartner Inc.	318 290	423 699	
USD	4 101	GoDaddy Inc., catégorie A	419 635	408 166	
USD	3 539	InterDigital Inc.	399 249	452 654	
USD	3 076	Splunk Inc.	429 385	432 309	
USD	1 833	Super Micro Computer Inc.	175 466	605 245	
			<b>2 976 832</b>	<b>3 857 744</b>	<b>17,6</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	6 142	Allison Transmission Holdings Inc.	371 137	459 393	
USD	1 776	Avis Budget Group Inc.	491 880	538 005	
USD	2 627	Builders FirstSource Inc.	177 087	473 296	
USD	1 855	Encore Wire Corp.	347 530	456 906	
USD	9 154	Griffon Corp.	386 759	488 709	
USD	3 796	Mueller Industries Inc.	322 093	438 909	
USD	1 748	United Parcel Service Inc., catégorie B	405 821	415 083	
USD	2 703	Veritiv Corp.	331 524	449 784	
			<b>2 833 831</b>	<b>3 720 085</b>	<b>17,0</b>
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	6 791	Amphastar Pharmaceuticals Inc.	409 951	517 022	
USD	3 778	Gilead Sciences Inc.	443 531	385 728	
USD	8 728	Halozyne Therapeutics Inc.	576 256	417 056	
USD	3 084	Lantheus Holdings Inc.	362 728	342 858	
USD	755	McKesson Corp.	300 126	427 390	
USD	1 443	Medpace Holdings Inc.	406 821	459 112	
USD	219	Mettler-Toledo International Inc.	334 294	380 533	
USD	1 082	Shockwave Medical Inc.	368 039	409 101	
			<b>3 201 746</b>	<b>3 338 800</b>	<b>15,3</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	11 573	Bloomin' Brands Inc.	409 868	412 260	
USD	2 618	Choice Hotels International Inc.	370 016	407 582	
USD	1 054	Dillard's Inc., catégorie A	420 929	455 580	
USD	1 080	Murphy USA Inc.	305 628	445 114	
USD	326	O'Reilly Automotive Inc.	377 477	412 564	
USD	4 519	PulteGroup Inc.	405 790	465 035	
USD	2 914	Ross Stores Inc.	456 398	432 858	
			<b>2 746 106</b>	<b>3 030 993</b>	<b>13,9</b>
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	6 616	Commercial Metals Co.	452 594	461 541	
USD	13 445	O-I Glass Inc.	378 290	379 914	
USD	6 641	Olympic Steel Inc.	475 446	431 086	
USD	4 453	Southern Copper Corp.	444 729	423 202	
USD	3 097	Steel Dynamics Inc.	430 903	446 913	
			<b>2 181 962</b>	<b>2 142 656</b>	<b>9,8</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	4 599	BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	343 577	383 890	
USD	449	Coca-Cola Consolidated Inc.	261 519	378 313	
USD	1 131	Hershey Co. (The)	258 749	374 124	
USD	2 702	Lamb Weston Holdings Inc.	319 274	411 461	
USD	24 821	Vector Group Ltd.	443 187	421 213	
			<b>1 626 306</b>	<b>1 969 001</b>	<b>9,0</b>

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 Morningstar États-Unis Momentum 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
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	15 015	Forestar Group Inc.	414 563	448 545	
USD	3 245	Ryman Hospitality Properties Inc.	361 547	399 446	
USD	1 288	SBA Communications Corp.	527 137	395 447	
			<b>1 303 247</b>	<b>1 243 438</b>	<b>5,7</b>
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	13 775	Par Pacific Holdings Inc.	429 777	485 591	
USD	4 183	Targa Resources Corp.	277 892	421 703	
			<b>707 669</b>	<b>907 294</b>	<b>4,1</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	1 203	Meta Platforms Inc., catégorie A	432 477	457 353	
USD	3 225	Omnicom Group Inc.	398 698	406 511	
			<b>831 175</b>	<b>863 864</b>	<b>3,9</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	13 199	Brightsphere Investment Group Inc.	445 417	366 318	
USD	6 521	Unum Group	338 589	412 066	
			<b>784 006</b>	<b>778 384</b>	<b>3,6</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>19 192 880</b>	<b>21 852 259</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(4 546)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>19 188 334</b>	<b>21 852 259</b>	<b>99,9</b>
Contrat(s) de change à terme				(31 611)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>19 188 334</b>	<b>21 820 648</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				58 012	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>21 878 660</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie <sup>a</sup>	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position contractuel	Taux	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	312 081	USD	235 997	1,32	(555)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	9 031 643	USD	6 841 252	1,32	(31 305)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	7 077 248	CAD	9 390 299	0,75	(14 714)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	1 août 2023	CAD	9 532 969	USD	7 187 935	1,33	14 963
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(31 611)</b>

<sup>a</sup>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 Morningstar États-Unis Momentum 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	15	(15)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	15	(15)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(46)	15	-	(31)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(46)	15	-	(31)

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	1	(1)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	1	(1)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(24)	1	-	(23)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(24)	1	-	(23)

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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	5	11
Paiements indirects <sup>†</sup>	2	5

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	737 816	787 816	476 902	1 376 902
Parts rachetables émises	50 000	50 000	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(300 000)	(250 000)	(50 000)	(250 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>487 816</b>	<b>587 816</b>	<b>426 902</b>	<b>1 176 902</b>

<sup>†</sup> 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 Morningstar États-Unis Momentum 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 ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	5 466
Garanties (hors trésorerie)	-	5 886

## 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	5
Charges	(1)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	2	3
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>38,1</b>

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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 (%)
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	16,3
Actions - Soins de santé	15,8
Actions - Produits industriels	15,7
Actions - Énergie	15,7
Actions - Technologies de l'information	13,7
Actions - Biens de consommation de base	10,6
Actions - Services financiers	4,2
Actions - Immobilier	4,0
Actions - Matériaux	3,7
Autres actifs (passifs) nets	0,6
Contrat(s) de change à terme	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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	(\$)
Morningstar® U.S. Target Momentum Total Return Index™	1 970 502

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar® U.S. Target Momentum Total Return Index™	2 447 870

### 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	21 865	(9 518)	12 347	56,4
<b>Total</b>	<b>21 865</b>	<b>(9 518)</b>	<b>12 347</b>	<b>56,4</b>

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	25 450	(12 939)	12 511	49,2
<b>Total</b>	<b>25 450</b>	<b>(12 939)</b>	<b>12 511</b>	<b>49,2</b>

~ 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 1 235 000 \$ (1 251 000 \$ 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	21 852	-	-	21 852
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(31)	-	(31)
<b>Total</b>	<b>21 852</b>	<b>(31)</b>	<b>-</b>	<b>21 821</b>

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum 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	25 307	-	-	25 307
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(23)	-	(23)
<b>Total</b>	<b>25 307</b>	<b>(23)</b>	<b>-</b>	<b>25 284</b>

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 Morningstar États-Unis Valeur 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	24 237	16 571
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	11	3
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	11	-
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	18	12
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	13	-
	24 290	16 586
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	23	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	-	3
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	7	9
Comptes créditeurs et charges à payer	16	12
	46	33
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>24 244</b>	<b>16 553</b>

## 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	au	au	au	au	au
	30 juin 2023	31 déc. 2022	30 juin 2023	31 déc. 2022	30 juin 2023	31 déc. 2022
Parts ordinaires couvertes	7 289	8 267	12,02	11,70	606 368	706 368
Parts ordinaires non couvertes	16 955	8 286	17,14	16,94	989 009	489 009

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	261	183
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	461	751
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(273)	(5 362)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>450</b>	<b>(4 428)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	2
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(1)</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>449</b>	<b>(4 426)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	47	73
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	19	19
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	26	24
Taxe de vente harmonisée	5	7
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>98</b>	<b>124</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>351</b>	<b>(4 550)</b>

## 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 ordinaires couvertes	206	(2 704)	0,30	(2,50)	687 307	1 082 887
Parts ordinaires non couvertes	145	(1 846)	0,31	(3,04)	469 948	607 794

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



# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	8 267	17 107	8 286	11 583	16 553	28 690
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	206	(2 704)	145	(1 846)	351	(4 550)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(38)	(42)	(34)	(24)	(72)	(66)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(10)	-	-	-	(10)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(48)	(42)	(34)	(24)	(82)	(66)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 993	9 395	-	9 395	1 993
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 136)	(7 493)	(837)	(876)	(1 973)	(8 369)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(1 136)	(5 500)	8 558	(876)	7 422	(6 376)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(978)	(8 246)	8 669	(2 746)	7 691	(10 992)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	7 289	8 861	16 955	8 837	24 244	17 698

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	351	(4 550)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(461)	(751)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	19	19
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	273	5 362
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	7 368	9 486
Achat de placements et de dérivés	(7 426)	(9 457)
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	(6)	2
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(2)	(5)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>119</b>	<b>106</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(82)	(66)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	15
Montant versé au rachat de parts rachetables	(29)	(31)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(111)</b>	<b>(82)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8	24
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3	9
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>11</b>	<b>33</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	228	160
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 Morningstar États-Unis Valeur 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
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	4 539	Boise Cascade Co.	433 982	543 278	
USD	23 877	JELD-WEN Holding Inc.	477 573	554 809	
USD	22 405	Manitowoc Co., Inc. (The)	483 564	558 894	
USD	11 513	MDU Resources Group Inc.	375 811	319 374	
USD	36 914	MRC Global Inc.	542 079	492 441	
USD	4 279	Ryder System Inc.	450 237	480 641	
USD	11 920	SkyWest Inc.	544 708	643 010	
USD	3 099	Veritiv Corp.	414 756	515 679	
			<b>3 722 710</b>	<b>4 108 126</b>	<b>16,9</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	66 303	Chico's FAS Inc.	506 151	469 917	
USD	12 765	Ethan Allen Interiors Inc.	485 211	478 227	
USD	10 215	General Motors Co.	476 152	521 806	
USD	1 509	Group 1 Automotive Inc.	372 890	515 954	
USD	1 232	Murphy USA Inc.	350 963	507 760	
USD	8 322	ODP Corp. (The)	443 734	516 171	
USD	2 387	Penske Automotive Group Inc.	350 472	526 914	
USD	8 062	Taylor Morrison Home Corp.	483 612	520 870	
			<b>3 469 185</b>	<b>4 057 619</b>	<b>16,7</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	24 109	Ambac Financial Group Inc.	452 015	454 803	
USD	74 239	BGC Partners Inc., catégorie A	404 154	435 682	
USD	11 234	Bread Financial Holdings Inc.	536 114	467 154	
USD	7 311	Enova International Inc.	375 030	514 480	
USD	62 086	Genworth Financial Inc., catégorie A	357 848	411 241	
USD	9 058	OneMain Holdings Inc.	513 771	524 262	
USD	41 693	Rithm Capital Corp.	521 459	516 427	
USD	4 032	StoneX Group Inc.	506 885	443 763	
			<b>3 667 276</b>	<b>3 767 812</b>	<b>15,5</b>
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	5 831	Berry Global Group Inc.	461 275	497 002	
USD	23 115	Cleveland-Cliffs Inc.	468 001	513 217	
USD	13 437	Graphic Packaging Holding Co.	355 012	427 750	
USD	5 406	Greif Inc., catégorie A	427 571	493 363	
USD	3 552	Steel Dynamics Inc.	470 701	512 571	
USD	15 794	United States Steel Corp.	585 058	523 287	
USD	9 762	Warrior Met Coal Inc.	461 158	503 710	
			<b>3 228 776</b>	<b>3 470 900</b>	<b>14,3</b>
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	14 940	Delek US Holdings Inc.	494 636	474 013	
USD	3 097	Marathon Petroleum Corp.	438 663	478 381	
USD	15 843	Par Pacific Holdings Inc.	574 170	558 491	
USD	16 803	Peabody Energy Corp.	441 112	482 147	
USD	3 568	Phillips 66	434 709	450 833	
USD	26 784	US Silica Holdings Inc.	418 414	430 398	
USD	3 032	Valero Energy Corp.	511 831	471 152	
			<b>3 313 535</b>	<b>3 345 415</b>	<b>13,9</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	8 048	Edgewell Personal Care Co.	406 783	440 430	
USD	4 112	Ingles Markets Inc., catégorie A	363 466	450 226	
USD	6 945	Kroger Co. (The)	385 288	432 418	
USD	9 461	Sprouts Farmers Markets Inc.	363 884	460 354	
			<b>1 519 421</b>	<b>1 783 428</b>	<b>7,4</b>

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 Morningstar États-Unis Valeur 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
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	4 898	CVS Health Corp.	481 445	448 559	
USD	25 213	Innoviva Inc.	436 618	425 194	
USD	36 950	Viatis Inc.	559 367	488 516	
			<b>1 477 430</b>	<b>1 362 269</b>	<b>5,6</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	7 988	Avnet Inc.	468 340	533 867	
USD	3 999	Jabil Inc.	376 889	571 778	
			<b>845 229</b>	<b>1 105 645</b>	<b>4,6</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	26 472	AMC Networks Inc.	559 652	419 072	
USD	20 662	Sinclair Inc.	412 873	378 281	
			<b>972 525</b>	<b>797 353</b>	<b>3,3</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	3 401	Entergy Corp.	444 571	438 698	1,8
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>22 660 658</b>	<b>24 237 265</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(20 915)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>22 639 743</b>	<b>24 237 265</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme				(12 343)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>22 639 743</b>	<b>24 224 922</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				18 978	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>24 243 900</b>	<b>100,0</b>

## 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+	5 juillet 2023	CAD	166 248	USD	125 735	1,32	(320)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	6 877 933	USD	5 201 051	1,32	(12 160)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	5 326 787	CAD	7 067 735	0,75	(11 075)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	1 août 2023	CAD	7 142 954	USD	5 385 845	1,33	11 212
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(12 343)</b>

\*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 Morningstar États-Unis Valeur 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	11	(11)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	11	(11)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(23)	11	-	(12)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(23)	11	-	(12)

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(9)	-	-	(9)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(9)	-	-	(9)

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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	16	11
Paiements indirects <sup>†</sup>	6	5

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	706 368	1 256 368	489 009	639 009
Parts rachetables émises	-	150 000	550 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(600 000)	(50 000)	(50 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>606 368</b>	<b>806 368</b>	<b>989 009</b>	<b>589 009</b>

<sup>†</sup> 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 Morningstar États-Unis Valeur 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 ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	2 797
Garanties (hors trésorerie)	-	2 966

## 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	4
Charges	(1)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	1	2
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>29,9</b>	<b>46,4</b>

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

# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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 (%)
Actions - Produits industriels	16,3
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	15,7
Actions - Biens de consommation de base	14,0
Actions - Énergie	13,5
Actions - Soins de santé	9,9
Actions - Services financiers	8,4
Actions - Matériaux	8,3
Actions - Services publics	6,3
Actions - Technologies de l'information	4,1
Actions - Services de communication	3,8
Contrat(s) de change à terme	(0,1)
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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	(\$)
Morningstar® U.S. Target Value Total Return Index™	2 355 477

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Morningstar® U.S. Target Value Total Return Index™	1 651 502

### 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	24 261	(7 132)	17 129	70,7
<b>Total</b>	<b>24 261</b>	<b>(7 132)</b>	<b>17 129</b>	<b>70,7</b>

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	16 585	(8 242)	8 343	50,4
<b>Total</b>	<b>16 585</b>	<b>(8 242)</b>	<b>8 343</b>	<b>50,4</b>

~ 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 1 713 000 \$ (834 000 \$ 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	24 237	-	-	24 237
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(12)	-	(12)
<b>Total</b>	<b>24 237</b>	<b>(12)</b>	<b>-</b>	<b>24 225</b>



# FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur 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	16 571	-	-	16 571
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(9)	-	(9)
<b>Total</b>	<b>16 571</b>	<b>(9)</b>	<b>-</b>	<b>16 562</b>

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.

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	32 550	31 579
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	108	83
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	53	54
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription d'actions	-	-
	32 711	31 716
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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 d'actions	-	-
Dividendes à payer aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	3	17
Frais d'administration à payer	4	4
Comptes créditeurs et charges à payer	-	20
	7	41
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	32 704	31 675

## États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre d'actions 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
	Actions FNB	32 704	31 675	30,55	28,27	1 070 545

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

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité 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 action et le nombre d'actions)

	2023	2022
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	490	369
Intérêts aux fins des distributions	2	-
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	139	165
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 319	(5 464)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2 950</b>	<b>(4 930)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	1
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	35	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>36</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2 986</b>	<b>(4 929)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	97	122
Frais d'administration (note 5)	24	31
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de titres	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	13	16
Jetons de présence des administrateurs	-	-
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>138</b>	<b>175</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	<b>2 848</b>	<b>(5 104)</b>

## 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 action et le nombre d'actions)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre moyen pondéré d'actions :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actions FNB	2 848	(5 104)	2,62	(3,63)	1 086 567	1 404 799

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

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	31 675	42 864
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	2 848	(5 104)
<b>Dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>		
Revenu net de placement	(328)	(169)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>	(328)	(169)
<b>Transactions sur actions rachetables</b>		
Produit de l'émission d'actions rachetables	-	4 421
Réinvestissement des dividendes aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Rachat d'actions rachetables	(1 491)	(9 697)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur actions rachetables</b>	(1 491)	(5 276)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	1 029	(10 549)
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	32 704	32 315

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

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	2 848	(5 104)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(139)	(165)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	5
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 319)	5 464
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5 223	12 042
Achat de placements et de dérivés	(5 223)	(13 540)
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	23
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(14)	(5)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(20)	3
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>360</b>	<b>(1 278)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Dividendes versés aux porteurs d'actions rachetables, déduction faite des dividendes réinvestis	(328)	(169)
Produit de l'émission d'actions rachetables	-	1 498
Montant versé au rachat d'actions rachetables	(7)	(40)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(335)</b>	<b>1 289</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	25	11
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	83	62
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>108</b>	<b>73</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	491	392
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2	-
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.

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité 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
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
25 677	Great-West Lifeco Inc.	830 962	987 794	
10 927	iA Société financière inc.	721 093	986 162	
7 012	Société financière IGM Inc.	271 202	282 794	
7 982	Intact Corporation financière	1 305 316	1 632 638	
62 170	Société Financière Manuvie	1 459 877	1 556 737	
24 191	Financière Sun Life inc.	1 460 832	1 670 630	
26 901	Groupe TMX Limitée	724 767	801 919	
		<b>6 774 049</b>	<b>7 918 674</b>	<b>24,2</b>
<b>ÉNERGIE</b>				
91 300	ARC Resources Ltd.	1 785 483	1 613 271	
72 909	Cenovus Energy Inc.	1 582 125	1 640 453	
22 366	Imperial Oil Ltd.	1 680 584	1 515 967	
26 782	Tourmaline Oil Corp.	2 000 901	1 671 732	
		<b>7 049 093</b>	<b>6 441 423</b>	<b>19,7</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
10 070	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1 469 134	1 615 430	
17 908	RB Global Inc.	1 270 036	1 423 686	
9 069	TFI International Inc.	1 198 082	1 368 784	
9 104	Industries Toromont Limitée	892 280	990 788	
		<b>4 829 532</b>	<b>5 398 688</b>	<b>16,5</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
11 476	CGI inc.	1 193 639	1 603 197	
595	Constellation Software Inc.	1 068 753	1 633 132	
7 646	Descartes Systems Group Inc. (The)	802 601	811 394	
		<b>3 064 993</b>	<b>4 047 723</b>	<b>12,4</b>
<b>MATÉRIAUX</b>				
14 291	CCL Industries Inc., catégorie B	898 015	930 630	
7 858	Franco-Nevada Corp.	1 364 203	1 483 669	
19 409	Nutrien Ltd.	1 926 830	1 517 978	
		<b>4 189 048</b>	<b>3 932 277</b>	<b>12,0</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
24 619	Alimentation Couche-Tard Inc.	1 205 239	1 672 369	
21 057	Metro inc.	1 481 146	1 575 485	
		<b>2 686 385</b>	<b>3 247 854</b>	<b>9,9</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
4 788	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	888 908	867 203	
16 288	Gildan Activewear Inc.	756 816	695 660	
		<b>1 645 724</b>	<b>1 562 863</b>	<b>4,8</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>30 238 824</b>	<b>32 549 502</b>	<b>99,5</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(7 684)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>30 231 140</b>	<b>32 549 502</b>	<b>99,5</b>
Autres actifs (passifs) nets			154 930	0,5
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>			<b>32 704 432</b>	<b>100,0</b>

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

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité 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	4
Paielements indirects <sup>†</sup>	1	2

## Transactions sur actions rachetables (note 4)

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Nombre d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 120 545	1 420 545
Actions rachetables émises	-	150 000
Actions rachetables émises aux fins du réinvestissement des dividendes	-	-
Actions rachetables rachetées	(50 000)	(350 000)
<b>Nombre d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 070 545	1 220 545

<sup>†</sup> 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.

# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Actions FNB	0,600	0,14

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	434
Garanties (hors trésorerie)	-	460

## 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
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>46,5</b>	<b>41,6</b>



# Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité 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 (%)
Actions - Services financiers	26,0
Actions - Matériaux	17,7
Actions - Matériaux	13,7
Actions - Produits industriels	13,4
Actions - Technologies de l'information	10,5
Actions - Biens de consommation de base	9,9
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	8,5
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 d'actions 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 d'actions rachetables pourrait être différente.

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables au 30 juin 2023

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement global MSCI Canada qualité	3 242 596

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement global MSCI Canada qualité	3 154 479

### Risque de change

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, les actifs du Fonds étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, le Fonds n'avait aucune exposition au risque de change.

### 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	32 550	-	-	32 550
<b>Total</b>	<b>32 550</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>32 550</b>

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	31 579	-	-	31 579
<b>Total</b>	<b>31 579</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>31 579</b>

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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	74 506	73 295
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	102	82
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	43	21
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	16	16
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	77	80
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	74 744	73 494
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	49	261
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	22
Comptes créditeurs et charges à payer	34	31
	104	314
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>74 640</b>	<b>73 180</b>

## 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 ordinaires couvertes	11 694	13 968	29,24	25,40	400 000	550 000
Parts ordinaires non couvertes	62 946	59 212	27,98	25,20	2 250 000	2 350 000

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

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	923	847
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	765	(549)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	7 226	(12 742)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>8 917</b>	<b>(12 444)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(26)	(11)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	4
Rabais sur frais	94	97
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>72</b>	<b>90</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>8 989</b>	<b>(12 354)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	127	136
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	33	26
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	1
Retenues d'impôts	108	49
Taxe de vente harmonisée	4	6
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>273</b>	<b>219</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>8 716</b>	<b>(12 573)</b>

## 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 ordinaires couvertes	1 734	(1 927)	3,80	(3,44)	456 354	559 945
Parts ordinaires non couvertes	6 982	(10 646)	3,07	(4,10)	2 273 757	2 593 923

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

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	13 968	14 065	59 212	73 217	73 180	87 282
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 734	(1 927)	6 982	(10 646)	8 716	(12 573)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(75)	(21)	(552)	(140)	(627)	(161)
Profits nets réalisés	(23)	(92)	(103)	(444)	(126)	(536)
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(98)	(113)	(655)	(584)	(753)	(697)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 561	-	-	-	2 561
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 910)	-	(2 593)	(6 030)	(6 503)	(6 030)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(3 910)	2 561	(2 593)	(6 030)	(6 503)	(3 469)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 274)	521	3 734	(17 260)	1 460	(16 739)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	11 694	14 586	62 946	55 957	74 640	70 543

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

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 716	(12 573)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(765)	549
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	33	26
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(7 226)	12 742
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	21 626	13 602
Achat de placements et de dérivés	(18 852)	(12 088)
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	(24)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(4)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	(2)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>3 538</b>	<b>2 227</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(753)	(697)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 177
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 764)	(2 729)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(3 517)</b>	<b>(2 249)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	21	(22)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	82	84
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>102</b>	<b>63</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	817	774
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(1)
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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>É.-U.</b>					
USD	6 013	Amgen Inc.	1 815 921	1 766 547	
USD	1 626	Biogen Inc.	590 427	612 885	
USD	5 258	Boston Properties Inc.	609 047	400 691	
USD	8 613	Church & Dwight Co., Inc.	1 082 489	1 142 337	
USD	4 360	Clorox Co. (The)	1 005 849	917 561	
USD	16 831	Conagra Brands Inc.	780 514	750 999	
USD	5 644	Darling Ingredients Inc.	486 321	476 411	
USD	4 363	DexCom Inc.	547 124	741 932	
USD	10 281	Digital Realty Trust Inc.	1 432 014	1 549 125	
USD	6 823	Edwards Lifesciences Corp.	938 456	851 662	
USD	6 139	Eli Lilly and Co.	1 768 366	3 809 727	
USD	3 300	Equinix Inc.	3 175 438	3 423 250	
USD	20 729	General Mills Inc.	1 747 026	2 103 854	
USD	2 775	Hologic Inc.	231 557	297 323	
USD	10 609	Hormel Foods Corp.	652 500	564 623	
USD	785	Insulet Corp.	267 670	299 514	
USD	3 763	J.M. Smucker Co. (The)	749 866	735 306	
USD	11 910	Kimberly-Clark Corp.	2 122 892	2 175 813	
USD	7 955	Masco Corp.	579 729	604 008	
USD	8 686	NVIDIA Corp.	2 297 524	4 862 085	
USD	3 204	Owens Corning	386 872	553 280	
USD	22 710	Rivian Automotive Inc., catégorie A	698 845	500 650	
USD	8 665	Sherwin-Williams Co. (The)	3 175 513	3 044 442	
USD	28 220	Splunk Inc.	3 102 555	3 961 625	
USD	529	Teleflex Inc.	239 571	169 421	
USD	21 597	VMware Inc., catégorie A	3 599 343	4 106 405	
USD	8 447	Xylem Inc.	1 054 135	1 258 809	
			<b>35 137 564</b>	<b>41 680 285</b>	<b>55,8</b>
<b>JAPON</b>					
JPY	20 371	Astellas Pharma Inc.	416 243	400 791	
JPY	83 491	Azbil Corp.	4 066 723	3 463 399	
JPY	20 821	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	728 142	867 325	
JPY	21 164	Daiwa House Industry Co., Ltd.	753 758	734 742	
JPY	2 838	Eisai Co., Ltd.	256 847	252 654	
JPY	16 443	Kao Corp.	1 407 875	784 912	
JPY	3 691	Kurita Water Industries Ltd.	175 920	185 653	
JPY	3 039	Kyowa Kirin Co., Ltd.	79 286	74 120	
JPY	10 133	Lixil Group Corp.	206 829	169 212	
JPY	7 768	Meiji Holdings Co., Ltd.	242 713	228 857	
JPY	78	Nippon Prologis REIT Inc.	257 498	206 591	
JPY	2 178	NISSIN FOODS HOLDINGS CO., LTD.	228 697	237 486	
JPY	4 368	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	110 919	104 214	
JPY	2 764	Open House Group Co., Ltd.	143 219	130 751	
JPY	2 941	Shionogi & Co.	213 986	163 438	
JPY	1 888	Systemex Corp.	220 719	169 428	
JPY	7 575	Terumo Corp.	346 904	316 378	
JPY	4 685	Toto Ltd.	274 352	185 509	
JPY	14 242	Uni-Charm Corp.	741 637	696 406	
JPY	7 750	West Japan Railway Co.	564 824	425 008	
			<b>11 437 091</b>	<b>9 796 874</b>	<b>13,1</b>
<b>DANEMARK</b>					
DKK	743	Genmab AS	339 657	371 670	
DKK	16 305	Novo Nordisk AS, catégorie B	1 605 125	3 475 563	
DKK	6 676	Orsted AS	1 063 284	834 623	

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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>DANEMARK (suite)</b>					
DKK	323	Rockwool International AS, catégorie B	104 465	110 409	
DKK	35 641	Vestas Wind Systems AS	1 321 509	1 253 948	
			<b>4 434 040</b>	<b>6 046 213</b>	<b>8,1</b>
<b>FRANCE</b>					
EUR	66 363	Dassault Systemes SE	3 967 778	3 892 119	
EUR	1 623	Gecina SA	289 740	228 566	
EUR	7 593	Klépierre SA	228 391	249 051	
			<b>4 485 909</b>	<b>4 369 736</b>	<b>5,9</b>
<b>SUISSE</b>					
CHF	1 203	Geberit AG, actions nominatives	997 814	832 900	
CHF	23 073	Novartis AG, actions nominatives	2 992 124	3 071 393	
			<b>3 989 938</b>	<b>3 904 293</b>	<b>5,2</b>
<b>SUÈDE</b>					
SEK	21 498	Essity AB, catégorie B	841 165	756 131	
SEK	3 311	Holmen AB, catégorie B	206 734	157 139	
SEK	21 383	Svenska Cellulosa AB, série B	408 923	360 064	
			<b>1 456 822</b>	<b>1 273 334</b>	<b>1,7</b>
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	2 560	Knorr-Bremse AG	237 497	258 631	
EUR	2 616	LEG Immobilien SE	404 438	198 802	
EUR	25 279	Vonovia SE	629 001	653 068	
			<b>1 270 936</b>	<b>1 110 501</b>	<b>1,5</b>
<b>R.-U.</b>					
GBP	3 801	Berkeley Group Holdings PLC (The)	276 565	250 855	
GBP	6 475	Johnson Matthey PLC	274 211	190 191	
GBP	42 682	Segro PLC	864 447	514 696	
			<b>1 415 223</b>	<b>955 742</b>	<b>1,3</b>
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	8 841	IDP Education Ltd.	194 622	172 100	
AUD	183 183	Scentre Group	481 089	427 581	
AUD	136 563	Vicinity Centres	221 151	221 931	
			<b>896 862</b>	<b>821 612</b>	<b>1,1</b>
<b>SINGAPOUR</b>					
SGD	187 643	CapitaLand Integrated Commercial Trust	371 377	350 427	
SGD	17 649	City Developments Ltd.	136 455	115 963	
SGD	51 351	Keppel Corp., Ltd.	295 043	336 902	
			<b>802 875</b>	<b>803 292</b>	<b>1,1</b>
<b>FINLANDE</b>					
EUR	14 931	Neste OYJ	765 769	760 042	<b>1,0</b>
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	15 513	Mowi ASA	418 747	326 110	
NOK	26 507	Orkla ASA	314 038	252 420	
NOK	2 561	Salmar ASA	202 751	136 932	
			<b>935 536</b>	<b>715 462</b>	<b>1,0</b>
<b>HONG KONG</b>					
HKD	54 722	MTR Corp., Ltd.	386 840	332 643	
HKD	41 293	Swire Properties Ltd.	151 162	134 291	
HKD	294 329	WH Group Ltd.	274 453	206 251	
			<b>812 455</b>	<b>673 185</b>	<b>0,9</b>
<b>CANADA</b>					
	5 186	FPI RioCan	103 876	99 986	
	2 008	West Fraser Timber Co., Ltd.	183 973	228 531	
			<b>287 849</b>	<b>328 517</b>	<b>0,4</b>
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	14 322	Red Electrica Corp. SA	373 405	318 103	<b>0,4</b>

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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	7 392	Umicore SA	430 079	273 086	0,4
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	2 403	Verbund AG	296 939	254 808	0,3
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	4 436	JDE Peet's N.V.	194 438	174 576	0,2
<b>NOUVELLE ZÉLANDE</b>					
NZD	24 472	Mercury NZ Ltd.	130 867	128 955	0,2
<b>IRLANDE</b>					
USD	713	Jazz Pharmaceuticals PLC	135 159	116 963	0,2
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>69 689 756</b>	<b>74 505 579</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(76 237)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>69 613 519</b>	<b>74 505 579</b>	<b>99,8</b>
Contrat(s) de change à terme				(5 846)	-
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>69 613 519</b>	<b>74 499 733</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				140 034	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>74 639 767</b>	<b>100,0</b>

## 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+	5 juillet 2023	AUD	141 498	CAD	124 265	1,14	370
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	AUD	5 886	CAD	5 174	1,14	11
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	AUD	7 767	CAD	6 842	1,14	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	135 722	AUD	151 724	0,89	2 080
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	2 999	AUD	3 427	0,88	(19)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	601 583	CHF	408 052	1,47	(1 954)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	941 513	DKK	4 851 925	0,19	787
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	1 134 998	EUR	785 296	1,45	1 293
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	151 121	GBP	89 966	1,68	(230)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	104 323	HKD	620 227	0,17	(406)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	1 527 076	JPY	164 323 081	0,01	22 661
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	53 382	JPY	5 780 194	0,01	463
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	117 313	NOK	950 598	0,12	(97)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	19 656	NZD	24 079	0,82	136
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	201 032	SEK	1 628 831	0,12	1 487
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	125 321	SGD	127 593	0,98	566
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	3 380	SGD	3 450	0,98	7
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	130 144	USD	98 864	1,32	(678)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CAD	6 287 049	USD	4 775 063	1,32	(31 554)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	CHF	408 052	CAD	602 527	0,68	1 010
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	DKK	4 720 535	CAD	914 226	5,16	1 024
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	DKK	131 391	CAD	25 522	5,15	(47)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	EUR	766 297	CAD	1 105 230	0,69	1 047
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	EUR	19 000	CAD	27 282	0,70	147
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	GBP	86 587	CAD	144 722	0,60	945
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	GBP	3 378	CAD	5 651	0,60	33
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	HKD	620 227	CAD	104 835	5,92	(107)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	JPY	3 725 515	CAD	34 188	108,97	(80)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	JPY	166 377 760	CAD	1 523 902	109,18	(677)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	NOK	891 660	CAD	109 600	8,14	530
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	NOK	23 310	CAD	2 867	8,13	12
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	NOK	35 628	CAD	4 423	8,05	(23)

\*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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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+	5 juillet 2023	NZD	24 079	CAD	19 372	1,24	148
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	SEK	1 628 831	CAD	198 762	8,19	784
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	SGD	127 498	CAD	124 619	1,02	43
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	SGD	3 545	CAD	3 447	1,03	19
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	5 juillet 2023	USD	4 873 927	CAD	6 456 648	0,75	(7 223)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	127 313	AUD	144 918	0,88	(391)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	601 679	CHF	406 442	1,48	(1 089)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	928 385	DKK	4 787 551	0,19	(1 126)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	1 123 879	EUR	778 443	1,44	(1 114)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	149 168	GBP	89 270	1,67	(976)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	106 973	HKD	632 800	0,17	107
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	1 543 976	JPY	167 890 660	0,01	447
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	110 373	NOK	897 469	0,12	(549)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	19 666	NZD	24 458	0,80	(151)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	199 593	SEK	1 634 271	0,12	(804)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	125 825	SGD	128 668	0,98	(61)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	2 août 2023	CAD	6 417 042	USD	4 846 114	1,32	7 354
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(5 846)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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	43	(43)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>43</b>	<b>(43)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(49)	43	-	(6)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(49)</b>	<b>43</b>	<b>-</b>	<b>(6)</b>

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	21	(21)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>21</b>	<b>(21)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(261)	21	-	(240)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(261)</b>	<b>21</b>	<b>-</b>	<b>(240)</b>

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

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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	28	12
Paiements indirects <sup>†</sup>	10	5

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	550 000	500 000	2 350 000	2 700 000
Parts rachetables émises	-	100 000	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(150 000)	-	(100 000)	(250 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	400 000	600 000	2 250 000	2 450 000

<sup>†</sup> 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 indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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 ordinaires couvertes	0,350
Parts ordinaires non couvertes	0,350

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	13	3 353
Garanties (hors trésorerie)	13	3 781

## 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	6	6
Charges	(2)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	4	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,1</b>	<b>38,0</b>

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG 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 (%)
Actions - É.-U.	58,8
Actions - Japon	15,9
Actions - Danemark	8,9
Actions - France	3,8
Actions - R.-U.	2,3
Actions - Suède	1,8
Actions - Australie	1,7
Actions - Singapour	1,2
Actions - Suisse	1,1
Actions - Hong Kong	1,1
Actions - Norvège	1,0
Actions - Belgique	0,5
Actions - Espagne	0,5
Actions - Canada	0,4
Actions - Autriche	0,4
Actions - Allemagne	0,3
Actions - Irlande	0,2
Actions - Pays-Bas	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Contrat(s) de change à terme	(0,3)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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 de rendement MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels Hedged to CAD	7 362 145

## Autre risque de prix (suite)

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels Hedged to CAD	7 312 111

### 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	41 837	(6 410)	35 427	47,5
Yen japonais	9 826	(1 544)	8 282	11,1
Euro	7 276	(1 125)	6 151	8,2
Couronne danoise	6 047	(930)	5 117	6,9
Franc suisse	3 905	(603)	3 302	4,4
Couronne suédoise	1 274	(200)	1 074	1,4
Livre sterling	964	(150)	814	1,1
Dollar australien	823	(128)	695	0,9
Dollar de Singapour	805	(126)	679	0,9
Couronne norvégienne	717	(111)	606	0,8
Dollar de Hong Kong	695	(107)	588	0,8
Dollar néo-zélandais	130	(20)	110	0,1
<b>Total</b>	<b>74 299</b>	<b>(11 454)</b>	<b>62 845</b>	<b>84,1</b>

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	43 279	(8 323)	34 956	47,8
Yen japonais	11 639	(2 209)	9 430	12,9
Couronne danoise	6 510	(1 251)	5 259	7,2
Euro	4 136	(804)	3 332	4,6
Livre sterling	1 655	(319)	1 336	1,8
Couronne suédoise	1 347	(260)	1 087	1,5
Dollar australien	1 235	(236)	999	1,4
Dollar de Singapour	910	(173)	737	1,0
Franc suisse	832	(161)	671	0,9
Dollar de Hong Kong	790	(151)	639	0,9
Couronne norvégienne	738	(140)	598	0,8
<b>Total</b>	<b>73 071</b>	<b>(14 027)</b>	<b>59 044</b>	<b>80,8</b>

~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 6 285 000 \$ (5 904 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

(auparavant FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI)

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	74 506	-	-	74 506
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(6)	-	(6)
<b>Total</b>	<b>74 506</b>	<b>(6)</b>	<b>-</b>	<b>74 500</b>

### 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	73 295	-	-	73 295
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(240)	-	(240)
<b>Total</b>	<b>73 295</b>	<b>(240)</b>	<b>-</b>	<b>73 055</b>

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 privilégiées 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	53 638	61 204
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	740	1 161
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	67	19
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	14	15
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	80	88
Intérêts à recevoir	55	89
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	54 594	62 576
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	5	21
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	29	35
Frais d'administration à payer	5	5
Comptes créditeurs et charges à payer	17	19
	56	80
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>54 538</b>	<b>62 496</b>

## 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 ordinaires	54 538	62 496	19,51	20,19	2 795 078	3 095 078

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

# FNB d'actions privilégiées 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 759	2 003
Intérêts aux fins des distributions	187	58
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	(160)	1 162
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(1 810)	(10 260)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(24)</b>	<b>(7 037)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(10)	4
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	5	6
Rabais sur frais	88	111
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>84</b>	<b>121</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>60</b>	<b>(6 916)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	188	263
Frais d'administration (note 5)	28	40
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	11
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	4	-
Taxe de vente harmonisée	13	20
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>236</b>	<b>335</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(176)</b>	<b>(7 251)</b>

## 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 ordinaires	(176)	(7 251)	(0,06)	(2,08)	2 865 520	3 494 526

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



# FNB d'actions privilégiées 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	62 496	87 723
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(176)	(7 251)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1 520)	(1 647)
Profits nets réalisés	(73)	-
Remboursement de capital	-	(82)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 593)	(1 729)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 051	1 202
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 240)	(10 118)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(6 189)	(8 916)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(7 958)	(17 896)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	54 538	69 827

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

# FNB d'actions privilégiées 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(176)	(7 251)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	160	(1 162)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	(2)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	11
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	1 810	10 260
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	3 361	8 481
Achat de placements et de dérivés	(3 257)	(3 597)
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	17
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	33	(35)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(5)	(8)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(1)	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(1)	(1)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 934</b>	<b>6 712</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 593)	(1 729)
Produit de l'émission de parts rachetables	110	69
Montant versé au rachat de parts rachetables	(871)	(4 853)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2 354)</b>	<b>(6 513)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	2
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(420)	199
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 161	1 396
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>740</b>	<b>1 597</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 767	2 020
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	217	23
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 privilégiées 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
		<b>ACTIONS ORDINAIRES</b>			
	32 644	AltaGas Ltd., privilégiées, série G, taux variable, perpétuelles	608 213	563 109	
	11 923	Artis REIT, privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	239 993	205 672	
	18 043	Banque de Montréal, privilégiées, catégorie B, série 29, taux variable, perpétuelles	348 217	309 077	
	16 291	Banque de Montréal, privilégiées, catégorie B, série 31, taux variable, perpétuelles	300 154	276 947	
	23 869	Banque de Montréal, privilégiées, catégorie B, série 46, taux variable, perpétuelles	583 351	572 617	
	23 349	Banque de Montréal, privilégiées, série 27, taux variable, perpétuelles	452 851	418 414	
	50 345	BCE Inc., privilégiées, catégorie A, série 19, taux variable, perpétuelles	933 258	731 009	
	119 318	BCE Inc., privilégiées, série AB, taux flottant, perpétuelles	2 001 677	2 148 918	
	1 467	BCE Inc., privilégiées, série AC, taux variable, perpétuelles	26 963	26 039	
	93 942	BCE Inc., privilégiées, série AD, taux flottant, perpétuelles	1 579 970	1 698 472	
	23 082	BCE Inc., privilégiées, série AF, taux variable, perpétuelles	387 864	373 698	
	13 752	BCE Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	234 234	207 518	
	15 529	BCE Inc., privilégiées, série Z, taux variable, perpétuelles	268 830	279 522	
	18 917	Brookfield Corp., 4,75 %, privilégiées, série 17, perpétuelles	404 219	327 832	
	16 574	Brookfield Corp., 4,90 %, privilégiées, catégorie A, série 37, perpétuelles	356 887	292 200	
	22 421	Brookfield Corp., privilégiées, série 2, taux flottant, perpétuelles	295 990	260 980	
	8 139	Brookfield Corp., privilégiées, série 28-A, taux variable, perpétuelles	125 972	117 771	
	20 737	Brookfield Corp., privilégiées, série 32, taux variable, perpétuelles	434 086	398 150	
	20 918	Brookfield Infrastructure Partners LP, privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	498 980	448 273	
	19 452	Brookfield Infrastructure Partners LP, privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	420 852	377 369	
	18 989	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série AA, taux variable, perpétuelles	337 729	204 891	
	26 459	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série CC, taux variable, perpétuelles	668 834	442 924	
	37 638	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série EE, taux variable, perpétuelles	826 708	483 272	
	14 914	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série GG, taux variable, perpétuelles	316 913	221 324	
	69 558	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série P, taux variable, perpétuelles	1 071 106	740 097	
	37 825	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	657 374	402 836	
	17 994	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série T, taux variable, perpétuelles	308 604	247 777	
	46 247	Brookfield Renewable Partners LP, privilégiées, série 13, taux variable, perpétuelles	1 023 276	924 478	
	3 403	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, catégorie A, série 47, taux variable, perpétuelles	68 732	68 843	
	21 231	Canadian Utilities Ltd., privilégiées, 4,75 %, série HH, perpétuelles	514 806	385 873	
	53 898	Capital Power Corp., privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	997 514	1 122 156	
	52 009	Capital Power Corp., privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	958 820	1 073 986	
	33 132	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	779 284	635 803	
	15 387	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	305 572	289 276	
USD	26 635	Citigroup Capital XIII, privilégiées, taux variable	954 619	1 004 203	
	22 112	CU Inc., 4,6 %, privilégiées, série 1, perpétuelles	460 307	380 879	
	11 516	E-L Financial Corp. Ltd., 5,5 %, privilégiées, série 3, perpétuelles	285 982	231 414	
	30 189	Element Fleet Management Corp., privilégiées, série A, taux variable, perpétuelles	736 957	754 121	
	11 182	Element Fleet Management Corp., privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	284 285	275 636	
	45 609	Emera Inc., 4,6 %, privilégiées, série L, perpétuelles	1 069 568	779 914	
	150	Emera Inc., 4,6 %, privilégiées, série L, perpétuelles	2 558	2 565	
USD	77 592	Enbridge Inc., privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	2 088 860	2 209 986	
	21 466	Enbridge Inc., privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	333 068	317 267	
	11 403	Enbridge Inc., privilégiées, série 9, taux variable, perpétuelles	193 537	173 782	
	23 751	Enbridge Inc., privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	459 926	352 940	
	45 737	Enbridge Inc., privilégiées, série D, taux variable, perpétuelles	724 615	767 009	
	34 799	Enbridge Inc., privilégiées, série G, taux flottant, perpétuelles	599 463	685 540	
USD	3 645	Enbridge Inc., privilégiées, série L, taux variable, perpétuelles	87 986	92 953	
	34 452	Enbridge Inc., privilégiées, série P, taux variable, perpétuelles	550 334	554 677	
	7 878	Enbridge Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	121 965	121 242	
USD	8 896	Enbridge Inc., privilégiées, taux variable, perpétuelles	225 598	239 824	
	25 478	Fortis Inc., 4,75 %, privilégiées, série J, perpétuelles	573 378	485 356	
	15 506	Fortis Inc., 4,9 %, privilégiées, série F, perpétuelles	363 242	305 468	
	11 384	George Weston Limitée, 5,2 %, privilégiées, série IV, perpétuelles	265 105	222 785	
	28 632	George Weston Limitée, 5,8 %, privilégiées, série I, perpétuelles	723 726	627 900	
	7 961	Great-West Lifeco Inc. 4,5 %, actions privilégiées, série Y, perpétuelles	195 510	138 123	

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 privilégiées 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
		<b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>			
	21 307	Great-West Lifeco Inc., 4,85 %, privilégiées, série H, perpétuelles	484 320	386 083	
	25 745	Great-West Lifeco Inc., 5,15 %, privilégiées, série T, perpétuelles	603 117	503 315	
	36 996	Great-West Lifeco Inc., 5,2 %, privilégiées, série G, perpétuelles	876 128	715 133	
	17 195	Great-West Lifeco Inc., 5,25 %, privilégiées, série S, perpétuelles	414 852	332 035	
	18 184	Great-West Lifeco Inc., 5,4 %, privilégiées, série P, perpétuelles	399 238	361 680	
	9 566	Intact Corporation financière, 5,2 %, privilégiées, catégorie A, série 5, perpétuelles	226 980	195 146	
	7 111	Intact Corporation financière, 5,3 %, privilégiées, catégorie A, série 6, perpétuelles	183 267	149 722	
	11 969	Intact Corporation financière, 5,4 %, privilégiées, série 9, perpétuelles	296 265	258 650	
	23 389	Banque Laurentienne du Canada, 4,3 %, privilégiées, catégorie A, série 13, perpétuelles	396 243	359 021	
	38 861	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,3 %, privilégiées, série B, perpétuelles	973 657	827 351	
	45 711	Société Financière Manuvie, 4,65 %, privilégiées, catégorie A, série 2, perpétuelles	999 084	823 712	
	2 237	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 15, taux variable, perpétuelles	47 982	39 438	
	7 778	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 17, taux variable, perpétuelles	173 874	131 370	
	6 009	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 19, taux variable, perpétuelles	134 502	99 088	
	18 357	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 3, taux variable, perpétuelles	252 730	232 216	
	1 820	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	43 975	37 310	
	15 948	Banque Nationale du Canada, privilégiées, série 32, taux variable, perpétuelles	291 925	266 332	
	26 048	Banque Nationale du Canada, privilégiées, série 42, taux variable, perpétuelles	543 517	567 586	
	560	Pembina Pipeline Corp., privilégiées, catégorie A, série 21, taux variable, perpétuelles	13 412	11 463	
	33 404	Pembina Pipeline Corp., privilégiées, série 22, taux flottant, perpétuelles	764 486	726 704	
	41 345	Power Corporation du Canada, 5,6 %, privilégiées, série A, perpétuelles	1 022 086	855 842	
	15 566	Corporation Financière Power, 5,15 %, privilégiées, série V, perpétuelles	355 671	298 712	
	26 786	Corporation Financière Power, 5,25 %, privilégiées, série E, perpétuelles	639 847	527 148	
	17 749	Corporation Financière Power, 5,75 %, privilégiées, série H, perpétuelles	442 930	378 941	
	36 001	Corporation Financière Power, privilégiées, série A, taux flottant, perpétuelles	475 034	468 013	
	21 077	Corporation Financière Power, privilégiées, série T, taux variable, perpétuelles	421 924	385 709	
	11 792	Banque Royale du Canada, privilégiées, série AZ, taux variable, perpétuelles	228 241	206 124	
	35 993	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BB, taux variable, perpétuelles	684 826	622 319	
	21 373	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BD, taux variable, perpétuelles	460 716	391 981	
	18 560	Sagen MI Canada Inc., 5,4 %, privilégiées, série 1, perpétuelles	447 011	367 488	
	10 084	Financière Sun Life Inc., 4,45 %, privilégiées, catégorie A, série 3, perpétuelles	239 075	179 999	
	36 830	Financière Sun Life Inc., 4,45 %, privilégiées, catégorie A, série 4, perpétuelles	747 385	656 679	
	16 968	Financière Sun Life Inc., 4,5 %, privilégiées, catégorie A, série 5, perpétuelles	356 365	306 951	
	34 520	Financière Sun Life Inc., privilégiées, catégorie A, série 10R, taux variable, perpétuelles	581 903	516 074	
	33 771	Financière Sun Life Inc., privilégiées, catégorie A, série 8R, taux variable, perpétuelles	479 620	429 567	
	55 828	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	864 002	763 169	
	41 559	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	487 847	433 460	
	21 243	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	366 457	324 805	
	21 573	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 9, taux variable, perpétuelles	357 568	318 202	
	24 642	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	515 853	422 857	
	28 227	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	533 088	487 763	
	17 894	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	384 670	326 566	
	36 960	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 18, taux variable, perpétuelles	806 139	772 094	
	20 576	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 20, taux variable, perpétuelles	409 735	456 581	
	6 300	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 22, taux variable, perpétuelles	157 750	147 987	
	19 367	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 24, taux variable, perpétuelles	473 500	462 484	
	50 470	TransAlta Corp., privilégiées, série C, taux variable, perpétuelles	776 783	911 488	
	66 803	TransAlta Corp., privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	1 191 875	1 396 851	
	8 764	TransAlta Corp., privilégiées, série G, taux variable, perpétuelles	160 138	168 356	
			<b>53 826 015</b>	<b>49 008 272</b>	<b>89,8</b>
		<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>			
	358 000	Banque de Montréal, convertibles, taux variable, 26 avril 2028	358 019	348 272	
	500 000	Banque de Montréal, convertibles, taux variable, 26 novembre 2027	500 000	491 729	
	550 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 28 septembre 2027	550 000	539 877	
USD	311 000	General Electric Co., série D, convertible, taux variable, 15 juin 2023	387 475	413 542	
	1 300 000	Banque Royale du Canada, série BT, convertibles, taux variable, 24 février 2027	1 300 000	975 828	

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 d'actions privilégiées 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
<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)</b>				
1 500 000	Banque Toronto Dominion (La), série 27, convertibles, taux variable, 1 <sup>er</sup> octobre 2027	1 499 999	1 270 786	
600 000	Banque Toronto Dominion (La), série 28, convertibles, taux variable, 1 <sup>er</sup> octobre 2027	600 000	589 352	
		<b>5 195 493</b>	<b>4 629 386</b>	<b>8,5</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>59 021 508</b>	<b>53 637 658</b>	<b>98,3</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(14 320)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>		<b>59 007 188</b>	<b>53 637 658</b>	<b>98,3</b>
Contrat(s) de change à terme			62 407	0,1
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>59 007 188</b>	<b>53 700 065</b>	<b>98,4</b>
Autres actifs (passifs) nets			837 816	1,6
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>54 537 881</b>	<b>100,0</b>

## 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 Montreal	A-1	18 juillet 2023	CAD	194 451	USD	144 751	1,34	2 733
Bank of Montreal	A-1	18 juillet 2023	CAD	150 748	USD	111 795	1,35	2 679
Bank of Montreal	A-1	15 août 2023	CAD	250 043	USD	184 275	1,36	6 088
Bank of Montreal	A-1	13 septembre 2023	CAD	50 441	USD	37 068	1,36	1 391
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 juillet 2023	CAD	194 051	USD	144 751	1,34	2 333
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	286 727	USD	213 421	1,34	4 188
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 août 2023	CAD	8 331	USD	6 127	1,36	220
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 septembre 2023	CAD	50 431	USD	37 068	1,36	1 381
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	CAD	194 367	USD	144 751	1,34	2 649
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	USD	153 500	CAD	204 731	0,75	(1 425)
Citibank N.A., New York	A-1	18 juillet 2023	USD	153 500	CAD	204 747	0,75	(1 441)
Citibank N.A., New York	A-1	15 août 2023	CAD	283 909	USD	213 421	1,33	1 369
Citibank N.A., New York	A-1	15 août 2023	CAD	35 629	USD	26 229	1,36	906
Citibank N.A., New York	A-1	15 août 2023	CAD	35 609	USD	26 229	1,36	886
Citibank N.A., New York	A-1	13 septembre 2023	CAD	29 471	USD	21 979	1,34	387
Banque HSBC, Toronto	A-1	18 juillet 2023	CAD	194 106	USD	144 751	1,34	2 388
Banque HSBC, Toronto	A-1	15 août 2023	CAD	35 488	USD	26 155	1,36	862
Banque HSBC, Toronto	A-1	15 août 2023	CAD	35 465	USD	26 155	1,36	839
Banque HSBC, Toronto	A-1	15 août 2023	CAD	35 453	USD	26 155	1,36	827
Banque HSBC, Toronto	A-1	15 août 2023	CAD	35 448	USD	26 155	1,36	822
Banque HSBC, Toronto	A-1	15 août 2023	USD	148 000	CAD	195 477	0,76	455
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	39 834	USD	29 654	1,34	594
Banque HSBC, Toronto	A-1	13 septembre 2023	CAD	29 472	USD	21 979	1,34	388
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	249 976	USD	184 275	1,36	6 021
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	258 316	USD	194 000	1,33	1 486
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	35 616	USD	26 229	1,36	893
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	35 616	USD	26 229	1,36	893
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	15 août 2023	CAD	35 590	USD	26 229	1,36	867
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	194 100	USD	144 751	1,34	2 382
Banque Royale du Canada	A-1+	18 juillet 2023	CAD	85 733	USD	63 204	1,36	2 021
Banque Royale du Canada	A-1+	15 août 2023	CAD	249 987	USD	184 275	1,36	6 032
Banque Royale du Canada	A-1+	15 août 2023	CAD	32 382	USD	23 856	1,36	799
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	150 813	USD	111 791	1,35	2 749
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	18 juillet 2023	CAD	194 289	USD	144 751	1,34	2 571
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	15 août 2023	CAD	249 858	USD	184 275	1,36	5 903
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	15 août 2023	USD	95 000	CAD	127 496	0,75	(1 729)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>62 407</b>

\*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 privilégiées 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	67	(5)	-	62
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>67</b>	<b>(5)</b>	<b>-</b>	<b>62</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(5)	5	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(5)</b>	<b>5</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	19	(7)	-	12
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>19</b>	<b>(7)</b>	<b>-</b>	<b>12</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(21)	7	-	(14)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(21)</b>	<b>7</b>	<b>-</b>	<b>(14)</b>

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

# FNB d'actions privilégiées 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	1	6
Paiements indirects <sup>†</sup>	-	3

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	3 095 078	3 595 078
Parts rachetables émises	50 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(350 000)	(450 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>2 795 078</b>	<b>3 195 078</b>

<sup>†</sup> 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 privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires	0,650	0,10

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	226
Garanties (hors trésorerie)	-	239

## 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	9
Charges	(4)	(3)
Revenu tiré des prêts de titres	5	6
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>44,0</b>	<b>38,7</b>



# FNB d'actions privilégiées 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 (%)
Actions ordinaires	86,8
Obligations - Obligations de sociétés	9,8
Autres actifs (passifs) nets	2,1
Obligations - Obligations étrangères	1,3
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 (%)
AA/Aa/A+	0,1
A	13,1
BBB/Baa/B++	57,4
BB/Ba/B+	24,9
Aucune	3,0
<b>Total</b>	<b>98,5</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AA/Aa/A+	0,1
A	11,5
BBB/Baa/B++	64,1
BB/Ba/B+	21,7
Aucune	0,6
<b>Total</b>	<b>98,0</b>

\*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 dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 4 901 000 \$ (5 425 000 \$ 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~

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	4 223	(3 147)	1 076	2,0
<b>Total</b>	<b>4 223</b>	<b>(3 147)</b>	<b>1 076</b>	<b>2,0</b>

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)		
Dollar américain	5 181	(3 941)	1 240	2,0
<b>Total</b>	<b>5 181</b>	<b>(3 941)</b>	<b>1 240</b>	<b>2,0</b>

~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 108 000 \$ (124 000 \$ 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

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

	Plus de				Total
	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)	5 ans (en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	-	-	4 629	4 629

au 31 décembre 2022

	Plus de				Total
	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)	5 ans (en milliers de dollars)	
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	-	-	6 953	6 953

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 134 000 \$ (196 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	49 008	-	-	49 008
Obligations	-	4 630	-	4 630
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	62	-	62
<b>Total</b>	<b>49 008</b>	<b>4 692</b>	<b>-</b>	<b>53 700</b>

### 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	54 251	-	-	54 251
Obligations	-	6 953	-	6 953
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(2)	-	(2)
<b>Total</b>	<b>54 251</b>	<b>6 951</b>	<b>-</b>	<b>61 202</b>

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.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	au 30 juin 2023	au 31 déc. 2022
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	14 077	19 407
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	10	2
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	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	66	70
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription d'actions	-	-
	14 153	19 479
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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 d'actions	58	-
Dividendes à payer aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	3	4
Frais d'administration à payer	1	1
Comptes créditeurs et charges à payer	12	8
	74	13
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	14 079	19 466

## États de la situation financière (suite)

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie (note 4):		Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre d'actions 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
	Actions FNB	14 079	19 466	17,60	17,70	800 000

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

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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 action et le nombre d'actions)

	2023	2022
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	184	314
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	(441)	(948)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	455	(691)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>198</b>	<b>(1 325)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	3	4
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>4</b>	<b>4</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>202</b>	<b>(1 321)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	21	39
Frais d'administration (note 5)	5	11
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)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de titres	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	3	5
Jetons de présence des administrateurs	-	-
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>31</b>	<b>58</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	<b>171</b>	<b>(1 379)</b>

## 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 action et le nombre d'actions)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre moyen pondéré d'actions :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actions FNB	171	(1 379)	0,18	(0,80)	962 155	1 733 702

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

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	19 466	40 373
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	171	(1 379)
<b>Dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>		
Revenu net de placement	-	-
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(174)	(231)
<b>Total des dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>	(174)	(231)
<b>Transactions sur actions rachetables</b>		
Produit de l'émission d'actions rachetables	-	925
Réinvestissement des dividendes aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Rachat d'actions rachetables	(5 384)	(17 355)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur actions rachetables</b>	(5 384)	(16 430)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	(5 387)	(18 040)
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	14 079	22 333

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

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	171	(1 379)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	441	948
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	2
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(455)	691
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5 287	7 322
Achat de placements et de dérivés	(4 899)	(6 390)
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	5	60
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(4)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	4	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>554</b>	<b>1 249</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Dividendes versés aux porteurs d'actions rachetables, déduction faite des dividendes réinvestis	(174)	(231)
Produit de l'émission d'actions rachetables	-	54
Montant versé au rachat d'actions rachetables	(372)	(1 073)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(546)</b>	<b>(1 250)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2	28
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>10</b>	<b>27</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	189	374
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.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>				
160 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n°1, 1,1 %, 15 décembre 2026	156 219	144 387	
239 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,25 %, 15 juin 2026	234 136	218 703	
130 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,55 %, 15 décembre 2026	129 779	119 173	
291 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,8 %, 15 décembre 2024	293 787	278 344	
223 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,9 %, 15 septembre 2026	230 362	207 564	
342 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,95 %, 15 décembre 2025	360 744	321 780	
324 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 2,35 %, 15 juin 2027	301 830	304 022	
70 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 2,35 %, 15 mars 2028	66 769	65 287	
165 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 2,55 %, 15 mars 2025	175 269	159 011	
265 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,6 %, 15 décembre 2027	269 942	261 040	
162 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,8 %, 15 juin 2027	162 570	160 497	
320 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,95 %, 15 juin 2028	320 563	320 218	
100 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	107 229	94 761	
185 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série FEV., 2,65 %, 15 mars 2028	180 801	174 904	
339 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série MAR, 0,95 %, 15 juin 2025	337 461	315 480	
633 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2026	601 776	570 437	
739 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	726 982	679 677	
418 000	Gouvernement du Canada, 0,75 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2024	403 253	397 743	
427 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2026	428 289	389 695	
93 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 <sup>er</sup> juin 2027	84 868	83 991	
289 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2025	291 082	273 708	
512 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 <sup>er</sup> mars 2027	498 707	466 671	
327 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	335 513	314 618	
446 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> avril 2025	425 660	422 817	
134 800	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 <sup>er</sup> juin 2026	134 708	125 472	
208 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2028	195 747	193 898	
714 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 <sup>er</sup> juin 2025	734 544	685 313	
267 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> août 2024	261 509	260 856	
496 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2027	484 093	476 678	
327 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> novembre 2024	322 312	319 313	
165 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> octobre 2025	161 674	159 998	
94 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1 <sup>er</sup> avril 2026	92 529	91 084	
442 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 <sup>er</sup> mars 2028	443 775	438 635	
384 000	Gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 <sup>er</sup> février 2025	383 308	378 369	
		<b>10 337 790</b>	<b>9 874 144</b>	<b>70,2</b>
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>				
106 000	Province de l'Alberta, 2,2 %, 1 <sup>er</sup> juin 2026	110 362	99 623	
98 000	Province de l'Alberta, 2,35 %, 1 <sup>er</sup> juin 2025	102 381	93 795	
152 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 1 <sup>er</sup> juin 2027	146 382	143 201	
56 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,3 %, 18 juin 2026	56 704	52 781	
114 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	109 597	107 440	
160 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	171 000	154 502	
82 000	Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	87 471	78 614	
68 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	72 214	64 536	
47 000	Province du Manitoba, 2,6 %, 2 juin 2027	45 326	44 347	
64 000	Province du Manitoba, 3 %, 2 juin 2028	61 669	61 077	
19 000	Province du Manitoba, 4,4 %, 5 septembre 2025	20 900	18 882	
29 000	Province du Nouveau-Brunswick, 1,8 %, 14 août 2025	27 405	27 328	
32 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	29 924	29 816	
38 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,6 %, 14 août 2026	40 551	36 068	
83 000	Province de l'Ontario, 1,05 %, 8 septembre 2027	73 460	73 331	
37 000	Province de l'Ontario, 1,35 %, 8 septembre 2026	36 038	33 777	
246 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	254 800	231 233	
139 000	Province de l'Ontario, 1,85 %, 1 <sup>er</sup> février 2027	136 243	128 186	
124 000	Province de l'Ontario, 2,3 %, 8 septembre 2024	127 202	120 171	
304 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	303 656	287 452	

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

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)</b>				
400 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	428 730	384 652	
366 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2027	352 733	345 664	
88 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 5 février 2025	91 020	85 063	
320 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2028	307 117	304 247	
191 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	193 534	187 453	
175 000	Province de Québec, 2,5 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2026	181 201	165 873	
22 000	Province de Québec, 2,6 %, 6 juillet 2025	21 324	21 133	
227 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2025	244 971	218 176	
162 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2027	154 742	153 798	
163 000	Province de Québec, 3,75 %, 1 <sup>er</sup> septembre 2024	176 114	160 669	
53 000	Province de Québec, 8,5 %, 1 <sup>er</sup> avril 2026	70 059	58 495	
83 000	Province de Québec, série QY, 1,85 %, 13 février 2027	77 857	76 610	
35 000	Province de la Saskatchewan, 0,8 %, 2 septembre 2025	32 268	32 232	
48 000	Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	45 819	45 557	
32 000	Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	30 695	30 258	
		<b>4 421 469</b>	<b>4 156 040</b>	<b>29,5</b>
<b>OBLIGATIONS MUNICIPALES</b>				
49 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	51 863	46 472	0,3
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>14 811 122</b>	<b>14 076 656</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>14 811 122</b>	14 076 656	100,0
Autres actifs (passifs) nets			2 621	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>			<b>14 079 277</b>	<b>100,0</b>

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



# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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	-	-
Paielements indirects <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur actions rachetables (note 4)

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

	Actions FNB	
	2023	2022
<b>Nombre d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 100 000	2 150 000
Actions rachetables émises	-	50 000
Actions rachetables émises aux fins du réinvestissement des dividendes	-	-
Actions rachetables rachetées	(300 000)	(950 000)
<b>Nombre d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	800 000	1 250 000

<sup>†</sup> 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.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Actions FNB	0,250	0,06

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	10 045
Garanties (hors trésorerie)	-	10 567

## 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	4	7
Charges	(1)	(3)
Revenu tiré des prêts de titres	3	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,1</b>	<b>38,6</b>

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme 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 - Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	69,3
Obligations - Obligations provinciales et obligations garanties	30,1
Obligations - Obligations municipales	0,3
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	70,5
AA/Aa/A+	29,5
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	69,6
AA/Aa/A+	9,9
A	20,2
<b>Total</b>	<b>99,7</b>

\*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)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	8 349	5 728	-	14 077

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)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	11 729	7 678	-	19 407

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 d'actions rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 96 000 \$ (131 000 \$ 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	-	14 077	-	14 077
<b>Total</b>	-	14 077	-	14 077

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	-	19 407	-	19 407
<b>Total</b>	-	19 407	-	19 407

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 Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	639 309	524 867
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	773	851
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3 364	953
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	63	122
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	643 509	526 793
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	461
Swaps, options sur swaps et options	2 950	3 358
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	-	6
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	345	310
Comptes créditeurs et charges à payer	76	62
	3 372	4 197
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>640 137</b>	<b>522 596</b>

## 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 ordinaires couvertes	574 740	478 117	17,21	13,08	33 400 997	36 550 997
Parts ordinaires non couvertes	56 496	38 963	20,54	15,90	2 750 000	2 450 000
Parts ordinaires couvertes en \$ US	8 901	5 516	8,96*	6,79*	750 000	600 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 361	3 077
Intérêts aux fins des distributions	55	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	7 035	-
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	12 787	(12 330)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	164 803	(191 564)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>188 041</b>	<b>(200 817)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(23)	64
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	2
Rabais sur frais	1	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(17)</b>	<b>66</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>188 024</b>	<b>(200 751)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 887	1 791
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	255	172
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	1
Retenues d'impôts	480	443
Taxe de vente harmonisée	177	166
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>2 800</b>	<b>2 574</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>185 224</b>	<b>(203 325)</b>

## 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 ordinaires couvertes	167 642	(180 637)	4,85	(6,78)	34 600 721	26 642 920
Parts ordinaires non couvertes	15 261	(22 266)	5,47	(7,16)	2 790 331	3 111 326
Parts ordinaires couvertes en \$ US	2 321	(422)	3,20	(2,32)	724 309	181 304

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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 ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	478 117	510 586	38 963	73 144	5 516	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	167 642	(180 637)	15 261	(22 266)	2 321	(422)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(807)	(672)	(13)	(113)	(32)	(161)
Profits nets réalisés	-	(29 087)	-	(3 220)	-	-
Remboursement de capital	(24 087)	(105)	(2 433)	(13)	(364)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(24 894)</b>	<b>(29 864)</b>	<b>(2 446)</b>	<b>(3 346)</b>	<b>(396)</b>	<b>(161)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	39 281	204 401	10 373	16 877	2 032	4 071
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(85 406)	(28 940)	(5 655)	(8 532)	(572)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(46 125)</b>	<b>175 461</b>	<b>4 718</b>	<b>8 345</b>	<b>1 460</b>	<b>4 071</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>96 623</b>	<b>(35 040)</b>	<b>17 533</b>	<b>(17 267)</b>	<b>3 385</b>	<b>3 488</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>574 740</b>	<b>475 546</b>	<b>56 496</b>	<b>55 877</b>	<b>8 901</b>	<b>3 488</b>

	Total du Fonds	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	522 596	583 730
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	185 224	(203 325)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(852)	(946)
Profits nets réalisés	-	(32 307)
Remboursement de capital	(26 884)	(118)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(27 736)</b>	<b>(33 371)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	51 686	225 349
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(91 633)	(37 472)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(39 947)</b>	<b>187 877</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>117 541</b>	<b>(48 819)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>640 137</b>	<b>534 911</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	185 224	(203 325)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(12 787)	12 330
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	255	172
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(164 803)	191 564
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	283 685	165 257
Achat de placements et de dérivés	(264 000)	(135 107)
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	59	3
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	35	(26)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	14	(8)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>27 682</b>	<b>30 860</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(27 737)	(33 370)
Produit de l'émission de parts rachetables	108	1 925
Montant versé au rachat de parts rachetables	(131)	260
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(27 760)</b>	<b>(31 185)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(78)	(325)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	851	484
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>773</b>	<b>159</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 940	2 636
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	55	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(1)
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 Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	60 110	Accenture PLC, catégorie A	22 235 409	24 572 448	
USD	38 867	Adobe Inc.	19 827 127	25 177 635	
USD	161 391	Advanced Micro Devices Inc.	17 603 719	24 354 269	
USD	103 136	Analog Devices Inc.	22 608 593	26 616 777	
USD	105 166	Apple Inc.	18 010 641	27 023 640	
USD	140 202	Applied Materials Inc.	19 033 104	26 845 790	
USD	22 195	Broadcom Inc.	13 969 471	25 504 894	
USD	375 163	Cisco Systems Inc.	23 750 907	25 714 634	
USD	544 567	Intel Corp.	29 220 030	24 124 122	
USD	141 269	International Business Machines Corp.	24 937 063	25 042 021	
USD	42 536	Intuit Inc.	22 885 778	25 818 808	
USD	41 403	KLA Corp.	25 842 241	26 602 680	
USD	31 425	Lam Research Corp.	20 580 260	26 762 435	
USD	287 941	Micron Technology Inc.	26 702 620	24 073 299	
USD	56 344	Microsoft Corp.	20 764 221	25 418 489	
USD	44 823	NVIDIA Corp.	9 163 395	25 118 619	
USD	154 565	Oracle Corp.	15 935 762	24 384 866	
USD	80 190	Palo Alto Networks Inc.	20 840 679	27 143 261	
USD	158 123	QUALCOMM Inc.	25 476 179	24 935 719	
USD	92 072	Salesforce Inc.	21 866 348	25 767 885	
USD	34 317	ServiceNow Inc.	20 478 910	25 547 969	
USD	44 084	Synopsys Inc.	22 724 809	25 428 066	
USD	109 771	Texas Instruments Inc.	23 862 234	26 178 352	
			<b>488 319 500</b>	<b>588 156 678</b>	<b>91,9</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	156 723	Alphabet Inc., catégorie A	20 253 321	24 851 970	
USD	68 236	Meta Platforms Inc., catégorie A	17 592 998	25 941 741	
			<b>37 846 319</b>	<b>50 793 711</b>	<b>7,9</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	125 159	Altaba Inc., entiers	558 321	358 137	0,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>526 724 140</b>	<b>639 308 526</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(188 470)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>526 535 670</b>	<b>639 308 526</b>	<b>99,9</b>
Contrat(s) de change à terme				3 363 432	0,5
Position(s) vendeur sur option(s)				(2 950 396)	(0,5)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>526 535 670</b>	<b>639 721 562</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				415 772	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>640 137 334</b>	<b>100,0</b>

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 Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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	Devises achetée	Position	Devises vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	599 191 741	USD	450 071 558	1,33	3 145 008
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	12 632 290	CAD	16 599 068	0,76	130 349
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	15 650 213	CAD	20 663 055	0,76	63 113
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	1 912 543	CAD	2 515 040	0,76	17 812
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	653 769	CAD	859 404	0,76	6 407
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	665 068	CAD	879 572	0,76	1 203
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	643 576	CAD	852 773	0,75	(460)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>3 363 432</b>

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devises	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(152)	Accenture PLC, catégorie A, (option d'achat) – 330,00	100	21 juillet 2023	330,00	USD	(148 973)	(8 558)
(98)	Adobe Inc., (option d'achat) – 505,00	100	21 juillet 2023	505,00	USD	(230 380)	(85 685)
(408)	Advanced Micro Devices Inc., (option d'achat) – 125,00	100	21 juillet 2023	125,00	USD	(278 459)	(61 347)
(396)	Alphabet Inc., catégorie A, (option d'achat) – 125,00	100	21 juillet 2023	125,00	USD	(185 115)	(47 214)
(261)	Analog Devices Inc., (option d'achat) – 190,00	100	21 juillet 2023	190,00	USD	(185 375)	(257 591)
(266)	Apple Inc., (option d'achat) – 190,00	100	21 juillet 2023	190,00	USD	(80 313)	(203 501)
(355)	Applied Materials Inc., (option d'achat) – 140,00	100	21 juillet 2023	140,00	USD	(254 936)	(318 618)
(56)	Broadcom Inc., (option d'achat) – 880,00	100	21 juillet 2023	880,00	USD	(226 441)	(121 665)
(950)	Cisco Systems Inc., (option d'achat) – 52,50	100	21 juillet 2023	52,50	USD	(88 266)	(30 204)
(1 379)	Intel Corp., (option d'achat) – 37,00	100	21 juillet 2023	37,00	USD	(267 755)	(26 489)
(357)	International Business Machines Corp., (option d'achat) – 140,00	100	21 juillet 2023	140,00	USD	(131 405)	(43 274)
(107)	Intuit Inc., (option d'achat) – 460,00	100	21 juillet 2023	460,00	USD	(214 428)	(142 457)
(104)	KLA Corp., (option d'achat) – 480,00	100	21 juillet 2023	480,00	USD	(215 330)	(221 127)
(79)	Lam Research Corp., (option d'achat) – 625,00	100	21 juillet 2023	625,00	USD	(255 129)	(310 563)
(172)	Meta Platforms Inc., catégorie A, (option d'achat) – 290,00	100	21 juillet 2023	290,00	USD	(207 954)	(153 234)
(729)	Micron Technology Inc., (option d'achat) – 70,00	100	21 juillet 2023	70,00	USD	(250 806)	(24 144)
(142)	Microsoft Corp., (option d'achat) – 350,00	100	21 juillet 2023	350,00	USD	(149 136)	(58 316)
(113)	NVIDIA Corp., (option d'achat) – 440,00	100	21 juillet 2023	440,00	USD	(317 878)	(132 482)
(391)	Oracle Corp., (option d'achat) – 130,00	100	21 juillet 2023	130,00	USD	(118 188)	(9 065)
(203)	Palo Alto Networks Inc., (option d'achat) – 250,00	100	21 juillet 2023	250,00	USD	(172 338)	(267 580)
(400)	QUALCOMM Inc., (option d'achat) – 125,00	100	21 juillet 2023	125,00	USD	(197 488)	(48 751)
(233)	Salesforce Inc., (option d'achat) – 220,00	100	21 juillet 2023	220,00	USD	(124 387)	(54 325)
(86)	ServiceNow Inc., (option d'achat) – 570,00	100	21 juillet 2023	570,00	USD	(248 674)	(129 309)
(111)	Synopsys Inc., (option d'achat) – 450,00	100	21 juillet 2023	450,00	USD	(154 689)	(59 554)
(278)	Texas Instruments Inc., (option d'achat) – 180,00	100	21 juillet 2023	180,00	USD	(151 926)	(135 343)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(4 855 769)</b>	<b>(2 950 396)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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	3 364	(1)	-	3 363
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>3 364</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>3 363</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	953	(461)	-	492
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>953</b>	<b>(461)</b>	<b>-</b>	<b>492</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(461)	461	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(461)</b>	<b>461</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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	242	138
Paiements indirects <sup>†</sup>	85	60

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	36 550 997	22 348 997	2 450 000	2 900 000	600 000	-
Parts rachetables émises	2 650 000	11 350 000	600 000	800 000	200 000	350 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(5 800 000)	(1 700 000)	(300 000)	(400 000)	(50 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>33 400 997</b>	<b>31 998 997</b>	<b>2 750 000</b>	<b>3 300 000</b>	<b>750 000</b>	<b>350 000</b>

<sup>†</sup> 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 Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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 ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	14 755
Garanties (hors trésorerie)	-	15 707

## 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	6	3
Charges	(2)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	4	2
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>38,6</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - Technologies de l'information	88,3
Actions - Services de communication	8,1
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	4,0
Contrat(s) de change à terme	0,1
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,6</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,6)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,6)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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
<b>Total</b>	<b>0,5</b>

\*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 dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 63 931 000 \$ (52 487 000 \$ 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	639 309	(556 410)	82 899	13,0
<b>Total</b>	<b>639 309</b>	<b>(556 410)</b>	<b>82 899</b>	<b>13,0</b>

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	524 979	(480 825)	44 154	8,4
<b>Total</b>	<b>524 979</b>	<b>(480 825)</b>	<b>44 154</b>	<b>8,4</b>

~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 8 290 000 \$ (4 415 000 \$ 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	638 951	-	358	639 309
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	3 363	-	3 363
<b>Total</b>	<b>638 951</b>	<b>3 363</b>	<b>358</b>	<b>642 672</b>

Positions vendeur 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)
Option(s)	(2 950)	-	-	(2 950)
<b>Total</b>	<b>(2 950)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(2 950)</b>

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

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies 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	524 223	-	644	524 867
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	492	-	492
<b>Total</b>	<b>524 223</b>	<b>492</b>	<b>644</b>	<b>525 359</b>

Positions vendeur 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)
Option(s)	(3 358)	-	-	(3 358)
<b>Total</b>	<b>(3 358)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(3 358)</b>

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.

## 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)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Actions	644	-	(277)	-	-	8	(17)	358
<b>Total</b>	<b>644</b>	<b>-</b>	<b>(277)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8</b>	<b>(17)</b>	<b>358</b>

\*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 30 juin 2023 s'est établie à (16 993 \$).

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)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Actions	-	-	-	636	-	-	8	644
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>636</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8</b>	<b>644</b>

\*\*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 31 décembre 2022 s'est établie à (183 190 \$).

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, des placements ayant une juste valeur de 636 000 \$ ont été transférés du niveau 1 au niveau 3 puisque des données observables sur le marché sont devenues 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 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	88 786	99 883
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	400	356
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	312	138
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	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	89 498	100 377
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2	26
Swaps, options sur swaps et options	407	629
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	54	65
Frais d'administration à payer	9	10
Comptes créditeurs et charges à payer	16	27
	488	757
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>89 010</b>	<b>99 620</b>

## 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 ordinaires couvertes	89 010	99 620	9,39	9,99	9 475 890

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 787	2 446
Intérêts aux fins des distributions	11	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	889	-
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	2 396	3 236
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(6 700)	(11 981)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(1 617)</b>	<b>(6 299)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	3	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	4
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	15	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>19</b>	<b>3</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(1 598)</b>	<b>(6 296)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	349	522
Frais d'administration (note 5)	55	84
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	78	102
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	155	222
Taxe de vente harmonisée	43	62
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>681</b>	<b>993</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(2 279)</b>	<b>(7 289)</b>

## 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 ordinaires						
couvertes	(2 279)	(7 289)	(0,23)	(0,54)	9 810 420	13 528 100

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



# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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 ordinaires couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	99 620	129 500
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 279)	(7 289)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1 178)	(1 348)
Profits nets réalisés	(518)	-
Remboursement de capital	(1 790)	(3 341)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(3 486)</b>	<b>(4 689)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 639	20 955
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(9 484)	(6 571)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(4 845)</b>	<b>14 384</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(10 610)</b>	<b>2 406</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>89 010</b>	<b>131 906</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 279)	(7 289)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 396)	(3 236)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	78	102
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	6 700	11 981
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	24 048	32 019
Achat de placements et de dérivés	(22 564)	(29 658)
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	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(11)	2
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(11)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>3 563</b>	<b>3 921</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 486)	(4 689)
Produit de l'émission de parts rachetables	15	491
Montant versé au rachat de parts rachetables	(48)	34
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(3 519)</b>	<b>(4 164)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	44	(243)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	356	724
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>400</b>	<b>481</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 632	2 224
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	11	-
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 Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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
<b>É.-U.</b>					
USD	97 121	Aflac Inc.	7 807 765	8 980 540	
USD	58 471	Globe Life Inc.	7 084 030	8 491 106	
USD	225 904	Lincoln National Corp.	12 494 648	7 709 101	
USD	98 301	MetLife Inc.	8 400 611	7 361 577	
USD	78 520	Principal Financial Group Inc.	6 847 274	7 888 829	
USD	70 363	Prudential Financial Inc.	9 291 510	8 223 285	
USD	172 105	Unum Group	7 209 684	10 875 413	
			<b>59 135 522</b>	<b>59 529 851</b>	<b>66,8</b>
<b>CANADA</b>					
	269 485	Great-West Lifeco Inc.	9 798 135	10 367 088	
	362 902	Société Financière Manuvie	8 682 802	9 087 066	
	141 928	Financière Sun Life inc.	8 642 905	9 801 548	
			<b>27 123 842</b>	<b>29 255 702</b>	<b>32,9</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>86 259 364</b>	<b>88 785 553</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(132 380)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>86 126 984</b>	<b>88 785 553</b>	<b>99,7</b>
Contrat(s) de change à terme				310 343	0,4
Position(s) vendeur sur option(s)				(407 170)	(0,5)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>86 126 984</b>	<b>88 688 726</b>	<b>99,6</b>
Autres actifs (passifs) nets				321 273	0,4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>89 009 999</b>	<b>100,0</b>

## 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+	24 juillet 2023	CAD	58 224 744	USD	43 734 417	1,33	305 607
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	CAD	1 278 102	USD	966 729	1,32	(2 174)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	1 027 991	CAD	1 356 516	0,76	4 892
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	24 juillet 2023	USD	235 382	CAD	309 707	0,76	2 018
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>310 343</b>

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(244)	Aflac Inc., (option d'achat) – 72,50	100	21 juillet 2023	72,50	USD	(10 952)	(86 380)
(146)	Globe Life Inc., (option d'achat) – 110,00	100	21 juillet 2023	110,00	USD	(31 417)	(62 952)
(677)	Great-West Lifeco Inc., (option d'achat) – 39,00	100	21 juillet 2023	39,00	CAD	(37 912)	(55 457)
(567)	Lincoln National Corp., (option d'achat) – 25,00	100	21 juillet 2023	25,00	USD	(59 133)	(53 400)
(912)	Société Financière Manuvie, (option d'achat) – 26,00	100	21 juillet 2023	26,00	CAD	(13 680)	(51 294)
(247)	MetLife Inc., (option d'achat) – 57,50	100	21 juillet 2023	57,50	USD	(27 390)	(44 969)
(197)	Principal Financial Group Inc., (option d'achat) – 75,00	100	21 juillet 2023	75,00	USD	(46 292)	(26 177)
(176)	Prudential Financial Inc., (option d'achat) – 87,50	100	21 juillet 2023	87,50	USD	(53 093)	(18 956)
(356)	Financière Sun Life Inc., (option d'achat) – 68,00	100	21 juillet 2023	68,00	CAD	(26 700)	(4 849)
(432)	Unum Group, (option d'achat) – 47,50	100	21 juillet 2023	47,50	USD	(29 085)	(2 736)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(335 654)</b>	<b>(407 170)</b>

\*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 Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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	312	(2)	-	310
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>312</b>	<b>(2)</b>	<b>-</b>	<b>310</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(2)	2	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(2)</b>	<b>2</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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	138	(26)	-	112
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>138</b>	<b>(26)</b>	<b>-</b>	<b>112</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(26)	26	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(26)</b>	<b>26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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	92
Paiements indirects <sup>†</sup>	26	40

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	9 975 890	12 675 890
Parts rachetables émises	500 000	2 000 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 000 000)	(650 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	9 475 890	14 025 890

<sup>†</sup> 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 Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires couvertes	0,750	0,12

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	13 682
Garanties (hors trésorerie)	-	14 438

## 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	6
Charges	-	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	1	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>35,7</b>	<b>37,2</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes 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 (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - É.-U.	73,8
Actions - Canada	26,4
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Contrat(s) de change à terme	0,1
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,6</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,6)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,6)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis et au Canada.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent 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 8 879 000 \$ (9 988 000 \$ 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	59 590	(57 858)	1 732	1,9
<b>Total</b>	<b>59 590</b>	<b>(57 858)</b>	<b>1 732</b>	<b>1,9</b>

## 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	73 609	(74 221)	(612)	(0,6)
<b>Total</b>	<b>73 609</b>	<b>(74 221)</b>	<b>(612)</b>	<b>(0,6)</b>

~ 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 173 000 \$ (61 000 \$ 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	88 786	-	-	88 786
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	310	-	310
<b>Total</b>	<b>88 786</b>	<b>310</b>	<b>-</b>	<b>89 096</b>

Positions vendeur 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)
Option(s)	(407)	-	-	(407)
<b>Total</b>	<b>(407)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(407)</b>

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	99 883	-	-	99 883
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	112	-	112
<b>Total</b>	<b>99 883</b>	<b>112</b>	<b>-</b>	<b>99 995</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions vendeur 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)
Option(s)	(629)	-	-	(629)
<b>Total</b>	<b>(629)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(629)</b>

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 1000 É.-U. 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	76 890	2 700
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	261	14
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	2	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	4	-
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	77 157	2 714
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	5	-
Comptes créditeurs et charges à payer	23	18
	28	18
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	77 129	2 696

## 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 ordinaires non couvertes	77 129	2 696	20,57	17,98	3 750 000

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

# FNB Indice 1000 É.-U. 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	176	2
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	13
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	1
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	58	1
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 263	(695)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 497</b>	<b>(678)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	3	1
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>3</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 500</b>	<b>(677)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	6	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	7
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	1	-
Taxe de vente harmonisée	1	1
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>12</b>	<b>11</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 488</b>	<b>(688)</b>

## 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 ordinaires						
non couvertes	1 488	(688)	3,38	(4,59)	440 055	150 000

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

# FNB Indice 1000 É.-U. 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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 696	3 235
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 488	(688)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(1)	(4)
Profits nets réalisés	(2)	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(3)	(4)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	72 948	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	72 948	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	74 433	(692)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	77 129	2 543

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

# FNB Indice 1000 É.-U. 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 488	(688)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(58)	(1)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	7
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 263)	695
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	263	36
Achat de placements et de dérivés	(743)	(43)
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)	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	4	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	2	7
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(307)</b>	<b>13</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4)	(4)
Produit de l'émission de parts rachetables	558	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>554</b>	<b>(4)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	247	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	14	13
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>261</b>	<b>22</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	172	15
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 1000 É.-U. 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
<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>					
	3 426 252	FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	69 722 511	70 546 529	91,5
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	177	A. O. Smith Corp.	16 539	17 046	
USD	45	Acuity Brands Inc.	9 827	9 711	
USD	97	Advanced Drainage Systems Inc.	14 096	14 604	
USD	196	AECOM	22 025	21 965	
USD	88	AGCO Corp.	15 202	15 303	
USD	146	Air Lease Corp.	7 958	8 085	
USD	180	Alaska Air Group Inc.	11 934	12 667	
USD	124	Allegion PLC	19 363	19 693	
USD	910	American Airlines Group Inc.	19 817	21 603	
USD	54	Applied Industrial Technologies Inc.	9 757	10 349	
USD	67	ASGN Inc.	6 524	6 705	
USD	184	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	25 847	27 172	
USD	191	Builders FirstSource Inc.	29 928	34 374	
USD	129	BWX Technologies Inc.	11 713	12 217	
USD	162	C.H. Robinson Worldwide Inc.	20 304	20 225	
USD	33	CACI International Inc., catégorie A	14 163	14 884	
USD	68	CBIZ Inc.	4 779	4 794	
USD	60	Chart Industries Inc.	11 635	12 687	
USD	601	Clarivate Analytics PLC	7 355	7 579	
USD	71	Clean Harbors Inc.	14 343	15 448	
USD	61	Concentrix Corp.	6 908	6 518	
USD	102	Core & Main Inc., catégorie A	3 822	4 230	
USD	54	Curtiss-Wright Corp.	12 311	13 124	
USD	170	Donaldson Co., Inc.	13 940	14 062	
USD	312	Dun & Bradstreet Holdings Inc.	4 855	4 777	
USD	66	EMCOR Group Inc.	15 029	16 138	
USD	45	Exlservice Holdings Inc.	9 069	8 995	
USD	71	Exponent Inc.	9 344	8 767	
USD	185	Flowserve Corp.	8 898	9 094	
USD	180	Fortune Brands Home & Security Inc.	16 220	17 137	
USD	47	FTI Consulting Inc.	11 710	11 829	
USD	49	GATX Corp.	7 983	8 347	
USD	86	Generac Holdings Inc.	13 876	16 971	
USD	239	Genpact Ltd.	12 462	11 882	
USD	235	Graco Inc.	26 369	26 852	
USD	165	GXO Logistics Inc.	13 325	13 716	
USD	197	Hertz Global Holdings Inc.	4 607	4 794	
USD	119	Hexcel Corp.	11 227	11 971	
USD	76	Hubbell Inc.	31 375	33 345	
USD	55	Huntington Ingalls Industries Inc.	15 852	16 564	
USD	50	Insperty Inc.	7 819	7 871	
USD	116	ITT Inc.	13 620	14 307	
USD	191	KBR Inc.	16 179	16 443	
USD	212	Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	15 309	15 586	
USD	50	Landstar System Inc.	12 289	12 739	
USD	193	Leidos Holdings Inc.	21 803	22 597	
USD	80	Lincoln Electric Holdings Inc.	20 192	21 027	
USD	446	Lyft Inc., catégorie A	6 115	5 660	
USD	71	ManpowerGroup Inc.	7 337	7 460	
USD	318	Masco Corp.	23 355	24 145	
USD	86	MasTec Inc.	12 428	13 425	
USD	85	Maximus Inc.	9 481	9 505	
USD	276	MDU Resources Group Inc.	7 903	7 648	
USD	72	Middleby Corp. (The)	13 812	14 084	

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 1000 É.-U. 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
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>					
USD	52	MSA Safety Inc.	11 045	11 970	
USD	65	MSC Industrial Direct Co., Inc., catégorie A	8 290	8 195	
USD	228	nVent Electric PLC	14 088	15 589	
USD	92	Oshkosh Corp.	10 238	10 541	
USD	127	Owens Corning	20 225	21 931	
USD	57	Parsons Corp.	3 559	3 631	
USD	59	Paylocity Holding Corp.	14 336	14 407	
USD	232	Pentair PLC	18 785	19 831	
USD	746	Plug Power Inc.	10 783	10 256	
USD	40	RBC Bearings Inc.	11 202	11 511	
USD	93	Regal Rexnord Corp.	18 381	18 939	
USD	148	Robert Half International Inc.	14 454	14 731	
USD	37	Saia Inc.	15 180	16 764	
USD	76	Science Applications International Corp.	10 742	11 312	
USD	214	Sensata Technologies Holding PLC	12 883	12 739	
USD	63	SiteOne Landscape Supply Inc.	13 200	13 952	
USD	74	Snap-On Inc.	26 510	28 220	
USD	130	Stericycle Inc.	7 979	7 989	
USD	295	Sunrun Inc.	7 821	6 972	
USD	75	Tetra Tech Inc.	15 826	16 250	
USD	289	Textron Inc.	25 470	25 863	
USD	92	Timken Co. (The)	10 216	11 143	
USD	147	Toro Co. (The)	19 147	19 773	
USD	153	Trex Co., Inc.	12 209	13 273	
USD	79	TriNet Group Inc.	9 941	9 928	
USD	85	UFP Industries Inc.	10 086	10 916	
USD	153	U-Haul Holding Co.	10 129	10 326	
USD	221	Univar Solutions Inc.	10 417	10 481	
USD	30	Valmont Industries Inc.	11 610	11 554	
USD	435	Vertiv Holdings Co.	12 753	14 258	
USD	47	Watsco Inc.	22 327	23 725	
USD	62	WESCO International Inc.	13 451	14 690	
USD	285	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	17 457	18 023	
USD	78	Woodward Governor Co.	11 753	12 273	
USD	160	XPO Logistics Inc.	11 074	12 491	
			<b>1 203 500</b>	<b>1 253 168</b>	<b>1,6</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	1 149	ADT Inc.	9 719	9 168	
USD	83	Advance Auto Parts Inc.	8 399	7 721	
USD	366	Aramark	19 446	20 850	
USD	31	Asbury Automotive Group Inc.	9 197	9 862	
USD	122	Autoliv Inc.	14 167	13 729	
USD	40	AutoNation Inc.	7 746	8 713	
USD	322	Bath & Body Works Inc.	16 684	15 978	
USD	329	BorgWarner Inc.	20 854	21 293	
USD	108	Boyd Gaming Corp.	9 605	9 914	
USD	81	Bright Horizons Family Solutions Inc.	10 037	9 909	
USD	99	Brunswick Corp.	11 188	11 350	
USD	92	Burlington Stores Inc.	18 949	19 161	
USD	291	Caesars Entertainment Inc.	18 601	19 627	
USD	174	Capri Holdings Ltd.	8 768	8 264	
USD	223	CarMax Inc.	23 275	24 699	
USD	44	Choice Hotels International Inc.	6 630	6 842	
USD	95	Churchill Downs Inc.	16 814	17 495	
USD	51	Columbia Sportswear Co.	5 203	5 213	
USD	84	Crocs Inc.	12 193	12 498	

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 1000 É.-U. 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)</b>					
USD	37	Deckers Outdoor Corp.	24 690	25 834	
USD	50	Domino's Pizza Inc.	21 549	22 296	
USD	537	DraftKings Inc., catégorie A	17 040	18 880	
USD	57	Dutch Bros Inc., catégorie A	2 134	2 146	
USD	77	Five Below Inc.	19 633	20 026	
USD	148	Floor & Decor Holdings Inc., catégorie A	18 876	20 360	
USD	60	Fox Factory Holding Corp.	7 813	8 615	
USD	364	GameStop Corp., catégorie A	12 030	11 680	
USD	293	The Gap Inc.	3 967	3 462	
USD	330	Gentex Corp.	12 304	12 777	
USD	5	Graham Holdings Co., catégorie B	3 735	3 781	
USD	214	H&R Block Inc.	9 288	9 025	
USD	206	Harley-Davidson Inc.	9 372	9 598	
USD	181	Hasbro Inc.	14 992	15 513	
USD	65	Hyatt Hotels Corp., catégorie A	9 563	9 855	
USD	23	Jack in the Box Inc.	2 744	2 968	
USD	149	Kohl's Corp.	4 465	4 545	
USD	83	Lear Corp.	15 503	15 766	
USD	185	Leggett & Platt Inc.	7 738	7 251	
USD	120	Levi Strauss & Co., catégorie A	2 426	2 291	
USD	128	Light & Wonder Inc.	11 019	11 646	
USD	38	Lithia Motors Inc., catégorie A	13 693	15 292	
USD	358	LKQ Corp.	25 644	27 604	
USD	382	Macy's Inc.	8 152	8 113	
USD	48	Marriott Vacations Worldwide Corp.	7 984	7 795	
USD	498	Mattel Inc.	12 132	12 876	
USD	74	Mohawk Industries Inc.	10 218	10 101	
USD	28	Murphy USA Inc.	10 678	11 527	
USD	583	Newell Brands Inc.	6 988	6 712	
USD	590	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	14 771	16 996	
USD	214	Penn National Gaming Inc.	7 558	6 805	
USD	29	Penske Automotive Group Inc.	5 896	6 394	
USD	117	Planet Fitness Inc., catégorie A	10 898	10 441	
USD	76	Polaris Inc.	12 043	12 162	
USD	298	PulteGroup Inc.	28 487	30 631	
USD	88	PVH Corp.	9 960	9 894	
USD	57	Ralph Lauren Corp.	9 098	9 300	
USD	26	RH	10 465	11 339	
USD	312	Royal Caribbean Cruises Ltd.	37 948	42 830	
USD	210	Service Corp. International	18 307	17 948	
USD	187	Skechers USA Inc., catégorie A	12 774	13 031	
USD	333	Tapestry Inc.	19 097	18 859	
USD	236	Tempur Sealy International Inc.	12 020	12 513	
USD	94	Texas Roadhouse Inc., catégorie A	13 566	13 966	
USD	72	Thor Industries Inc.	9 075	9 861	
USD	155	Toll Brothers Inc.	14 886	16 218	
USD	45	TopBuild Corp.	14 340	15 840	
USD	106	Travel + Leisure Co.	5 644	5 658	
USD	266	Under Armour Inc., catégorie A	2 985	2 541	
USD	256	Under Armour Inc., catégorie C	2 624	2 273	
USD	520	VF Corp.	13 536	13 136	
USD	56	Vail Resorts Inc.	18 365	18 656	
USD	39	Visteon Corp.	7 629	7 411	
USD	108	Wayfair Inc., catégorie A	7 900	9 291	
USD	276	Wendy's Co. (The)	8 112	7 943	
USD	75	Whirlpool Corp.	14 653	14 766	

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 1000 É.-U. 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)</b>					
USD	92	Williams-Sonoma Inc.	15 245	15 234	
USD	119	Wyndham Hotels & Resorts Inc.	10 777	10 798	
USD	136	Wynn Resorts Ltd.	18 651	19 006	
			<b>961 155</b>	<b>992 362</b>	<b>1,3</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	50	Affiliated Managers Group Inc.	9 745	9 917	
USD	806	AGNC Investment Corp.	10 997	10 804	
USD	382	Ally Financial Inc.	14 759	13 653	
USD	111	American Financial Group Inc.	17 165	17 442	
USD	693	Annaly Capital Management Inc.	19 049	18 349	
USD	74	Assurant Inc.	12 878	12 311	
USD	109	Axis Capital Holdings Ltd.	7 883	7 764	
USD	166	Bank OZK	8 663	8 822	
USD	40	BOK Financial Corp.	4 394	4 276	
USD	286	Carlyle Group Inc. (The)	11 943	12 091	
USD	149	CBOE Global Markets, Inc.	26 852	27 211	
USD	36	CNA Financial Corp.	1 855	1 840	
USD	207	Coinbase Global Inc., catégorie A	15 527	19 599	
USD	184	Comerica Inc.	10 487	10 314	
USD	171	Commerce Bancshares Inc.	11 194	11 020	
USD	114	Corebridge Financial Inc.	2 525	2 664	
USD	11	Credit Acceptance Corp.	7 064	7 393	
USD	84	Cullen/Frost Bankers Inc.	12 129	11 952	
USD	192	DLocal Ltd. of Uruguay	3 384	3 101	
USD	198	East West Bancorp Inc.	14 062	13 831	
USD	509	Equitable Holdings Inc.	17 813	18 293	
USD	36	Erie Indemnity Co., catégorie A	10 035	10 004	
USD	148	Essent Group Ltd.	8 821	9 165	
USD	67	Euronet Worldwide Inc.	9 998	10 406	
USD	50	Evercore Inc., catégorie A	7 924	8 177	
USD	366	Fidelity National Financial Inc.	17 056	17 435	
USD	139	First American Financial Corp.	10 550	10 488	
USD	14	First Citizens BancShares Inc.	22 962	23 777	
USD	194	First Financial Bankshares Inc.	7 793	7 314	
USD	748	First Horizon National Corp.	11 710	11 155	
USD	156	Glacier Bancorp Inc.	7 177	6 434	
USD	134	Globe Life Inc.	18 991	19 437	
USD	50	Hanover Insurance Group Inc.	7 614	7 478	
USD	70	Houlihan Lokey Inc.	8 663	9 106	
USD	630	Invesco Ltd.	14 086	14 014	
USD	103	Jack Henry & Associates Inc.	22 139	22 806	
USD	233	Janus Henderson Group PLC	8 526	8 402	
USD	262	Jefferies Financial Group Inc.	11 246	11 500	
USD	31	Kinsale Capital Group Inc.	14 446	15 350	
USD	154	Lazard Ltd., catégorie A	6 554	6 521	
USD	237	Lincoln National Corp.	8 067	8 079	
USD	52	MarketAxess Holdings Inc.	18 747	17 988	
USD	37	Morningstar Inc.	9 484	9 600	
USD	175	Navient Corp.	4 167	4 303	
USD	946	New York Community Bancorp Inc.	13 386	14 070	
USD	409	Old National Bancorp	7 546	7 544	
USD	390	Old Republic International Corp.	12 856	12 989	
USD	169	OneMain Holdings Inc.	9 558	9 770	
USD	106	Pinnacle Financial Partners Inc.	8 122	7 946	
USD	99	Popular Inc.	8 061	7 928	
USD	52	Primerica Inc.	13 067	13 608	

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 1000 É.-U. 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
<b>SERVICES FINANCIERS (suite)</b>					
USD	124	Prosperity Bancshares Inc.	9 758	9 267	
USD	94	Reinsurance Group of America Inc.	17 637	17 251	
USD	61	RenaissanceRe Holdings Ltd.	15 179	15 056	
USD	667	Rithm Capital Corp.	8 124	8 252	
USD	57	RLI Corp.	9 891	10 293	
USD	812	Robinhood Markets Inc., catégorie A	10 622	10 723	
USD	118	Ryan Specialty Holdings Inc.	6 676	7 009	
USD	156	SEI Investments Co.	12 212	12 307	
USD	84	Selective Insurance Group Inc.	10 790	10 665	
USD	76	Shift4 Payments Inc., catégorie A	6 319	6 830	
USD	336	SLM Corp.	7 330	7 256	
USD	1 091	SoFi Technologies Inc.	12 238	12 040	
USD	106	SouthState Corp.	9 779	9 229	
USD	416	Starwood Property Trust Inc.	10 659	10 679	
USD	146	Stifel Financial Corp.	11 509	11 528	
USD	205	Synovus Financial Corp.	8 471	8 206	
USD	73	TFS Financial Corp.	1 240	1 214	
USD	449	Toast Inc., catégorie A	12 720	13 410	
USD	87	TPG Inc.	3 320	3 369	
USD	186	United Bankshares Inc.	7 735	7 303	
USD	277	Unum Group	16 427	17 484	
USD	119	UWM Holdings Corp.	899	882	
USD	605	Valley National Bancorp	6 710	6 204	
USD	136	Voya Financial Inc.	12 773	12 905	
USD	244	Webster Financial Corp.	12 574	12 189	
USD	145	Western Alliance Bancorp	7 585	6 998	
USD	526	Western Union Co. (The)	8 347	8 164	
USD	60	WEX Inc.	13 851	14 455	
USD	85	Wintrust Financial Corp.	7 888	8 168	
USD	207	Zions Bancorporation NA	8 021	7 357	
			<b>867 004</b>	<b>872 134</b>	<b>1,1</b>
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	99	Allegro Microsystems Inc.	5 251	5 913	
USD	73	Altair Engineering Inc.	7 078	7 326	
USD	106	Amkor Technology Inc.	3 680	4 173	
USD	208	AppLovin Corp., catégorie A	6 519	7 082	
USD	82	Arrow Electronics Inc.	14 701	15 541	
USD	143	Bill.com Holdings Inc.	20 730	22 111	
USD	214	Black Knight Inc.	16 362	16 914	
USD	69	BlackLine Inc.	5 099	4 914	
USD	181	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	2 568	2 685	
USD	207	Ceridian HCM Holding Inc.	18 474	18 344	
USD	208	Ciena Corp.	12 194	11 695	
USD	244	Cognex Corp.	18 050	18 087	
USD	168	Coherent Corp.	11 502	11 333	
USD	234	Confluent Inc., catégorie A	10 424	10 933	
USD	282	DocuSign Inc.	19 890	19 065	
USD	84	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	9 272	9 301	
USD	375	Dropbox Inc., catégorie A	12 825	13 234	
USD	319	DXC Technology Co.	11 642	11 279	
USD	302	Dynatrace Inc.	20 440	20 568	
USD	108	Elastic N.V.	9 757	9 163	
USD	210	Entergris Inc.	29 333	30 795	
USD	85	F5 Inc.	16 941	16 451	
USD	13	Fair Isaac Corp.	13 210	13 920	
USD	99	Five9 Inc.	10 420	10 801	

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 1000 É.-U. 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
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)</b>					
USD	635	Flex Ltd.	21 962	23 225	
USD	874	Gen Digital Inc.	21 507	21 453	
USD	109	Gitlab Inc., catégorie A	7 136	7 372	
USD	59	Globant SA	14 101	14 031	
USD	216	GoDaddy Inc., catégorie A	21 262	21 474	
USD	114	Guidewire Software Inc.	11 277	11 477	
USD	118	HashiCorp Inc., catégorie A	4 359	4 088	
USD	156	Informatica Inc., catégorie A	3 825	3 819	
USD	42	IPG Photonics Corp.	7 432	7 548	
USD	452	Juniper Networks Inc.	19 076	18 739	
USD	192	Lattice Semiconductor Corp.	22 060	24 408	
USD	35	Littelfuse Inc.	12 626	13 492	
USD	87	Manhattan Associates Inc.	21 711	23 011	
USD	13	MicroStrategy Inc., catégorie A	5 074	5 890	
USD	82	MKS Instruments Inc.	11 359	11 730	
USD	184	National Instruments Corp.	13 813	13 976	
USD	50	Novanta Inc.	11 225	12 181	
USD	324	Nutanix Inc., catégorie A	12 429	12 026	
USD	89	Paycor HCM Inc.	2 750	2 788	
USD	176	Procore Technologies Inc.	15 206	15 154	
USD	155	PTC Inc.	28 934	29 186	
USD	407	Pure Storage Inc., catégorie A	19 329	19 830	
USD	141	Qorvo Inc.	19 015	19 037	
USD	51	Qualys Inc.	8 613	8 717	
USD	149	Samsara Inc.	5 277	5 463	
USD	81	Sanmina Corp.	6 160	6 460	
USD	310	SentinelOne Inc., catégorie A	6 880	6 194	
USD	44	Silicon Laboratories Inc.	9 051	9 184	
USD	178	Smartsheet Inc., catégorie A	10 116	9 012	
USD	51	SPS Commerce Inc.	12 205	12 961	
USD	55	Synaptics Inc.	6 416	6 214	
USD	65	TD SYNNEX Corp.	8 369	8 085	
USD	153	Tenable Holdings Inc.	8 400	8 817	
USD	250	Twilio Inc.	21 533	21 046	
USD	527	UiPath Inc., catégorie A	12 097	11 555	
USD	338	Unity Software Inc.	18 309	19 420	
USD	62	Universal Display Corp.	11 716	11 825	
USD	175	Wolfspeed Inc.	12 296	12 873	
			<b>791 268</b>	<b>805 389</b>	<b>1,0</b>
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	124	10X Genomics Inc., catégorie A	9 374	9 162	
USD	126	Acadia Healthcare Co., Inc.	12 199	13 278	
USD	301	agilon health Inc.	7 255	6 906	
USD	135	Apellis Pharmaceuticals Inc.	15 523	16 274	
USD	96	Azenta Inc.	5 958	5 930	
USD	54	Bausch + Lomb Corp.	1 390	1 434	
USD	219	Bio-Techne Corp.	23 064	23 656	
USD	139	Bruker Corp.	13 872	13 596	
USD	254	Catalent Inc.	14 845	14 574	
USD	71	Charles River Laboratories International Inc.	19 510	19 753	
USD	13	CorVel Corp.	3 347	3 329	
USD	76	DaVita Inc.	9 917	10 104	
USD	302	Dentsply Sirona Inc.	16 063	15 993	
USD	152	Doximity Inc., catégorie A	6 495	6 843	
USD	691	Elanco Animal Health Inc.	9 400	9 199	
USD	138	Encompass Health Corp.	11 863	12 364	

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 1000 É.-U. 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
<b>SOINS DE SANTÉ (suite)</b>					
USD	76	Ensign Group Inc. (The)	9 421	9 600	
USD	230	Envista Holdings Corp.	10 281	10 299	
USD	250	Exact Sciences Corp.	29 888	31 064	
USD	447	Exelixis Inc.	11 264	11 303	
USD	141	Globus Medical Inc., catégorie A	10 967	11 109	
USD	190	Halozyme Therapeutics Inc.	8 869	9 069	
USD	117	HealthEquity Inc.	9 571	9 775	
USD	184	Henry Schein Inc.	18 878	19 746	
USD	40	Inspire Medical Systems Inc.	16 148	17 183	
USD	100	Integra LifeSciences Holdings	5 671	5 443	
USD	131	Intra-Cellular Therapies Inc.	10 882	10 976	
USD	197	Ionis Pharmaceuticals Inc.	10 527	10 696	
USD	87	Jazz Pharmaceuticals PLC	14 874	14 272	
USD	44	Karuna Therapeutics Inc.	13 548	12 626	
USD	93	Lantheus Holdings Inc.	10 755	10 327	
USD	68	Masimo Corp.	14 361	14 806	
USD	34	Medpace Holdings Inc.	9 949	10 805	
USD	144	Natera Inc.	9 838	9 272	
USD	134	Neurocrine Biosciences Inc.	17 096	16 721	
USD	146	Novocure Ltd.	9 660	8 018	
USD	253	Option Care Health Inc.	10 253	10 877	
USD	360	Organon & Co.	10 120	9 913	
USD	51	Penumbra Inc.	22 250	23 219	
USD	190	Perrigo Co., PLC	8 668	8 536	
USD	321	QIAGEN NV	19 786	19 127	
USD	86	QuidelOrtho Corp.	9 924	9 429	
USD	274	R1 RCM Inc.	6 347	6 689	
USD	73	Repligen Corp.	15 421	13 665	
USD	577	Roivant Sciences Ltd.	7 230	7 696	
USD	117	Sarepta Therapeutics Inc.	19 880	17 730	
USD	51	Shockwave Medical Inc.	19 225	19 261	
USD	145	Syneos Health Inc.	8 326	8 085	
USD	223	Teladoc Health Inc.	7 334	7 472	
USD	141	Tenet Healthcare Corp.	14 441	15 184	
USD	64	United Therapeutics Corp.	19 314	18 695	
USD	85	Universal Health Services Inc., catégorie B	16 660	17 745	
			<b>647 702</b>	<b>648 828</b>	<b>0,8</b>
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	125	Agree Realty Corp.	10 896	10 816	
USD	471	American Homes 4 Rent, catégorie A	22 015	22 094	
USD	382	Americold Realty Trust Inc.	16 100	16 327	
USD	210	Apartment Income REIT Corp.	10 392	10 029	
USD	221	Boston Properties Inc.	15 917	16 841	
USD	422	Brixmor Property Group Inc.	12 098	12 285	
USD	315	CubeSmart	18 632	18 615	
USD	61	EastGroup Properties Inc.	13 811	14 013	
USD	251	Equity Lifestyle Properties Inc.	22 758	22 216	
USD	114	Federal Realty Investment Trust	14 559	14 598	
USD	186	First Industrial Realty Trust Inc.	12 914	12 956	
USD	355	Gaming and Leisure Properties Inc.	23 223	22 764	
USD	532	Healthcare Realty Trust Inc.	13 796	13 277	
USD	998	Host Hotels & Resorts Inc.	22 423	22 226	
USD	408	Iron Mountain Inc.	30 211	30 676	
USD	67	Jones Lang LaSalle Inc.	13 672	13 813	
USD	163	Kilroy Realty Corp.	6 834	6 490	
USD	856	Kimco Realty Corp.	21 994	22 337	

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 1000 É.-U. 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
<b>IMMOBILIER (suite)</b>					
USD	122	Lamar Advertising Co., catégorie A	15 560	16 022	
USD	120	Life Storage Inc.	20 514	21 113	
USD	302	Macerich Co. (The)	4 488	4 504	
USD	832	Medical Properties Trust Inc.	10 389	10 195	
USD	254	National Retail Properties Inc.	14 336	14 382	
USD	119	National Storage Affiliates Trust	5 760	5 485	
USD	330	Omega Healthcare Investors Inc.	13 496	13 401	
USD	207	Rayonier Inc.	8 390	8 601	
USD	240	Regency Centers Corp.	19 336	19 617	
USD	278	Rexford Industrial Realty Inc.	19 662	19 210	
USD	199	Spirit Realty Capital Inc.	10 547	10 370	
USD	253	STAG Industrial Inc.	12 177	12 012	
USD	79	Zillow Group Inc., catégorie A	4 891	5 143	
USD	221	Zillow Group Inc., catégorie C	13 546	14 698	
			<b>475 337</b>	<b>477 126</b>	<b>0,6</b>
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	250	Alcoa Corp.	12 041	11 224	
USD	92	AptarGroup Inc.	14 286	14 105	
USD	76	Ashland Global Holdings Inc.	8 621	8 740	
USD	311	Axalta Coating Systems Ltd.	13 224	13 502	
USD	171	Berry Global Group Inc.	14 479	14 559	
USD	715	Cleveland-Cliffs Inc.	15 755	15 857	
USD	163	Commercial Metals Co.	10 337	11 358	
USD	168	Crown Holdings Inc.	19 707	19 312	
USD	50	Eagle Materials Inc.	11 239	12 334	
USD	167	Eastman Chemical Co.	18 425	18 501	
USD	429	Graphic Packaging Holding Co.	14 519	13 641	
USD	258	Huntsman Corp.	8 678	9 225	
USD	69	Knife River Corp.	4 079	3 972	
USD	252	Livent Corp.	8 847	9 147	
USD	100	Louisiana Pacific Corp.	8 505	9 922	
USD	205	MP Materials Corp.	6 143	6 207	
USD	185	Olin Corp.	12 772	12 580	
USD	125	Packaging Corp. of America	21 841	21 860	
USD	82	Reliance Steel & Aluminum Co.	27 306	29 469	
USD	93	Royal Gold Inc.	14 491	14 125	
USD	180	RPM International Inc.	20 109	21 372	
USD	202	Sealed Air Corp.	10 974	10 692	
USD	117	Silgan Holdings Inc.	7 402	7 259	
USD	137	Sonoco Products Co.	10 870	10 699	
USD	316	United States Steel Corp.	9 718	10 458	
USD	242	Valvoline Inc.	11 617	12 012	
USD	45	Westlake Corp.	6 735	7 114	
USD	359	WestRock Co.	14 212	13 810	
			<b>356 932</b>	<b>363 056</b>	<b>0,5</b>
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	457	Antero Midstream Corp.	6 643	7 015	
USD	366	Antero Resources Corp.	11 211	11 154	
USD	437	APA Corp.	19 388	19 759	
USD	278	ChampionX Corp.	10 455	11 419	
USD	159	Chesapeake Energy Corp.	17 148	17 606	
USD	58	Chord Energy Corp.	11 454	11 804	
USD	96	Civitas Resources Inc.	8 706	8 812	
USD	137	DT Midstream Inc.	8 864	8 986	
USD	338	EnLink Midstream LLC	4 635	4 741	
USD	143	Helmerich & Payne Inc.	6 585	6 708	

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 1000 É.-U. 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
<b>ÉNERGIE (suite)</b>					
USD	61	Hess Midstream LP, catégorie A	2 391	2 476	
USD	227	HF Sinclair Corp.	13 452	13 400	
USD	257	Magnolia Oil & Gas Corp., catégorie A	7 027	7 108	
USD	157	Matador Resources Co.	10 252	10 870	
USD	209	Murphy Oil Corp.	10 584	10 592	
USD	110	New Fortress Energy Inc.	4 145	3 898	
USD	149	Noble Corp., PLC	7 608	8 145	
USD	551	NOV Inc.	11 244	11 695	
USD	343	Ovintiv Inc.	16 752	17 279	
USD	163	PBF Energy Inc.	8 707	8 830	
USD	123	PDC Energy Inc.	11 494	11 579	
USD	305	Permian Resources Corp.	4 181	4 423	
USD	268	Plains GP Holdings LP, catégorie A	4 963	5 259	
USD	330	Range Resources Corp.	12 509	12 838	
USD	75	Scorpio Tankers Inc.	4 532	4 687	
USD	170	SM Energy Co.	6 549	7 115	
USD	1 382	Southwestern Energy Co.	10 271	10 991	
USD	86	Viper Energy Partners LP	2 879	3 053	
			<b>254 629</b>	<b>262 242</b>	<b>0,4</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	731	AMC Entertainment Holdings Inc., catégorie A	4 584	4 256	
USD	6	Cable One Inc.	5 065	5 217	
USD	350	DISH Network Corp., catégorie A	3 189	3 052	
USD	163	Endeavor Group Holdings Inc., catégorie A	4 834	5 159	
USD	310	Frontier Communications Parent Inc.	7 336	7 646	
USD	110	IAC/InterActive Corp.	9 371	9 141	
USD	542	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	28 453	27 670	
USD	159	Iridium Communications Inc.	12 589	13 070	
USD	23	Liberty Broadband Corp., catégorie A	2 175	2 427	
USD	163	Liberty Broadband Corp., catégorie C	16 544	17 279	
USD	33	Liberty Media Corp. - Liberty Formula One, catégorie A	2 915	2 953	
USD	281	Liberty Media Corp., - Liberty Formula One, catégorie C	28 302	27 992	
USD	104	Liberty Media Corp., - Liberty SiriusXM, catégorie A	4 279	4 515	
USD	215	Liberty Media Corp. - Liberty SiriusXM, catégorie C	8 896	9 312	
USD	394	Match Group Inc.	21 356	21 819	
USD	229	New York Times Co., (The), catégorie A	11 456	11 933	
USD	537	News Corp., catégorie A	13 927	13 856	
USD	150	News Corp., catégorie B	3 929	3 914	
USD	49	Nexstar Media Group Inc.	10 594	10 799	
USD	66	Playtika Holding Corp.	1 033	1 013	
USD	173	Roku Inc.	15 607	14 642	
USD	60	World Wrestling Entertainment Inc., catégorie A	8 168	8 612	
USD	66	Ziff Davis Inc.	6 016	6 119	
USD	791	ZoomInfo Technologies Inc.	26 579	26 575	
			<b>257 197</b>	<b>258 971</b>	<b>0,4</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	188	BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	15 284	15 675	
USD	13	Boston Beer Co., Inc. (The), catégorie A	6 071	5 306	
USD	210	Bunge Ltd.	26 268	26 218	
USD	53	Casey's General Stores Inc.	15 386	17 104	
USD	59	Celsius Holdings Inc.	11 166	11 648	
USD	7	Coca-Cola Consolidated Inc.	5 891	5 891	
USD	482	Coty Inc., catégorie A	7 742	7 839	
USD	223	Darling Ingredients Inc.	19 203	18 823	
USD	277	Flowers Foods Inc.	9 151	9 120	
USD	90	Ingredion Inc.	12 598	12 618	

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 1000 É.-U. 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)</b>					
USD	26	Inter Parfums Inc.	4 660	4 653	
USD	202	Lamb Weston Holdings Inc.	29 961	30 727	
USD	27	Lancaster Colony Corp.	6 851	7 184	
USD	246	Molson Coors Beverage Co.	21 183	21 432	
USD	214	Performance Food Group Co.	15 839	17 058	
USD	56	Pilgrim's Pride Corp.	1 590	1 592	
USD	75	Post Holdings Inc.	8 569	8 599	
USD	77	Reynolds Consumer Products Inc.	2 870	2 878	
USD	309	US Foods Holding Corp.	16 859	17 991	
			<b>237 142</b>	<b>242 356</b>	<b>0,3</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	243	Brookfield Renewable Corp., catégorie A	10 683	10 135	
USD	46	Clearway Energy Inc.	1 732	1 644	
USD	114	Clearway Energy Inc., catégorie C	4 539	4 308	
USD	373	Essential Utilities Inc.	20 332	19 699	
USD	71	IDACORP Inc.	9 882	9 639	
USD	124	National Fuel Gas Co.	8 462	8 427	
USD	121	NextEra Energy Partners LP	9 976	9 389	
USD	582	NISource Inc.	20 956	21 063	
USD	317	NRG Energy Inc.	14 397	15 684	
USD	282	OGE Energy Corp.	13 649	13 400	
USD	160	Pinnacle West Capital Corp.	17 420	17 247	
USD	99	Southwest Gas Corp.	8 343	8 338	
USD	295	UGI Corp.	11 112	10 528	
USD	519	Vistra Corp.	16 941	18 028	
			<b>168 424</b>	<b>167 529</b>	<b>0,2</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>75 942 801</b>	<b>76 889 690</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(11 945)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>75 930 856</b>	<b>76 889 690</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				239 432	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>2 696 390</b>	<b>100,00</b>

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 1000 É.-U. 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 500 É.-U. CI	139 015	70 547	50,8

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 500 É.-U. CI	124 865	2 465	2,0

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

# FNB Indice 1000 É.-U. 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	150 000	150 000
Parts rachetables émises	3 600 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>3 750 000</b>	<b>150 000</b>

<sup>†</sup> 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 1000 É.-U. 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 ordinaires non couvertes	0,160

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	15
Garanties (hors trésorerie)	-	16

## 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	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	70 547

Placements	2022
FNB Indice 500 É.-U. CI	2 307

# FNB Indice 1000 É.-U. 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	91,5
Actions - Produits industriels	1,6
Actions - Technologies de l'information	1,2
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	1,2
Actions - Services financiers	1,1
Actions - Soins de santé	1,0
Actions - Immobilier	0,7
Actions - Matériaux	0,6
Actions - Énergie	0,4
Actions - Biens de consommation de base	0,3
Actions - Services publics	0,3
Actions - Services de communication	0,3
Autres actifs (passifs) nets	(0,2)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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 Solactive GBS United States 1000	7 358 932

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 1000	267 532

### 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	6 349	-	6 349	8,2
<b>Total</b>	<b>6 349</b>	<b>-</b>	<b>6 349</b>	<b>8,2</b>

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	238	-	238	8,8
<b>Total</b>	<b>238</b>	<b>-</b>	<b>238</b>	<b>8,8</b>

~ 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 635 000 \$ (24 000 \$ 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	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	6 343	-	-	6 343
Fonds négocié(s) en bourse	70 547	-	-	70 547
<b>Total</b>	<b>76 890</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>76 890</b>

# FNB Indice 1000 É.-U. 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	235	-	-	235
Fonds négocié(s) en bourse	2 465	-	-	2 465
<b>Total</b>	<b>2 700</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 700</b>

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 500 É.-U. 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	138 873	124 086
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	98	716
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	2	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	75	91
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	139 048	124 893
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
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	9	9
Comptes créditeurs et charges à payer	24	19
	33	28
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	139 015	124 865

## 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 ordinaires non couvertes	139 015	124 865	20,59	18,10	6 750 000

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

# FNB Indice 500 É.-U. 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 075	50
Intérêts aux fins des distributions	5	-
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	1 952	(22)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	15 509	(1 287)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>18 541</b>	<b>(1 259)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	-
Rabais sur frais	3	1
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>3</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>18 544</b>	<b>(1 258)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	52	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	7
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	158	6
Taxe de vente harmonisée	5	1
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>220</b>	<b>17</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>18 324</b>	<b>(1 275)</b>

## 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 ordinaires						
non couvertes	18 324	(1 275)	2,70	(4,25)	6 778 177	300 000

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

# FNB Indice 500 É.-U. 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 ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	124 865	6 405
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 324	(1 275)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(657)	(31)
Profits nets réalisés	(235)	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(892)	(31)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	37 500	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(40 782)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(3 282)	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	14 150	(1 306)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	139 015	5 099

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

# FNB Indice 500 É.-U. 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 324	(1 275)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 952)	22
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	7
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(15 509)	1 287
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 811	138
Achat de placements et de dérivés	(3 412)	(155)
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	16	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	7
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>285</b>	<b>31</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(892)	(31)
Produit de l'émission de parts rachetables	489	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(500)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(903)</b>	<b>(31)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(618)	-
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	716	5
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>98</b>	<b>5</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	933	43
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	5	-
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 500 É.-U. 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
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	1 845	Accenture PLC, catégorie A	700 362	753 366	
USD	1 270	Adobe Inc.	607 887	821 761	
USD	4 456	Advanced Micro Devices Inc.	474 997	671 659	
USD	429	Akamai Technologies Inc.	51 045	51 017	
USD	336	Amdocs Ltd.	40 155	43 950	
USD	1 622	Amphenol Corp., catégorie A	162 984	182 329	
USD	1 405	Analog Devices Inc.	307 347	362 184	
USD	242	ANSYS Inc.	83 495	105 761	
USD	41 517	Apple Inc.	8 415 425	10 656 201	
USD	2 349	Applied Materials Inc.	321 874	449 276	
USD	655	Arista Networks Inc.	110 685	140 462	
USD	78	Aspen Technology Inc.	23 826	17 300	
USD	417	Atlassian Corp.	93 910	92 597	
USD	598	Autodesk Inc.	160 759	161 909	
USD	597	Bentley Systems Inc., catégorie B	30 689	42 841	
USD	1 136	Broadcom Inc.	825 380	1 303 931	
USD	751	Cadence Design Systems Inc.	173 541	233 057	
USD	377	CDW Corp. of Delaware	89 784	91 542	
USD	11 414	Cisco Systems Inc.	712 070	781 459	
USD	782	CloudFlare Inc., catégorie A	56 875	67 644	
USD	1 420	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	118 077	122 662	
USD	2 357	Corning Inc.	104 612	109 286	
USD	598	CrowdStrike Holdings Inc., catégorie A	121 584	116 219	
USD	793	Datadog Inc., catégorie A	89 146	103 234	
USD	698	Dell Technologies Inc., catégorie C	40 898	49 978	
USD	369	Enphase Energy Inc.	128 647	81 777	
USD	155	EPAM Systems Inc.	71 631	46 097	
USD	68	Fair Isaac Corp.	67 409	72 814	
USD	278	First Solar Inc.	61 955	69 927	
USD	1 884	Fortinet Inc.	141 333	188 446	
USD	213	Gartner Inc.	89 162	98 736	
USD	208	GlobalFoundries Inc.	16 327	17 775	
USD	3 604	Hewlett Packard Enterprise Co.	70 746	80 119	
USD	2 746	HP Inc.	106 657	111 589	
USD	131	HubSpot Inc.	58 137	92 236	
USD	11 525	Intel Corp.	481 227	509 975	
USD	2 527	International Business Machines Corp.	459 702	447 441	
USD	760	Intuit Inc.	419 879	460 788	
USD	354	Jabil Inc.	37 471	50 558	
USD	496	Keysight Technologies Inc.	109 135	109 903	
USD	385	KLA Corp.	185 305	247 094	
USD	375	Lam Research Corp.	225 626	318 999	
USD	2 381	Marvell Technology Inc.	142 368	188 346	
USD	1 496	Microchip Technology Inc.	142 461	177 351	
USD	3 037	Micron Technology Inc.	234 442	253 621	
USD	20 453	Microsoft Corp.	7 078 824	9 216 521	
USD	188	MongoDB Inc.	55 075	102 242	
USD	125	Monolithic Power Systems Inc.	67 933	89 357	
USD	464	Motorola Solutions Inc.	157 254	180 070	
USD	597	NetApp Inc.	55 048	60 354	
USD	6 609	NVIDIA Corp.	1 616 243	3 699 462	
USD	417	Okta Inc.	39 602	38 267	
USD	1 201	ON Semiconductor Corp.	111 688	150 309	
USD	4 308	Oracle Corp.	467 747	678 880	
USD	4 922	Palantir Technologies Inc.	58 025	99 845	
USD	830	Palo Alto Networks Inc.	192 295	280 626	

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 500 É.-U. 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
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)</b>					
USD	3 103	QUALCOMM Inc.	514 223	488 784	
USD	295	Roper Technologies Inc.	165 366	187 684	
USD	2 697	Salesforce Inc.	601 197	753 946	
USD	533	Seagate Technology Holdings PLC	43 736	43 636	
USD	565	ServiceNow Inc.	327 192	420 149	
USD	443	Skyworks Solutions Inc.	59 153	64 886	
USD	761	Snowflake Inc., catégorie A	162 262	177 211	
USD	155	SolarEdge Technologies Inc.	59 146	55 183	
USD	424	Splunk Inc.	50 289	59 523	
USD	422	Synopsys Inc.	188 114	243 138	
USD	880	TE Connectivity Ltd.	145 479	163 211	
USD	129	Teledyne Technologies Inc.	68 818	70 176	
USD	434	Teradyne Inc.	53 180	63 936	
USD	2 517	Texas Instruments Inc.	569 753	599 578	
USD	686	Trimble Inc.	52 517	48 056	
USD	115	Tyler Technologies Inc.	53 947	63 376	
USD	11	Ubiquiti Inc.	4 323	2 558	
USD	255	VeriSign Inc.	66 673	76 249	
USD	604	VMware Inc., catégorie A	95 496	114 843	
USD	889	Western Digital Corp.	45 960	44 620	
USD	565	Workday Inc., catégorie A	123 458	168 884	
USD	142	Zebra Technologies Corp., catégorie A	55 345	55 587	
USD	596	Zoom Video Communications Inc.	68 969	53 534	
USD	241	Zscaler Inc.	46 924	46 655	
			<b>30 688 281</b>	<b>39 816 553</b>	<b>28,5</b>
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	4 819	Abbott Laboratories	685 171	695 192	
USD	4 927	AbbVie Inc.	991 147	878 393	
USD	823	Agilent Technologies Inc.	153 267	130 956	
USD	200	Align Technology Inc.	68 535	93 591	
USD	345	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	93 113	86 712	
USD	468	AmerisourceBergen Corp.	97 608	119 168	
USD	1 484	Amgen Inc.	505 858	435 981	
USD	1 816	Avantor Inc.	55 527	49 358	
USD	1 408	Baxter International Inc.	103 194	84 884	
USD	789	Becton, Dickinson and Co.	256 964	275 638	
USD	400	Biogen Inc.	143 642	150 771	
USD	512	BioMarin Pharmaceutical Inc.	64 239	58 726	
USD	58	Bio-Rad Laboratories Inc., catégorie A	34 696	29 097	
USD	3 972	Boston Scientific Corp.	233 900	284 294	
USD	5 844	Bristol-Myers Squibb Co.	573 843	494 530	
USD	718	Cardinal Health Inc.	75 474	89 850	
USD	1 535	Centene Corp.	163 656	137 004	
USD	41	Chemed Corp.	29 993	29 387	
USD	823	Cigna Corp.	320 283	305 583	
USD	137	Cooper Cos. Inc. (The)	58 896	69 510	
USD	3 574	CVS Health Corp.	442 457	326 936	
USD	1 810	Danaher Corp.	635 601	574 820	
USD	1 073	DexCom Inc.	150 230	182 465	
USD	1 683	Edwards Lifesciences Corp.	191 868	210 076	
USD	660	Elevance Health Inc.	425 441	388 018	
USD	2 358	Eli Lilly and Co.	1 103 071	1 463 322	
USD	1 015	GE HealthCare Technologies Inc.	73 711	109 113	
USD	3 470	Gilead Sciences Inc.	351 138	353 881	
USD	579	HCA Healthcare Inc.	177 022	232 515	
USD	683	Hologic Inc.	67 181	73 179	

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 500 É.-U. 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
<b>SOINS DE SANTÉ (suite)</b>					
USD	632	Horizon Therapeutics PLC	70 258	86 013	
USD	347	Humana Inc.	233 453	205 308	
USD	229	IDEXX Laboratories Inc.	126 205	152 188	
USD	440	illumina Inc.	127 531	109 162	
USD	520	Incyte Corp.	51 423	42 834	
USD	193	Insulet Corp.	71 184	73 638	
USD	970	Intuitive Surgical Inc.	317 908	438 898	
USD	505	IQVIA Holdings Inc.	141 210	150 201	
USD	7 252	Johnson & Johnson	1 651 654	1 588 365	
USD	246	Laboratory Corp. of America Holdings	77 163	78 558	
USD	381	McKesson Corp.	183 246	215 432	
USD	3 707	Medtronic PLC	419 892	432 156	
USD	7 071	Merck & Co., Inc.	955 310	1 079 670	
USD	61	Mettler-Toledo International Inc.	110 719	105 873	
USD	922	Moderna Inc.	200 862	148 234	
USD	160	Molina Healthcare Inc.	67 805	63 779	
USD	15 653	Pfizer Inc.	972 667	759 747	
USD	308	Quest Diagnostics Inc.	57 319	57 287	
USD	287	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	275 244	272 882	
USD	404	ResMed Inc.	121 423	116 809	
USD	351	Revvity Inc.	63 217	55 173	
USD	1 037	Royalty Pharma PLC, catégorie A	56 412	42 182	
USD	385	Seagen Inc.	77 256	98 049	
USD	276	STERIS PLC	70 386	82 167	
USD	879	Stryker Corp.	277 034	354 861	
USD	131	Teleflex Inc.	41 642	41 955	
USD	1 073	Thermo Fisher Scientific Inc.	782 574	740 805	
USD	2 590	UnitedHealth Group Inc.	1 771 871	1 647 258	
USD	402	Veeva Systems Inc., catégorie A	100 105	105 182	
USD	716	Vertex Pharmaceuticals Inc.	290 182	333 416	
USD	3 349	Viatris Inc.	46 846	44 227	
USD	163	Waters Corp.	69 165	57 490	
USD	205	West Pharmaceutical Services Inc.	76 764	103 751	
USD	586	Zimmer Biomet Holdings Inc.	93 423	112 902	
USD	1 292	Zoetis Inc.	276 521	294 417	
			<b>18 652 600</b>	<b>18 703 819</b>	<b>13,5</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	1 547	Aflac Inc.	134 191	142 885	
USD	722	Allstate Corp. (The)	124 124	104 175	
USD	1 649	American Express Co.	338 154	380 111	
USD	2 052	American International Group Inc.	153 498	156 239	
USD	293	Ameriprise Financial Inc.	116 244	128 783	
USD	565	Aon PLC	225 667	258 084	
USD	1 135	Apollo Global Management Inc.	92 134	115 360	
USD	992	Arch Capital Group Ltd.	73 742	98 252	
USD	394	Ares Management Corp., catégorie A	39 679	50 233	
USD	584	Arthur J. Gallagher & Co.	146 935	169 679	
USD	19 412	Bank of America Corp.	878 474	736 958	
USD	2 173	Bank of New York Mellon Corp. (The)	128 104	128 014	
USD	3 603	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	1 450 085	1 625 775	
USD	414	BlackRock Inc.	373 472	378 624	
USD	1 957	Blackstone Inc.	235 651	240 755	
USD	1 499	Block Inc.	138 590	132 045	
USD	1 194	Blue Owl Capital Inc.	17 436	18 407	
USD	662	Brown & Brown Inc.	53 348	60 303	
USD	1 050	Capital One Financial Corp.	145 452	151 960	

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 500 É.-U. 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
<b>SERVICES FINANCIERS (suite)</b>					
USD	3 895	The Charles Schwab Corp.	371 251	292 132	
USD	1 148	Chubb Ltd.	309 651	292 516	
USD	429	Cincinnati Financial Corp.	61 334	55 246	
USD	5 261	Citigroup Inc.	337 398	320 513	
USD	1 346	Citizens Financial Group Inc.	67 108	46 451	
USD	1 000	CME Group Inc.	246 805	245 185	
USD	728	Discover Financial Services	101 283	112 565	
USD	108	Everest Re Group Ltd.	55 193	48 856	
USD	107	FactSet Research Systems Inc.	61 309	56 727	
USD	1 648	Fidelity National Information Services Inc.	163 741	119 285	
USD	1 892	Fifth Third Bancorp	84 860	65 619	
USD	1 732	Fiserv Inc.	243 013	289 119	
USD	199	FleetCor Technologies Inc.	53 714	66 116	
USD	792	Franklin Resources Inc.	27 478	27 992	
USD	729	Global Payments Inc.	108 058	95 037	
USD	930	Goldman Sachs Group Inc. (The)	428 272	396 925	
USD	870	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	81 845	82 911	
USD	4 009	Huntington Bancshares Inc.	72 792	57 187	
USD	274	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	26 715	30 119	
USD	1 542	Intercontinental Exchange Inc.	212 270	230 734	
USD	8 139	JPMorgan Chase & Co.	1 389 737	1 566 379	
USD	2 571	KeyCorp	58 015	31 435	
USD	1 821	KKR & Co., Inc.	123 593	134 940	
USD	535	Loews Corp.	40 593	42 037	
USD	217	LPL Financial Holdings Inc.	64 776	62 434	
USD	466	M&T Bank Corp.	101 162	76 315	
USD	37	Markel Corp.	63 069	67 721	
USD	1 375	Marsh & McLennan Cos., Inc.	303 431	342 206	
USD	2 350	Mastercard Inc., catégorie A	1 069 209	1 223 020	
USD	1 818	MetLife Inc.	159 459	135 992	
USD	441	Moody's Corp.	171 933	202 913	
USD	3 634	Morgan Stanley	420 653	410 662	
USD	216	MSCI Inc.	138 739	134 133	
USD	952	Nasdaq Inc.	76 829	62 798	
USD	578	Northern Trust Corp.	70 126	56 705	
USD	3 149	Paypal Holdings Inc.	362 834	278 058	
USD	1 112	PNC Financial Services Group Inc.	231 307	185 330	
USD	676	Principal Financial Group Inc.	71 963	67 840	
USD	1 626	Progressive Corp. (The)	276 884	284 808	
USD	1 019	Prudential Financial Inc.	132 769	118 955	
USD	544	Raymond James Financial Inc.	77 050	74 699	
USD	2 603	Regions Financial Corp.	72 987	61 380	
USD	286	Rocket Cos. Inc., catégorie A	3 192	3 391	
USD	896	S&P Global Inc.	419 333	475 308	
USD	957	State Street Corp.	92 978	92 672	
USD	1 212	Synchrony Financial	54 787	54 400	
USD	615	T. Rowe Price Group Inc.	97 435	91 162	
USD	306	Tradeweb Markets Inc., catégorie A	26 450	27 729	
USD	645	Travelers Cos., Inc. (The)	150 486	148 218	
USD	3 697	Truist Financial Corp.	217 128	148 474	
USD	4 123	U.S. Bancorp	231 089	180 258	
USD	4 535	Visa Inc., catégorie A	1 271 317	1 425 103	
USD	563	W.R. Berkley Corp.	51 225	44 372	
USD	10 509	Wells Fargo & Co.	616 386	593 510	
USD	295	Willis Towers Watson PLC	88 692	91 930	
			<b>16 776 686</b>	<b>17 005 164</b>	<b>12,2</b>

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 500 É.-U. 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	1 110	Airbnb Inc., catégorie A	161 585	188 242	
USD	25 047	Amazon.com Inc.	3 646 800	4 320 578	
USD	753	Aptiv PLC	101 030	101 723	
USD	51	AutoZone Inc.	161 662	168 266	
USD	542	Best Buy Co., Inc.	56 477	58 775	
USD	105	Booking Holdings Inc.	288 802	375 187	
USD	2 770	Carnival Corp.	37 666	69 020	
USD	268	Chewy Inc.	14 209	13 997	
USD	76	Chipotle Mexican Grill Inc.	161 887	215 113	
USD	3 039	Coupage Inc.	71 806	69 972	
USD	841	D.R. Horton Inc.	94 846	135 423	
USD	335	Darden Restaurants Inc.	62 620	74 065	
USD	166	Dick's Sporting Goods Inc.	31 305	29 037	
USD	10	Dillard's Inc., catégorie A	3 859	4 317	
USD	729	DoorDash Inc., catégorie A	60 134	73 718	
USD	1 496	eBay Inc.	88 406	88 468	
USD	343	Etsy Inc.	51 264	38 402	
USD	410	Expedia Group Inc.	55 102	59 348	
USD	10 892	Ford Motor Co.	192 712	218 066	
USD	425	Garmin Ltd.	54 049	58 651	
USD	3 877	General Motors Co.	194 816	197 822	
USD	385	Genuine Parts Co.	84 821	86 214	
USD	730	Hilton Worldwide Holdings Inc.	129 513	140 597	
USD	2 824	Home Depot Inc. (The)	1 143 667	1 160 818	
USD	911	Las Vegas Sands Corp.	53 865	69 918	
USD	691	Lennar Corp., catégorie A	81 859	114 579	
USD	40	Lennar Corp., catégorie B	3 981	5 980	
USD	1 662	Lowe's Cos., Inc.	447 239	496 369	
USD	1 679	Lucid Group Inc.	26 609	15 308	
USD	309	Lululemon Athletica Inc.	140 232	154 763	
USD	754	Marriott International Inc., catégorie A	158 258	183 273	
USD	2 035	McDonald's Corp.	721 468	803 563	
USD	124	MercadoLibre Inc.	161 405	194 373	
USD	851	MGM Resorts International	40 712	49 458	
USD	129	Mobileye Global Inc., catégorie A	6 893	6 558	
USD	3 397	Nike Inc., catégorie B	500 195	496 122	
USD	9	NVR Inc.	55 869	75 631	
USD	170	O'Reilly Automotive Inc.	179 495	214 897	
USD	106	Pool Corp.	48 127	52 549	
USD	1 735	Rivian Automotive Inc., catégorie A	60 202	38 249	
USD	937	Ross Stores Inc.	128 075	139 028	
USD	3 140	Starbucks Corp.	403 007	411 595	
USD	7 629	Tesla Inc.	2 199 118	2 642 587	
USD	3 209	The TJX Cos. Inc.	314 797	360 045	
USD	306	Tractor Supply Co.	87 412	89 527	
USD	137	Ulta Beauty Inc.	81 116	85 312	
USD	1 129	Yum China Holdings Inc.	79 793	84 408	
USD	779	Yum! Brands Inc.	128 308	142 819	
			<b>13 057 073</b>	<b>14 872 730</b>	<b>10,7</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	1 529	3M Co.	250 565	202 507	
USD	640	AMETEK Inc.	113 119	137 093	
USD	1 151	Automatic Data Processing Inc.	363 715	334 753	
USD	56	Avis Budget Group Inc.	12 268	16 945	
USD	190	Axon Enterprise Inc.	57 246	49 057	
USD	1 667	Boeing Co. (The)	386 943	465 789	

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 500 É.-U. 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
		<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>			
USD	324	Broadridge Financial Solutions Inc.	64 607	71 011	
USD	141	Carlisle Cos. Inc.	45 456	47 863	
USD	2 326	Carrier Global Corp.	129 818	153 001	
USD	1 438	Caterpillar Inc.	406 385	468 192	
USD	241	Cintas Corp.	139 032	158 520	
USD	1 263	Copart Inc.	110 596	152 436	
USD	5 655	CSX Corp.	233 269	255 170	
USD	390	Cummins Inc.	119 884	126 519	
USD	759	Deere & Co.	395 173	406 951	
USD	1 784	Delta Air Lines Inc.	80 427	112 227	
USD	387	Dover Corp.	70 230	75 611	
USD	1 103	Eaton Corp., PLC	228 224	293 514	
USD	1 589	Emerson Electric Co.	185 996	190 058	
USD	341	Equifax Inc.	88 974	106 174	
USD	429	Expeditors International of Washington Inc.	60 629	68 762	
USD	1 587	Fastenal Co.	107 740	123 879	
USD	643	FedEx Corp.	167 338	210 926	
USD	574	Ferguson PLC	111 216	119 484	
USD	984	Fortive Corp.	84 965	97 356	
USD	629	General Dynamics Corp.	195 969	179 075	
USD	3 014	General Electric Co.	261 688	438 112	
USD	117	HEICO Corp.	24 329	27 394	
USD	207	HEICO Corp., catégorie A	34 194	38 512	
USD	1 861	Honeywell International Inc.	491 683	510 983	
USD	1 137	Howmet Aerospace Inc.	62 977	74 565	
USD	209	Ilex Corp.	60 476	59 532	
USD	848	Illinois Tool Works Inc.	244 987	280 709	
USD	1 128	Ingersoll Rand Inc.	77 621	97 558	
USD	228	J.B. Hunt Transport Services Inc.	53 226	54 617	
USD	349	Jacobs Solutions Inc.	56 505	54 905	
USD	1 904	Johnson Controls International PLC	152 159	171 676	
USD	528	L3Harris Technologies Inc.	155 634	136 780	
USD	89	Lennox International Inc.	33 749	38 401	
USD	711	Lockheed Martin Corp.	426 193	433 140	
USD	143	Nordson Corp.	41 672	46 962	
USD	635	Norfolk Southern Corp.	200 300	190 538	
USD	423	Northrop Grumman Corp.	274 369	255 127	
USD	267	Old Dominion Freight Line Inc.	103 204	130 636	
USD	1 156	Otis Worldwide Corp.	117 205	136 157	
USD	1 438	PACCAR Inc.	126 217	159 172	
USD	356	Parker-Hannifin Corp.	139 093	183 739	
USD	897	Paychex Inc.	140 964	132 785	
USD	143	Paycom Software Inc.	62 489	60 787	
USD	396	Quanta Services Inc.	76 738	102 941	
USD	4 078	Raytheon Technologies Corp.	510 965	528 613	
USD	576	Republic Services Inc.	104 861	116 745	
USD	319	Rockwell Automation Inc.	109 226	139 066	
USD	659	Rollins Inc.	33 551	37 349	
USD	1 653	Southwest Airlines Co.	80 398	79 203	
USD	609	SS&C Technologies Holdings Inc.	44 645	48 835	
USD	422	Stanley Black & Decker Inc.	50 331	52 329	
USD	638	Trane Technologies PLC	141 643	161 468	
USD	143	TransDigm Group Inc.	120 935	169 199	
USD	536	TransUnion	48 464	55 556	
USD	5 390	Uber Technologies Inc.	213 834	307 902	
USD	1 704	Union Pacific Corp.	476 708	461 381	

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 500 É.-U. 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
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>					
USD	909	United Airlines Holdings Inc.	50 342	66 000	
USD	2 020	United Parcel Service Inc., catégorie B	489 620	479 129	
USD	193	United Rentals Inc.	85 455	113 742	
USD	430	Verisk Analytics Inc.	105 989	128 610	
USD	113	W.W. Grainger Inc.	86 575	117 916	
USD	498	Wabtec Corp.	62 732	72 270	
USD	1 137	Waste Management Inc.	246 695	260 916	
USD	498	Xylem Inc.	67 922	74 214	
			<b>10 758 347</b>	<b>11 909 044</b>	<b>8,6</b>
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	2 022	Activision Blizzard Inc.	208 777	225 554	
USD	16 598	Alphabet Inc., catégorie A	2 311 772	2 629 007	
USD	14 460	Alphabet Inc., catégorie C	2 024 024	2 314 664	
USD	19 861	AT&T Inc.	484 977	419 183	
USD	293	Charter Communications Inc., catégorie A	151 934	142 434	
USD	11 641	Comcast Corp., catégorie A	573 362	640 034	
USD	718	Electronic Arts Inc.	121 040	123 227	
USD	515	Endeavor Group Holdings Inc., catégorie A	15 934	16 301	
USD	815	Fox Corp., catégorie A	35 395	36 667	
USD	364	Fox Corp., catégorie B	14 727	15 360	
USD	410	Live Nation Entertainment Inc.	42 561	49 430	
USD	6 174	Meta Platforms Inc., catégorie A	1 316 125	2 344 553	
USD	1 211	Netflix Inc.	460 080	705 866	
USD	560	Omnicom Group Inc.	57 752	70 508	
USD	1 356	Paramount Global, catégorie B	38 430	28 548	
USD	1 641	Pinterest Inc., catégorie A	54 105	59 368	
USD	978	ROBLOX Corp., catégorie A	49 805	52 154	
USD	1 874	Sirius XM Holdings Inc.	14 468	11 233	
USD	2 712	Snap Inc., catégorie A	45 752	42 490	
USD	368	Spotify Technology SA	51 984	78 181	
USD	465	Take-Two Interactive Software Inc.	72 620	90 549	
USD	1 563	T-Mobile US Inc.	298 407	287 279	
USD	1 235	Trade Desk Inc. (The)	91 337	126 194	
USD	11 703	Verizon Communications Inc.	637 541	575 924	
USD	5 090	Walt Disney Co. (The)	690 716	601 331	
USD	6 217	Warner Bros Discovery Inc.	107 236	103 162	
USD	347	Warner Music Group Corp., catégorie A	13 710	11 980	
			<b>9 984 571</b>	<b>11 801 181</b>	<b>8,5</b>
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	368	Albertsons Cos. Inc., catégorie A	11 553	10 625	
USD	4 973	Altria Group Inc.	296 229	298 098	
USD	1 515	Archer-Daniels-Midland Co.	173 618	151 477	
USD	852	Brown-Forman Corp., catégorie B	78 648	75 288	
USD	535	Campbell Soup Co.	36 573	32 360	
USD	680	Church & Dwight Co., Inc.	75 482	90 188	
USD	343	Clorox Co. (The)	67 720	72 184	
USD	10 848	Coca-Cola Co. (The)	889 185	864 435	
USD	2 313	Colgate-Palmolive Co.	236 470	235 795	
USD	1 324	Conagra Brands Inc.	63 227	59 077	
USD	441	Constellation Brands Inc., catégorie A	140 950	143 630	
USD	1 233	Costco Wholesale Corp.	835 974	878 403	
USD	608	Dollar General Corp.	195 048	136 594	
USD	545	Dollar Tree Inc.	107 245	103 488	
USD	596	Estée Lauder Cos. Inc. (The), catégorie A	186 620	154 877	
USD	1 636	General Mills Inc.	174 475	166 043	
USD	409	Hershey Co. (The)	126 738	135 140	

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 500 É.-U. 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
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)</b>					
USD	806	Hormel Foods Corp.	49 729	42 896	
USD	283	J.M. Smucker Co. (The)	57 808	55 299	
USD	712	Kellogg Co.	67 730	63 501	
USD	2 529	Keurig Dr Pepper Inc.	123 877	104 645	
USD	939	Kimberly-Clark Corp.	164 246	171 544	
USD	2 195	Kraft Heinz Co. (The)	111 501	103 111	
USD	1 977	Kroger Co. (The)	125 484	122 955	
USD	700	McCormick & Co., Inc.	77 811	80 799	
USD	3 788	Mondeléz International Inc., catégorie A	328 828	365 610	
USD	1 413	Monster Beverage Corp.	93 941	107 399	
USD	3 835	PepsiCo Inc.	912 178	939 929	
USD	4 315	Philip Morris International Inc.	552 652	557 393	
USD	6 568	Procter & Gamble Co. (The)	1 259 057	1 318 788	
USD	1 414	Sysco Corp.	152 586	138 834	
USD	1 281	Target Corp.	278 512	223 582	
USD	786	Tyson Foods Inc., catégorie A	71 273	53 085	
USD	1 986	Walgreens Boots Alliance Inc.	99 317	74 871	
USD	3 959	Walmart Inc.	758 242	823 426	
			<b>8 980 527</b>	<b>8 955 369</b>	<b>6,4</b>
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	2 819	Baker Hughes Co.	102 218	117 913	
USD	672	Cheniere Energy Inc.	142 646	135 482	
USD	4 843	Chevron Corp.	1 060 335	1 008 378	
USD	3 394	ConocoPhillips Co.	500 782	465 324	
USD	2 109	Coterra Energy Inc.	77 529	70 606	
USD	1 811	Devon Energy Corp.	149 254	115 842	
USD	486	Diamondback Energy Inc.	88 637	84 478	
USD	1 636	EOG Resources Inc.	269 160	247 744	
USD	950	EQT Corp.	50 515	51 704	
USD	11 342	Exxon Mobil Corp.	1 548 309	1 609 640	
USD	2 514	Halliburton Co.	108 491	109 746	
USD	769	Hess Corp.	131 975	138 340	
USD	5 483	Kinder Morgan Inc.	131 143	124 938	
USD	1 757	Marathon Oil Corp.	62 480	53 520	
USD	1 242	Marathon Petroleum Corp.	181 614	191 629	
USD	1 965	Occidental Petroleum Corp.	168 247	152 891	
USD	1 240	ONEOK Inc.	102 261	101 272	
USD	1 293	Phillips 66	167 022	163 192	
USD	651	Pioneer Natural Resources Co.	200 217	178 472	
USD	3 950	Schlumberger Ltd.	237 533	256 742	
USD	621	Targa Resources Corp.	61 594	62 534	
USD	21	Texas Pacific Land Corp.	58 311	36 583	
USD	1 031	Valero Energy Corp.	165 937	160 029	
USD	3 395	Williams Cos. Inc. (The)	144 539	146 588	
			<b>5 910 749</b>	<b>5 783 587</b>	<b>4,2</b>
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	1 859	AES Corp. (The)	63 094	50 994	
USD	700	Alliant Energy Corp.	52 436	48 611	
USD	727	Ameren Corp.	84 818	78 567	
USD	1 435	American Electric Power Co., Inc.	179 732	159 884	
USD	542	American Water Works Co., Inc.	107 721	102 380	
USD	400	Atmos Energy Corp.	61 562	61 579	
USD	197	Avangrid Inc.	11 477	9 822	
USD	1 756	CenterPoint Energy Inc.	70 693	67 734	
USD	809	CMS Energy Corp.	67 278	62 892	
USD	990	Consolidated Edison Inc.	124 506	118 426	

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 500 É.-U. 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
<b>SERVICES PUBLICS (suite)</b>					
USD	913	Constellation Energy Corp.	101 678	110 604	
USD	2 329	Dominion Energy Inc.	206 652	159 609	
USD	570	DTE Energy Co.	89 642	82 983	
USD	2 144	Duke Energy Corp.	286 511	254 597	
USD	1 067	Edison International	92 457	98 057	
USD	588	Entergy Corp.	86 235	75 761	
USD	628	Evergy Inc.	51 860	48 547	
USD	971	Eversource Energy	106 111	91 123	
USD	2 770	Exelon Corp.	152 382	149 328	
USD	1 595	FirstEnergy Corp.	84 124	82 060	
USD	5 628	NextEra Energy Inc.	611 286	552 586	
USD	4 363	PG&E Corp.	83 886	99 763	
USD	2 056	PPL Corp.	77 655	71 987	
USD	1 390	Public Service Enterprise Group Inc.	113 273	115 160	
USD	876	Sempra Energy	183 549	168 763	
USD	3 027	Southern Co. (The)	282 547	281 385	
USD	879	WEC Energy Group Inc.	113 246	102 635	
USD	1 534	Xcel Energy Inc.	141 195	126 197	
			<b>3 687 606</b>	<b>3 432 034</b>	<b>2,5</b>
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	610	Air Products and Chemicals Inc.	224 130	241 775	
USD	326	Albemarle Corp.	110 052	96 236	
USD	4 122	Amcor PLC	64 504	54 435	
USD	221	Avery Dennison Corp.	50 376	50 241	
USD	864	Ball Corp.	66 261	66 551	
USD	302	Celanese Corp.	43 201	46 276	
USD	542	CF Industries Holdings Inc.	68 578	49 788	
USD	1 987	Corteva Inc.	161 302	150 659	
USD	1 965	Dow Inc.	134 409	138 486	
USD	1 171	DuPont de Nemours Inc.	100 872	110 698	
USD	703	Ecolab Inc.	147 975	173 667	
USD	348	FMC Corp.	60 072	48 048	
USD	3 971	Freeport-McMoRan Inc.	184 161	210 185	
USD	710	International Flavors & Fragrances Inc.	96 945	74 775	
USD	966	International Paper Co.	48 411	40 661	
USD	1 366	Linde PLC	580 131	688 825	
USD	714	LyondellBasell Industries NV, catégorie A	82 603	86 761	
USD	172	Martin Marietta Materials Inc.	80 675	105 080	
USD	935	Mosaic Co. (The)	61 306	43 303	
USD	2 213	Newmont Corp.	139 432	124 924	
USD	701	Nucor Corp.	127 304	152 108	
USD	655	PPG Industries Inc.	112 639	128 536	
USD	661	Sherwin-Williams Co. (The)	209 806	232 242	
USD	237	Southern Copper Corp.	18 354	22 498	
USD	448	Steel Dynamics Inc.	72 526	64 576	
USD	369	Vulcan Materials Co.	85 593	110 078	
			<b>3 131 618</b>	<b>3 311 412</b>	<b>2,4</b>
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	477	Alexandria Real Estate Equities Inc.	91 895	71 634	
USD	1 296	American Tower Corp.	387 882	332 594	
USD	389	AvalonBay Communities Inc.	94 328	97 426	
USD	293	Camden Property Trust	47 049	42 210	
USD	861	CBRE Group Inc., catégorie A	88 081	91 954	
USD	1 123	CoStar Group Inc.	111 873	132 255	
USD	1 204	Crown Castle Inc.	235 182	181 528	
USD	812	Digital Realty Trust Inc.	118 772	122 351	

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 500 É.-U. 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
<b>IMMOBILIER (suite)</b>					
USD	258	Equinix Inc.	229 081	267 636	
USD	1 039	Equity Residential	91 835	90 699	
USD	178	Essex Property Trust Inc.	55 771	55 187	
USD	371	Extra Space Storage Inc.	81 580	73 074	
USD	1 522	Healthpeak Properties Inc.	50 533	40 481	
USD	1 594	Invitation Homes Inc.	71 615	72 559	
USD	323	Mid-America Apartment Communities Inc.	69 494	64 906	
USD	2 565	Prologis Inc.	402 051	416 223	
USD	439	Public Storage	176 495	169 555	
USD	1 842	Realty Income Corp.	157 227	145 734	
USD	298	SBA Communications Corp.	115 613	91 390	
USD	898	Simon Property Group Inc.	131 715	137 222	
USD	340	Sun Communities Inc.	66 369	58 695	
USD	913	UDR Inc.	51 489	51 901	
USD	1 113	Ventas Inc.	68 185	69 618	
USD	2 797	VICI Properties Inc.	121 943	116 326	
USD	1 368	Welltower Inc.	132 045	146 428	
USD	2 037	Weyerhaeuser Co.	87 001	90 325	
USD	581	WP Carey Inc.	61 189	51 941	
			<b>3 396 293</b>	<b>3 281 852</b>	<b>2,4</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>125 024 351</b>	<b>138 872 745</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(19 283)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>125 005 068</b>	<b>138 872 745</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				142 632	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>139 015 377</b>	<b>100,0</b>

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 500 É.-U. 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	1	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires non couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	6 900 000	300 000
Parts rachetables émises	1 950 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(2 100 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	6 750 000	300 000

<sup>†</sup> 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 500 É.-U. 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 ordinaires non couvertes	0,080

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	202
Garanties (hors trésorerie)	-	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	3	-
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	2	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>38,4</b>	<b>-</b>

# FNB Indice 500 É.-U. 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 (%)
Actions - Technologies de l'information	26,5
Actions - Soins de santé	15,9
Actions - Services financiers	11,2
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	9,7
Actions - Produits industriels	8,5
Actions - Services de communication	7,3
Actions - Biens de consommation de base	7,0
Actions - Énergie	5,3
Actions - Services publics	3,0
Actions - Immobilier	2,6
Actions - Matériaux	2,4
Autres actifs (passifs) nets	0,6
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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 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 Solactive GBS United States 500	13 831 087

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 500	12 406 416

### 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	139 007	-	139 007	100,0
<b>Total</b>	<b>139 007</b>	<b>-</b>	<b>139 007</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)		
Dollar américain	124 213	-	124 213	99,5
<b>Total</b>	<b>124 213</b>	<b>-</b>	<b>124 213</b>	<b>99,5</b>

~ 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 13 901 000 \$ (12 421 000 \$ 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)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	138 873	-	-	138 873
<b>Total</b>	<b>138 873</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>138 873</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2022

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	124 086	-	-	124 086
<b>Total</b>	<b>124 086</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>124 086</b>

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 des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	24 475	27 235
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	9	10
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	691	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	-	-
Intérêts à recevoir	49	50
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	795
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	822
	25 224	28 961
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	16	42
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	-	1 588
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	3	3
Comptes créditeurs et charges à payer	9	6
	28	1 639
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	25 196	27 322

## 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 ordinaires	25 196	27 322	16,39	16,43	1 537 500	1 662 500

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

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## État 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	562	1 092
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	(604)	(323)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	445	(3 051)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>403</b>	<b>(2 282)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(3)	5
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	1
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	5	30
<b>Total des autres revenus</b>	<b>2</b>	<b>36</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>405</b>	<b>(2 246)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	19	18
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	6
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	2	2
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>24</b>	<b>27</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>381</b>	<b>(2 273)</b>

## État 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 ordinaires	381	(2 273)	0,24	(1,78)	1 597 445	1 279 144

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

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## État 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 ordinaires	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	27 322	21 206
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	381	(2 273)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(467)	(999)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(467)	(999)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 680	21 640
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 720)	(8 261)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(2 040)	13 379
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 126)	10 107
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	25 196	31 313

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

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## Tableau 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	381	(2 273)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	604	323
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	6
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(445)	3 051
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	8 222	14 073
Achat de placements et de dérivés	(7 083)	(28 560)
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	1	(24)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	1
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	2	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 685</b>	<b>(13 403)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(467)	(999)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 502	22 649
Montant versé au rachat de parts rachetables	(3 720)	(8 261)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 685)</b>	<b>13 389</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(14)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	10	15
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>9</b>	<b>1</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	563	1 068
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 des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES</b>					
USD	642 527	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2024	855 737	825 570	
USD	572 185	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 octobre 2024	759 414	731 054	
USD	469 704	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 avril 2025	623 129	591 955	
USD	570 458	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 octobre 2025	759 389	716 443	
USD	440 653	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 avril 2026	584 319	547 347	
USD	540 317	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2026	720 048	672 341	
USD	881 332	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 octobre 2026	1 169 046	1 091 472	
USD	623 071	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 avril 2027	801 993	763 929	
USD	564 693	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2030	743 862	671 094	
USD	624 624	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2030	826 682	741 853	
USD	776 003	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2031	1 023 100	913 359	
USD	660 895	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2031	870 625	776 324	
USD	721 071	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	923 126	840 693	
USD	238 827	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 février 2051	290 891	210 696	
USD	276 753	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 février 2052	281 458	242 778	
USD	1 005 263	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,25 %, 15 janvier 2025	1 333 611	1 276 526	
USD	499 209	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,25 %, 15 juillet 2029	666 615	603 910	
USD	237 134	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,25 %, 15 février 2050	296 254	219 382	
USD	643 347	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 juillet 2025	863 705	815 583	
USD	503 512	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 janvier 2027	674 983	625 809	
USD	554 253	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 juillet 2027	741 266	688 264	
USD	1 093 159	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,5 %, 15 janvier 2028	1 464 541	1 354 407	
USD	811 861	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,63 %, 15 janvier 2026	1 092 324	1 025 552	
USD	748 498	Obligation du Trésor américain, indexées sur l'inflation, 0,63 %, 15 juillet 2032	950 787	911 259	
USD	241 425	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,63 %, 15 février 2043	325 012	262 198	
USD	731 040	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 juillet 2028	994 502	917 701	
USD	307 391	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 février 2042	424 202	345 772	
USD	365 806	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 février 2045	503 903	399 971	
USD	749 561	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,88 %, 15 janvier 2029	1 021 081	939 938	
USD	229 941	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,88 %, 15 février 2047	326 999	255 230	
USD	188 175	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2046	272 853	215 964	
USD	167 279	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2048	245 880	190 356	
USD	156 697	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2049	231 875	178 283	
USD	497 924	Obligation du Trésor américain, indexée à l'inflation, 1,13 %, 15 janvier 2033	662 700	631 817	
USD	323 587	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,25 %, 15 avril 2028	430 907	414 676	
USD	331 867	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,38 %, 15 février 2044	510 147	413 521	
USD	139 792	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,5 %, 15 février 2053	191 954	179 458	
USD	624 585	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,63 %, 15 octobre 2027	845 745	815 157	
USD	131 912	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 février 2040	222 479	187 452	
USD	189 751	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 février 2041	322 376	269 609	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>26 849 520</b>	<b>24 474 703</b>	<b>97,1</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			-	-	-
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>26 849 520</b>	<b>24 474 703</b>	<b>97,1</b>
Contrat(s) de change à terme				675 402	2,7
<b>Total du portefeuille de placements</b>				<b>25 150 105</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				46 285	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>25 196 390</b>	<b>100,0</b>

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 des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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) (\$)
Banque de Montréal	A-1	5 juillet 2023	USD	583 000	CAD	766 461	0,76	5 868
Banque de Montréal	A-1	5 juillet 2023	USD	441 000	CAD	592 757	0,74	(8 542)
Banque HSBC, Toronto	A-1	5 juillet 2023	USD	194 000	CAD	263 141	0,74	(6 140)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	5 juillet 2023	CAD	26 920 705	USD	19 806 000	1,36	682 706
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	5 juillet 2023	USD	18 588 000	CAD	24 621 962	0,75	2 491
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	2 août 2023	CAD	24 610 853	USD	18 587 000	1,32	(981)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>675 402</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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	691	(7)	-	684
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	691	(7)	-	684
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(16)	7	-	(9)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(16)	7	-	(9)

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	(39)	-	10
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	49	(39)	-	10
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(42)	39	-	(3)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(42)	39	-	(3)

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

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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 <sup>†</sup>	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 662 500	1 050 000
Parts rachetables émises	100 000	1 150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(225 000)	(437 500)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 537 500	1 762 500

<sup>†</sup> 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 des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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 ordinaires	0,150

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	301
Garanties (hors trésorerie)	-	319

## 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
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	39,4

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) 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 - Obligations fédérales américaines et obligations garanties	99,7
Autres actifs (passifs) nets	0,3
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### 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++	97,1
AA/Aa/A+	2,8
<b>Total</b>	<b>99,9</b>

au 31 décembre 2022

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	99,7
AA/Aa/A+	0,2
<b>Total</b>	<b>99,9</b>

\*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

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	24 526	(24 612)	(86)	(0,3)
<b>Total</b>	<b>24 526</b>	<b>(24 612)</b>	<b>(86)</b>	<b>(0,3)</b>

### 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	27 287	(27 379)	(92)	(0,3)
<b>Total</b>	<b>27 287</b>	<b>(27 379)</b>	<b>(92)</b>	<b>(0,3)</b>

~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 9 000 \$ (9 000 \$ 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

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	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	6 530	6 426	11 519	24 475

au 31 décembre 2022

	Moins de 1 an	1 an à 3 ans	3 à 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	-	7 251	6 671	13 313	27 235

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 416 000 \$ (459 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## 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	-	24 475	-	24 475
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	675	-	675
<b>Total</b>	-	25 150	-	25 150

### 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	-	27 235	-	27 235
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	7	-	7
<b>Total</b>	-	27 242	-	27 242

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 Chefs de file américains 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
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	13 055	14 900
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	5	25
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	20	-
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	19
Intérêts à recevoir	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	151	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	13 245	14 944
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	65	20
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	76	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	8	10
Frais d'administration à payer	1	2
Comptes créditeurs et charges à payer	15	13
	165	45
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>13 080</b>	<b>14 899</b>

## 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 ordinaires couvertes	13 080	14 899	29,07	27,09	450 000

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



# FNB Indice Chefs de file américains 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
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	132	20
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	115
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	376	(3 101)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	646	(2 315)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 154</b>	<b>(5 281)</b>
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	4
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	3	13
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>3</b>	<b>17</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 157</b>	<b>(5 264)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	52	85
Frais d'administration (note 5)	8	14
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	13
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Honoraires d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	16	14
Taxe de vente harmonisée	5	9
Autres frais	-	-
<b>Total des charges</b>	<b>85</b>	<b>136</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 072</b>	<b>(5 400)</b>

## 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 ordinaires						
couvertes	1 072	(5 400)	2,19	(7,06)	488 674	764 641

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

# FNB Indice Chefs de file américains 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 ordinaires couvertes	
	2023	2022
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	14 899	27 397
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 072	(5 400)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(58)	-
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(58)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	4 360	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 193)	(2 866)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(2 833)	(2 866)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 819)	(8 266)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	13 080	19 131

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

# FNB Indice Chefs de file américains 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
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 072	(5 400)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(376)	3 101
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	13
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(646)	2 315
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 182	41 315
Achat de placements et de dérivés	(1 219)	(41 353)
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	5	(16)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(2)	(8)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	2	2
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>21</b>	<b>(32)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(58)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	70	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(53)	32
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(41)</b>	<b>32</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(20)	-
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	25	44
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>5</b>	<b>44</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	120	104
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 Chefs de file américains 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
<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>					
USD	30 326	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	4 638 858	4 344 456	
USD	17 975	SPDR Gold Shares	4 036 701	4 245 033	
USD	7 605	SPDR S&P 500 ETF Trust	4 288 683	4 465 924	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>12 964 242</b>	<b>13 055 413</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(730)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>12 963 512</b>	<b>13 055 413</b>	<b>99,8</b>
Contrat(s) de change à terme				(44 640)	(0,3)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>12 963 512</b>	<b>13 010 773</b>	<b>99,5</b>
Autres actifs (passifs) nets				69 026	0,5
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>13 079 799</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie <sup>a</sup>	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position contractuel	Taux	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	6 juillet 2023	CAD	468 354	USD	354 228	1,32	(901)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	6 juillet 2023	CAD	12 611 291	USD	9 552 881	1,32	(43 681)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	6 juillet 2023	USD	9 907 109	CAD	13 144 737	0,75	(20 510)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	3 août 2023	CAD	13 039 824	USD	9 832 466	1,33	20 452
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(44 640)</b>

<sup>a</sup>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 Chefs de file américains 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	20	(20)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	20	(20)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(65)	20	-	(45)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(65)	20	-	(45)

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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(20)	-	-	(20)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(20)	-	-	(20)

## 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 iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	15 474 429	4 344	-
Actions aurifères SPDR	42 053 140	4 245	-
SPDR S&P 500 ETF Trust	260 014 865	4 466	-

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 iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	48 019 570	4 934	-
Actions aurifères SPDR	73 135 197	5 172	-
SPDR S&P 500 ETF Trust	482 283 819	4 794	-

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

# FNB Indice Chefs de file américains 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	-	7
Paiements indirects <sup>†</sup>	-	3

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes	
	2023	2022
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	550 000	800 000
Parts rachetables émises	150 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(250 000)	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	450 000	700 000

<sup>†</sup> 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 Chefs de file américains CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Parts ordinaires couvertes	0,750	0,12

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	9 107
Garanties (hors trésorerie)	-	9 645

## 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	4	21
Charges	(1)	(8)
Revenu tiré des prêts de titres	3	13
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,1</b>	<b>37,8</b>

# FNB Indice Chefs de file américains CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2023

Catégories	Actif net (%)
SPDR S&P 500 ETF Trust	34,1
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	33,2
SPDR Gold Shares	32,5
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Contrat(s) de change à terme	(0,3)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2022

Catégories	Actif net (%)
SPDR Gold Shares	34,7
iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF	33,1
SPDR S&P 500 ETF Trust	32,2
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Contrat(s) de change à terme	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des fonds négociés en bourse.

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 CIBC.U.S. TrendLeaders	1 303 803

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 31 décembre 2022

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement global CIBC.U.S. TrendLeaders	1 489 566

### 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)	
Dollar américain	13 070	(13 019)	51	0,4
<b>Total</b>	<b>13 070</b>	<b>(13 019)</b>	<b>51</b>	<b>0,4</b>

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)	
Dollar américain	14 934	(14 864)	70	0,5
<b>Total</b>	<b>14 934</b>	<b>(14 864)</b>	<b>70</b>	<b>0,5</b>

~ 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 5 000 \$ (7 000 \$ au 31 décembre 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

### 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)
Fonds négocié(s) en bourse	13 056	-	-	13 056
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(45)	-	(45)
<b>Total</b>	<b>13 056</b>	<b>(45)</b>	<b>-</b>	<b>13 011</b>

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	14 900	-	-	14 900
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(20)	-	(20)
<b>Total</b>	<b>14 900</b>	<b>(20)</b>	<b>-</b>	<b>14 880</b>

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 de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	1 001
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	2
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	1 003
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 003</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	1 003	20,07	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	10
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	(4)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>10</b>
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>9</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	1
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	1
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	<b>2</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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 : 2023	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2023	Nombre moyen pondéré de parts : 2023
Parts ordinaires	7	0,11	69 231

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	-
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	1 989
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	(993)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	996
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 003
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 003

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	4
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5
Achat de placements et de dérivés	(1 010)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-
Produit de l'émission de parts rachetables	1 004
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>2</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Dividendes payés*	-
Intérêts payés*	(1)
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 de répartition de l'actif équilibré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	8 923	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	177 480	177 032	
	7 966	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	155 277	163 701	
	12 785	FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	352 377	352 100	
USD	1 608	iShares Core MSCI EAFE ETF	147 121	143 788	
USD	918	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	59 849	59 943	
	4 904	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	104 577	104 455	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>996 681</b>	<b>1 001 019</b>	<b>99,8</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(12)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>996 669</b>	<b>1 001 019</b>	<b>99,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		2 471	0,2
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>1 003 490</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente 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) (%)
<b>Entités structurées non consolidées</b>			
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	164	0,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	177	0,1
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	758 452	352	0,1
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	144	-
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	454 542	104	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	60	-

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	50 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif équilibré 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	177
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	164

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



# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	35,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	17,6
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	16,3
iShares Core MSCI EAFE ETF	14,3
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	10,4
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	6,0
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 100 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	204	-	204	20,3
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>-</b>	<b>204</b>	<b>20,3</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 20 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	1 001	-	-	1 001
<b>Total</b>	<b>1 001</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1 001</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	1 002
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	3
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	1 005
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 005</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	1 005	20,09	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	11
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	(12)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2</b>
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>-</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	-
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	1
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(1)</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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	2023	2023
Parts ordinaires	(1)	(0,02)	51 282

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	(1)
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	2 988
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	(1 981)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 007
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 005
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 005

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	12
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	8
Achat de placements et de dérivés	(1 009)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(993)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 006
Montant versé au rachat de parts rachetables	(9)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>996</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>3</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	11
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Dividendes payés*	-
Intérêts payés*	(1)
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 de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	11 066	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	219 992	219 549	
	9 713	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	191 988	199 602	
	9 369	FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	257 729	258 022	
USD	1 961	iShares Core MSCI EAFE ETF	179 153	175 354	
USD	1 147	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	75 536	74 896	
	3 503	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	74 692	74 614	
			<b>999 090</b>	<b>1 002 037</b>	<b>99,7</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>999 090</b>	<b>1 002 037</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(10)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>999 080</b>	<b>1 002 037</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		2 519	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>1 004 556</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

<b>Entités structurées non consolidées</b>	<b>Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)</b>
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	200	0,3
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	220	0,2
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	758 452	258	-
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	454 542	75	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	175	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	75	-

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	50 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif de croissance équilibrée 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	220
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	200

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	25,7
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	21,8
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	19,8
iShares Core MSCI EAFE ETF	17,5
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	7,5
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	7,4
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 100 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	251	-	251	25,0
<b>Total</b>	<b>251</b>	<b>-</b>	<b>251</b>	<b>25,0</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 25 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	1 002	-	-	1 002
<b>Total</b>	<b>1 002</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1 002</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	999
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	1
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	1 000
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 000</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	1 000	20,00	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	6
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(3)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3</b>
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	-
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	-
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	<b>-</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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 : 2023	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2023	Nombre moyen pondéré de parts : 2023
Parts ordinaires	2	0,03	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	(1)
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	999
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	999
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 000
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	3
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	-
Achat de placements et de dérivés	(1 003)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>999</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>1</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6
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 de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	6 015	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	120 653	119 338	
	5 345	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	104 094	109 840	
	17 743	FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	492 671	488 641	
USD	1 031	iShares Core MSCI EAFE ETF	95 016	92 193	
USD	613	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	40 066	40 027	
	7 004	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	149 954	149 185	
			<b>1 002 454</b>	<b>999 224</b>	<b>99,9</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>1 002 454</b>	<b>999 224</b>	<b>99,9</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(5)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>1 002 449</b>	<b>999 224</b>	<b>99,9</b>
		Autres actifs (passifs) nets		941	0,1
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>1 000 165</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

<b>Entités structurées non consolidées</b>	<b>Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)</b>
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	110	0,1
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	119	0,1
FNB iShares Canadian Universe Bond Index	758 452	489	0,1
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	454 542	149	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	92	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	40	-

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



# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	50 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif de revenu équilibré 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	119
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	110

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	48,9
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	14,9
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	11,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	11,0
iShares Core MSCI EAFE ETF	9,2
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	4,0
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 100 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	132	-	132	13,2
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>-</b>	<b>132</b>	<b>13,2</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 13 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	999	-	-	999
<b>Total</b>	<b>999</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>999</b>

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	996
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	1
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	997
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>997</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	997	19,95	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	5
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(5)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	-
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	(1)
<b>Total des revenus</b>	(1)
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	-
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	-
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	-
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1)

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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	2023	2023
Parts ordinaires	(1)	(0,02)	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	(2)
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	997
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	997

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	5
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1
Achat de placements et de dérivés	(1 002)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(997)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>998</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>1</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	5
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 de répartition de l'actif prudent CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	3 175	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	63 674	62 992	
	2 780	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	54 141	57 129	
	22 552	FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	626 238	621 083	
USD	517	iShares Core MSCI EAFE ETF	47 646	46 230	
USD	308	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	20 131	20 111	
	8 870	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	189 905	188 931	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>1 001 735</b>	<b>996 476</b>	<b>99,9</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(4)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>1 001 731</b>	996 476	99,9
		Autres actifs (passifs) nets		866	0,1
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>997 342</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

<b>Entités structurées non consolidées</b>	<b>Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)</b>
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	758 452	621	0,1
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	57	0,1
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	63	-
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	454 542	189	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	46	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	20	-

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	50 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif prudent 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	63
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	57

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	62,4
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	18,9
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	6,3
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	5,7
iShares Core MSCI EAFE ETF	4,6
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	2,0
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 100 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	67	-	67	6,7
<b>Total</b>	<b>67</b>	<b>-</b>	<b>67</b>	<b>6,7</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 7 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	996	-	-	996
<b>Total</b>	<b>996</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>996</b>

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	2 018
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	7
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	2 025
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	4
Montant à payer pour le rachat de parts	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-
Frais de gestion à payer	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 021</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	2 021	20,21	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	9
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	17
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>26</b>
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>24</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	1
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	-
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>23</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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 : 2023	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2023	Nombre moyen pondéré de parts : 2023
Parts ordinaires	23	0,44	52 564

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	-
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	1998
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1998
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2021
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	2021

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(17)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2
Achat de placements et de dérivés	(1 005)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(997)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-
Produit de l'émission de parts rachetables	1 004
Montant versé au rachat de parts rachetables	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>1 004</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	7
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>7</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	9
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 de répartition de l'actif en actions CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	33 060	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	654 064	655 911	
	29 614	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	588 351	608 568	
USD	5 973	iShares Core MSCI EAFE ETF	539 678	534 109	
USD	3 359	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	219 041	219 332	
			<b>2 001 134</b>	<b>2 017 920</b>	<b>99,8</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>2 001 134</b>	<b>2 017 920</b>	<b>99,8</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(22)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>2 001 112</b>	<b>2 017 920</b>	<b>99,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		3 232	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>2 021 152</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente 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) (%)
<b>Entités structurées non consolidées</b>			
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	609	0,8
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	656	0,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	534	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	219	-

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	100 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif en actions 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	656
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	609

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	32,4
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	30,1
iShares Core MSCI EAFE ETF	26,4
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	10,9
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 202 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	754	-	754	37,3
<b>Total</b>	<b>754</b>	<b>-</b>	<b>754</b>	<b>37,3</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 75 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	2 018	-	-	2 018
<b>Total</b>	<b>2 018</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 018</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

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

	au 30 juin 2023
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	1 005
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	2
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	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-
Dividendes à recevoir	-
Intérêts à recevoir	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
	1 007
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
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	-
Frais d'administration à payer	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-
	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 007</b>

## État 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): au 30 juin 2023	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : au 30 juin 2023	Nombre de parts rachetables en circulation : au 30 juin 2023
Parts ordinaires	1 007	20,15	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2023
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	8
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>10</b>
Autres revenus	
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Revenus divers de source étrangère	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>8</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	1
Frais d'administration (note 5)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Frais du comité d'examen indépendant	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-
Droits de garde	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-
Honoraires d'audit	-
Frais juridiques	-
Charge d'intérêts	-
Retenues d'impôts	-
Taxe de vente harmonisée	-
Autres frais	-
<b>Total des charges</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 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 : 2023	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2023	Nombre moyen pondéré de parts : 2023
Parts ordinaires	7	0,15	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	
Revenu net de placement	-
Profits nets réalisés	-
Remboursement de capital	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>	
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-
Rachat de parts rachetables	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 007
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	1 007

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



# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2
Achat de placements et de dérivés	(1 005)
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	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>2</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	8
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 de répartition de l'actif de croissance CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2023 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	12 705	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	254 862	252 068	
	11 579	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	225 501	237 948	
	6 368	FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	176 768	175 375	
USD	2 233	iShares Core MSCI EAFE ETF	205 773	199 676	
USD	1 338	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	87 453	87 367	
	2 458	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	52 625	52 355	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>1 002 982</b>	<b>1 004 789</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(6)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>1 002 976</b>	<b>1 004 789</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		2 694	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>1 007 483</b>	<b>100,0</b>

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 de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le tableau suivant présente la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2023

<b>Entités structurées non consolidées</b>	<b>Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)</b>	<b>Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)</b>
FNB Indice 1000 É.-U. CI	77 129	238	0,3
FNB Indice d'actions canadiennes CI	145 891	252	0,2
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	758 452	175	-
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	454 542	52	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	6 029 058	200	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3 214 841	87	-

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Parts ordinaires 2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	50 000

<sup>†</sup> 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 de répartition de l'actif de croissance 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 ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	252
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	238

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 30 juin 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	25,0
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	23,6
FNB iShares Core Canadian Universe Bond Index	17,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	19,8
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	8,7
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	5,2
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 101 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume 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	287	-	287	28,5
<b>Total</b>	<b>287</b>	<b>-</b>	<b>287</b>	<b>28,5</b>

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

Au 30 juin 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % 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 29 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le tableau ci-dessous résume 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)
Fonds négocié(s) en bourse	1 005	-	-	1 005
<b>Total</b>	<b>1 005</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1 005</b>

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

# Notes des états financiers (non audité)

## 1. LES FONDS

Les Fonds énumérés sous le titre Catégorie de société dans le tableau ci-dessous sont des séries d'actions de fonds négociés en Bourse (FNB) de CI First Asset Fund Corp. (Fund Corporation) et ont été établis en vertu des lois de la province de l'Ontario en tant que société de fonds communs de placement le 28 juin 2010. Chaque série d'actions est désignée individuellement comme un « Fonds de catégorie de société » (le Fonds de catégorie de société, et collectivement les Fonds de catégorie de société). Les présents états financiers contiennent l'information financière de chacune des séries en tant qu'entité publiante distincte.

Les autres Fonds (individuellement, une Fiducie, et collectivement, les Fiducies) étaient établis comme des fonds de placement constitués sous le régime des lois de la province de l'Ontario et régis par une déclaration de fiducie.

Chaque FNB est désigné individuellement comme un Fonds et collectivement comme les Fonds.

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. Au nom du Fonds de lingots d'or CI, le dépositaire a conclu une convention de sous-dépositaire avec la Banque Canadienne Impériale de Commerce (le « sous-dépositaire »). Le sous-dépositaire a conclu un autre contrat de sous-dépositaire avec JPMorgan Chase Bank, N.A. (le « dépositaire de l'or ») pour assurer la garde physique des lingots d'or du Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, 2<sup>e</sup> étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 16 août 2023.

L'objectif de chaque Fonds est de mettre en commun et de gérer l'argent versé par des investisseurs, porteurs de parts ou actionnaires 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.

Le tableau ci-dessous présente les objectifs de placement de chaque Fonds :

Fonds	Objectifs de placement
<b>FIDUCIES</b>	
FNB indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1 à 5 ans CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans FTSE Canada <sup>SM</sup> , déduction faite des frais. Le Fonds investit principalement dans des obligations à coupons détachés, à la fois les coupons et les obligations résiduelles, provenant d'obligations du gouvernement fédéral et des gouvernements provinciaux canadiens émises sur le marché canadien et libellées en dollars canadiens.
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	Le Fonds cherche à procurer une combinaison de croissance du capital à long terme et un niveau modéré de revenu, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme ainsi qu'un potentiel de revenu modéré, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	Le Fonds cherche à procurer une combinaison de revenu et une croissance modérée du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres à revenu fixe et de titres de capitaux propres mondiaux.
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (i) des distributions en espèces trimestrielles; et (ii) la possibilité d'une plus-value du capital en investissant principalement dans un portefeuille à capitalisation pondérée d'obligations convertibles d'émetteurs canadiens.
FNB Indice d'actions canadiennes CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice d'actions canadiennes étendu, déduction faite des frais. À l'heure actuelle, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive Canada Broad Market Index, déduction faite des frais.
FNB de FPI canadiennes CI	Le Fonds cherche à obtenir des rendements totaux à long terme, composés de revenus réguliers et d'une appréciation du capital à long terme, à partir d'un portefeuille géré activement, composé principalement de titres de sociétés de placement immobilier canadiennes, de sociétés d'exploitation immobilière et d'entités participant à des services liés à l'immobilier.
FNB de répartition de l'actif prudent CI	Le Fonds cherche à procurer un revenu et un potentiel de croissance modérée du capital en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres à revenu fixe et de titres de capitaux propres mondiaux.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

<b>Fonds (suite)</b>	<b>Objectifs de placement</b>
<b>FIDUCIES (suite)</b>	
FNB alpha Marchés émergents CI	Le Fonds cherche à fournir une croissance maximale du capital à long terme à partir d'un portefeuille géré activement, en investissant principalement dans des actions et des titres liés à des actions de sociétés ayant un bon potentiel de croissance, situées sur des marchés émergents ou servant des clients sur des marchés émergents.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions trimestrielles en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres des 15 plus grandes sociétés énergétiques mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes.
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	Le Fonds cherche à procurer des rendements à long terme en réalisant un revenu d'intérêts et une plus-value du capital. Le Fonds investit principalement dans des titres de créance d'État, mais il peut aussi investir dans un vaste éventail de titres de créance, y compris des liquidités, des titres de créance de sociétés et des titres de créance et des dérivés de crédit.
FNB de répartition de l'actif en actions CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres mondiaux.
FNB Chaîne de blocs CI Galaxy	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity couvert en \$ CA, déduction faite des frais.
FNB Métavers CI Galaxy	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds couvert en \$ CA, déduction faite des frais.
FNB alpha Innovation mondiale CI	Le Fonds cherche à fournir une croissance maximale du capital à long terme à partir d'un portefeuille géré activement qui investit principalement dans des actions et des titres apparentés à des actions de sociétés du monde entier qui sont positionnées pour bénéficier d'innovations et de progrès dans la technologie, les produits, les processus ou les services.
FNB Secteur financier mondial CI	Le Fonds cherche à obtenir un rendement global à long terme qui consiste en une plus-value du capital à long terme et en un revenu de dividendes régulier à partir d'un portefeuille géré activement et composé principalement de titres de capitaux propres d'émetteurs du secteur des services financiers à l'échelle mondiale.
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice mondial de la santé, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive Developed Markets Healthcare 150 CAD, déduction faite des frais.
Fonds de lingots d'or CI	L'objectif d'investissement du Fonds est de fournir aux porteurs de parts une exposition à l'or. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit et détient la quasi-totalité de ses actifs dans des lingots d'or à long terme afin d'offrir aux investisseurs un moyen rentable et pratique d'investir dans l'or.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions trimestrielles en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres des 15 plus grandes sociétés d'or et de métaux précieux mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes. Les émetteurs compris dans le portefeuille, sélectionnés en fonction de la capitalisation boursière, peuvent être remplacés en fonction de l'opinion du gestionnaire de portefeuille quant à la liquidité des titres de capitaux propres des émetteurs et de leurs options d'achat connexes.
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions régulières en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres de participation d'au moins 20 des plus grandes sociétés de soins de santé mesurées en fonction de leur capitalisation boursière et cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes. Les émetteurs compris dans le portefeuille, sélectionnés en fonction de la capitalisation boursière, peuvent être remplacés en fonction de l'opinion du gestionnaire de portefeuille quant à la liquidité des titres de capitaux propres des émetteurs et de leurs options d'achat connexes.
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	Le Fonds cherche à optimiser le revenu mensuel pour les porteurs de parts tout en préservant le capital et les liquidités en investissant principalement dans des comptes de dépôt à intérêts élevés.



# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
<b>FIDUCIES (suite)</b>	
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	Le Fonds cherche à fournir aux porteurs de parts des distributions en espèces mensuelles et à maximiser les rendements totaux pour les porteurs de parts, composés principalement de distributions mensuelles, tout en réduisant le risque et en préservant le capital. Dans des conditions de marché normales, le Fonds investit principalement dans des obligations et des titres de créance de première qualité.
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Canada Target Momentum Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Canada Target Value Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Momentum Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Value Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® National Bank Québec Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® U.S. Target Momentum Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® U.S. Target Value Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI <i>(auparavant FNB Indice MSCI Indice MSCI Monde Incidence ESG CI)</i>	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels couvert en dollars canadiens, déduction faite des frais, et relativement aux parts ordinaires non couvertes, l'objectif de placement du Fonds est de reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels, déduction faite des frais.
FNB d'actions privilégiées CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (a) des distributions régulières; et (b) un potentiel d'appréciation du capital résultant du rendement dégagé par un portefeuille composé principalement d'actions privilégiées émises par des sociétés nord-américaines.
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, grâce à un portefeuille géré activement : (i) des distributions en espèces trimestrielles; (ii) la possibilité d'une plus-value du capital en investissant selon une pondération égale dans un portefeuille de titres d'au moins 25 des plus grandes sociétés de technologie mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, dont les actions ordinaires sont inscrites à une Bourse nord-américaine dans la catégorie Technologie de l'information de la classification CIGS, ainsi que celles dans les sous-catégories Marketing de détail direct et en ligne, Divertissement à domicile interactif et Médias et services interactifs de la classification CIGS ou d'autres sous-catégories, si le gestionnaire le juge indiqué, mais qui ne font pas partie de la sous-catégorie Services de traitement de données et d'impartition de cette classification, et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que subirait un porteur qui serait propriétaire d'un portefeuille de titres de ces émetteurs directement, en ayant recours à un programme de vente d'options d'achat couvertes.
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (i) des distributions en espèces trimestrielles; (ii) la possibilité d'une plus-value du capital; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que subirait un porteur qui serait propriétaire d'un portefeuille composé d'actions ordinaires de sociétés cotées en Bourse qui font partie des dix plus importantes sociétés canadiennes et américaines d'assurance-vie, selon leur capitalisation boursière.
FNB Indice 1000 É.-U. CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un large indice boursier américain, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive GBS United States 1000 CAD, déduction faite des frais.
FNB Indice 500 É.-U. CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un large indice boursier américain, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive GBS United States 500 CAD, déduction faite des frais.
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice des titres du Trésor américain protégés contre l'inflation et couverts en dollars canadiens, déduction faite des frais. Actuellement, le FNB cherche à reproduire l'indice TR des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) de Solactive.
FNB Indice Chefs de file américains CI	Le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice CIBC Chefs de file américains, déduction faite des frais.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
<b>FONDS DE CATÉGORIE DE SOCIÉTÉ</b>	
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	Le Fonds cherche à fournir aux actionnaires : (i) des distributions trimestrielles; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital; et (iii) une volatilité globale du rendement du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille d'actions ordinaires de la Banque de Montréal, de la Banque Canadienne Impériale de Commerce, de la Banque Nationale du Canada, de la Banque Royale du Canada, de la Banque de Nouvelle-Écosse et de la Banque Toronto-Dominion.
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice MSCI Canada Qualité, déduction faite des frais.
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice représentant les obligations à court terme du gouvernement du Canada, soit, actuellement l'indice des obligations du gouvernement à court terme FTSE Canada, déduction faite des frais.

Le Fonds offre des parts ordinaires, des parts ordinaires couvertes, des parts ordinaires non couvertes, des parts ordinaires couvertes en \$ US, des parts de la série FNB \$ CA, des parts de la série FNB couvertes en \$ CA, des parts de la série FNB non couvertes en \$ CA, des parts de la série FNB en \$ US, des parts de la série FNB couvertes en \$ US. L'exposition des titres non couverts d'un Fonds à des monnaies autres que le dollar canadien/américain n'est pas couverte par rapport au dollar canadien/américain, le cas échéant. Par conséquent, la valeur liquidative attribuable aux porteurs de parts/d'actions rachetables par part/action de chaque série ne sera pas la même en raison des frais différents attribuables à chaque série de parts/d'actions et/ou de la stratégie de couverture du risque de change différente, le cas échéant.

Depuis le 21 avril 2022, les parts qui étaient précédemment émises en tant que parts ordinaires, parts ordinaires non couvertes et parts ordinaires en \$ US, ont été renommées respectivement parts ordinaires couvertes, parts ordinaires non couvertes et parts ordinaires couvertes en \$ US, selon le cas.

Le tableau qui suit indique la date à laquelle chaque Fonds a été établi ou la date du premier appel public à l'épargne inscrite dans le prospectus pour les Fonds établis initialement à titre de fiducies de placement à capital fixe (date de création). La date à laquelle chaque série de titres de chaque Fonds a commencé à être négociée à la Bourse de Toronto (« TSX ») ou à la Neo Exchange Inc. (« NEO ») sous forme de FNB (« date de lancement ») est aussi indiquée ci-dessous.

Fonds	Symbole de TSX	Parts ordinaires	Parts ordinaires		Parts ordinaires couvertes en \$ US	Parts de série FNB en \$ CA
			non couvertes	couvertes		
<b>FIDUCIES</b>						
FNB indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1 à 5 ans CI	BXF	11 juin 2013	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	CBAL	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	CBGR	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	CBIN	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	CXF	7 juin 2011	-	-	-	-
FNB Indice d'actions canadiennes CI	CCDN	12 août 2021**	-	-	-	-
FNB de FPI canadiennes CI	RIT	14 juill. 2015	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif prudent CI	CCNV	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB alpha Marchés émergents CI	CIEM / CIEM.U	-	-	-	-	26 août 2021
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	NXF / NXF.B / NXF.U	-	10 févr. 2015*	10 févr. 2015	3 mars 2022	-
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	FGO / FGO.U	-	31 juill. 2018*	-	31 juill. 2018***	-
FNB de répartition de l'actif en actions CI	CEQT	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB Chaîne de blocs CI Galaxy	CBCX	28 avr. 2022	-	-	-	-
FNB Métavers CI Galaxy	CMVX	28 avr. 2022	-	-	-	-
FNB alpha Innovation mondiale CI	CINV / CINV.U	-	-	-	-	12 août 2021
FNB Secteur financier mondial CI	FSF	25 avr. 2016	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	CHCL.B	-	-	12 août 2021	-	-
Fonds de lingots d'or CI	VALT / VALT.U / VALT.B	-	-	-	-	-

\*Auparavant des parts ordinaires

\*\*Auparavant des parts ordinaires non couvertes

\*\*\*Auparavant des parts ordinaires \$ US

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Symbole de TSX	Parts ordinaires	Parts ordinaires couvertes	Parts ordinaires	Parts ordinaires couvertes en \$ US	Parts de série FNB en \$ CA
				non couvertes (\$ CA et/ou \$ US)		
<b>FIDUCIES (suite)</b>						
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	CGXF / CGXF.U	-	4 juin 2011*	-	3 mars 2022	-
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	CGRO	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	FHI / FHI.B / FHI.U	-	7 juin 2018*	7 juin 2018	3 mars 2022	-
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	CSAV	14 juin 2019	-	-	-	-
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	FIG / FIG.U	-	22 août 2016*	-	12 déc. 2017***	-
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	WXM	15 févr. 2012	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	FXM	15 févr. 2012	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	ZXM / ZXM.B	-	18 nov. 2014*	18 nov. 2014	-	-
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	VXM / VXM.B	-	18 nov. 2014*	18 nov. 2014	-	-
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	QXM	6 févr. 2012	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI	YXM / YXM.B	-	22 oct. 2013*	22 oct. 2013	-	-
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI	XXM / XXM.B	-	22 oct. 2013*	22 oct. 2013	-	-
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI ( <i>auparavant FNB Indice MSCI Indice MSCI Monde Incidence ESG CI</i> )	CESG / CESG.B	-	12 sept. 2019*	12 sept. 2019	-	-
FNB d'actions privilégiées CI	FPR	17 mai 2016	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	TXF / TXF.B / TXF.U	-	26 oct. 2011*	31 août 2017	3 mars 2022	-
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	FLI	-	3 sept. 2014*	-	-	-
FNB Indice 1000 É.-U. CI	CUSM.B	-	-	12 août 2021	-	-
FNB Indice 500 É.-U. CI	CUSA.B	-	-	12 août 2021	-	-
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	CTIP	26 août 2021	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file américains CI	SID	-	5 juill. 2017*	-	-	-
<b>FIDUCIES ET CATÉGORIE DE SOCIÉTÉ</b>						
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	CIC	-	-	-	-	-
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI	FQC	-	-	-	-	-
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	FGB	-	-	-	-	-
Fonds (suite)		Parts de série FNB non couvertes en \$ CA	Parts de série FNB en \$ US	Parts de série FNB couvertes en \$ US	Actions de catégories de société (actions de FNB)	
<b>FIDUCIES (suite)</b>						
FNB indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1 à 5 ans CI	-	-	-	-	-	
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	-	-	-	-	-	
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	-	-	-	-	-	
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	-	-	-	-	-	
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	-	-	-	-	-	
FNB Indice d'actions canadiennes CI	-	-	-	-	-	
FNB de FPI canadiennes CI	-	-	-	-	-	
FNB de répartition de l'actif prudent CI	-	-	-	-	-	
FNB alpha Marchés émergents CI	-	-	-	26 août 2021	-	

\*Auparavant des parts ordinaires

\*\*\*Auparavant des parts ordinaires \$ US

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

	Parts de série FNB couvertes en \$ CA	Parts de série FNB non couvertes en \$ CA	Parts de série FNB en \$ US	Parts de série FNB couvertes en \$ US	Actions de catégories de société (actions de FNB)
<b>Fonds (suite)</b>					
<b>FIDUCIES (suite)</b>					
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	-	-	-	-	-
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif en actions CI	-	-	-	-	-
FNB Chaîne de blocs CI Galaxy	-	-	-	-	-
FNB Métavers CI Galaxy	-	-	-	-	-
FNB alpha Innovation mondiale CI	-	-	-	12 août 2021	-
FNB Secteur financier mondial CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	-	-	-	-	-
Fonds de lingots d'or CI	6 janv. 2021	17 mars 2021	6 janv. 2021	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	-	-	-	-	-
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	-	-	-	-	-
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI	-	-	-	-	-
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI ( <i>auparavant FNB Indice MSCI Indice MSCI Monde Incidence ESG CI</i> )	-	-	-	-	-
FNB d'actions privilégiées CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	-	-	-	-	-
FNB Indice 1000 É.-U. CI	-	-	-	-	-
FNB Indice 500 É.-U. CI	-	-	-	-	-
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	-	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file américains CI	-	-	-	-	-
<b>FIDUCIES ET CATÉGORIE DE SOCIÉTÉ (suite)</b>					
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	-	-	-	-	24 sept. 2015
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI	-	-	-	-	4 mai 2016
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	-	-	-	-	1 mars 2016

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Le 31 mars 2023, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
FNB Indice MSCI Monde Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI
FNB Indice MSCI Europe Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse 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 31 mars 2023, à la clôture des bureaux, les Fonds prorogé a acquis la totalité de l'actif net des fonds clôturés en échange de titres des fonds prorogé. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de cette fusion correspondait aux actifs net transféré du Fonds clôturés. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

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
FNB actif Crédit CI	Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI
FNB actif Services publics et infrastructures CI	Mandat privé d'infrastructures mondiales 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 31 mars 2023 et 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 du Fonds prorogés émis dans le contexte de ces fusions correspondait aux actifs nets transférés des Fonds clôturés. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont eu lieu avec un report d'impôt :

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis (\$)	Parts émises
FNB Indice MSCI Europe Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	15 717 562	762 913
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	8 292 860	402 527
FNB Indice MSCI Monde Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	27 110 944	1 315 901

Les fusions suivantes ont eu lieu sur une base de report d'impôt, à l'exception du FNB Indice MSCI Canada Pondération faible risque CI et de la Catégorie Revenu d'actions canadiennes de base CI pour lesquels les fusions ont eu lieu sur une base imposable :

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
FNB actif Crédit CI	Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	15 015 721	1 446 465
FNB actif Services publics et infrastructures CI	Mandat privé d'infrastructures mondiales CI	36 450 926	1 485 551
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 31 décembre 2022, le cas échéant. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts ou d'actions rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les périodes closes les 30 juin 2023 et 2022, sauf dans le cas des fonds lancés au cours de l'une ou l'autre de ces périodes; pour ceux-ci, les données fournies couvrent la période allant de la date de création aux 30 juin 2023 et 2022, le cas échéant.

## 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 :

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## 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 ou d'actions 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 du ou 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 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.

Le coût du lingot d'or représente la juste valeur du lingot d'or au moment de l'achat.

## 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, sauf pour le Fonds de lingots d'or CI, pour lequel le dollar américain est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation. Pour le FNB d'obligations de qualité supérieure CI, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI, le FNB alpha Marchés émergents CI, le FNB alpha Innovation mondiale CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI et le FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI, tous les renseignements sont indiqués en dollars canadiens, à l'exception de la valeur liquidative par part de la série en dollars américains, qui est indiquée en dollars américains. Pour le Fonds de lingots d'or CI, toutes les informations sont présentées en dollars américains, à l'exception de la valeur liquidative par part pour la Série FNB couverte en \$ CA et la Série FNB non couverte en \$ CA, qui est présentée en dollars canadiens.

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

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

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/des actions

La valeur liquidative par part/action de chaque série est calculée à la fin de chaque jour ouvrable de la Bourse de Toronto/NEO en divisant la valeur liquidative totale de chaque série d'un fonds par le nombre d'actions/de parts de cette série en circulation.

La valeur liquidative de chaque série est basée sur le calcul de la quote-part des actifs du Fonds revenant à cette série, moins la quote-part du passif collectif du Fonds revenant à cette série et le passif attribuable à cette série. Les charges attribuables directement à une série sont imputées à cette série. Les autres revenus et charges ainsi que les profits et les pertes sont imputés proportionnellement à chaque série en fonction de la valeur liquidative relative de chaque série.

Au 30 juin 2023, au 31 décembre 2022 et au 30 juin 2022, le cas échéant, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts/d'actions et les actifs nets attribuables aux porteurs de parts/d'actions rachetables utilisés aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

## h. Classement des parts/des actions

Les parts/actions des Fonds sont classées comme passifs financiers conformément à la norme IAS 32, *Instruments financiers : Présentation* (IAS 32), car elles ne répondent pas à la définition des instruments remboursables au gré du porteur devant être classés en capitaux propres conformément à l'IAS 32 aux fins de la présentation de l'information financière.

## i. 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) des actifs nets attribuables aux porteurs de parts/d'actions rachetables, par part/action

« L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts/d'actions rachetables par part/action » dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts/actions rachetables de chaque série d'un Fonds par le nombre moyen pondéré de parts/d'actions de cette série 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. Contrats à terme standardisés

Les contrats à terme standardisés sont évalués à chaque date d'évaluation en utilisant le cours de clôture affiché à la Bourse pertinente. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont détenus à titre de marge sur les contrats à terme standardisés qui sont présentés dans les états de la situation financière sous « Marge de variation quotidienne sur les dérivés ». Tout profit (perte) latent découlant des contrats à terme standardisés 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 ».

## m. Swaps sur défaillance

Les swaps sur défaillance sont des ententes qui aident à atténuer l'exposition au risque de crédit à l'égard d'une entité émettrice (l'« entité de référence ») ou à augmenter l'exposition au risque de crédit de l'entité de référence en créant une position de placement théorique pour le Fonds. Lorsqu'une position de placement théorique est créée, le risque de crédit auquel est exposé le Fonds est comparable au risque qui aurait découlé d'un placement direct du Fonds dans l'entité de référence. En vertu des swaps sur défaillance, l'acheteur de protection, dont l'intention est de réduire son exposition au risque de crédit à l'égard de l'entité de référence, verse une prime au vendeur de protection qui assume le risque de crédit en cas de défaillance. Cette prime est payée à intervalles réguliers sur la durée du swap. En échange de la prime versée, l'acheteur de protection a le droit de recevoir du vendeur de protection le remboursement complet d'une perte attribuable à un cas de défaillance de l'entité de référence. Un cas de défaillance peut être déclenché par une faillite, un défaut de paiement ou une restructuration de l'entité de référence. En cas de défaillance, le swap peut être réglé par la livraison physique de l'obligation pour un produit correspondant à la valeur nominale ou par le versement d'un paiement comptant correspondant au montant de la perte. Les swaps sur défaillance sont évalués en fonction des évaluations fournies par les courtiers.

Les variations dans la valeur des swaps sur défaillance sont inscrites au poste « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés », dans les états du résultat global. Les primes versées ou reçues au titre des swaps sur défaillance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ». Si un swap sur défaillance vient à échéance ou est résilié, les profits ou les pertes sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

## n. Contrats d'options

Les options négociées hors cote sont évaluées en se servant du modèle Black-Scholes, alors que les options négociées en Bourse sont évaluées au dernier cours de la Bourse. Les contrats d'options sont évalués chaque jour selon le profit ou la perte qui seraient réalisés si les contrats étaient liquidés. Tout profit (perte) latent découlant des contrats d'option 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 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 ». Toutes les primes liées aux options arrivées à échéance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ».

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## **o. Vente à découvert**

Lorsqu'un Fonds vend un titre à découvert, il emprunte ce titre d'un courtier afin de conclure la vente. Puisque le Fonds emprunte un titre du courtier, il doit avoir un compte sur marge auprès de ce dernier contenant des liquidités ou des titres liquides. Les liquidités détenues sur la marge en ce qui concerne l'activité de vente à découvert sont incluses dans le poste « Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert » dans les états de la situation financière. La perte maximale sur les titres vendus à découvert peut être illimitée. Le résultat d'une vente à découvert pour un Fonds est une perte si le prix du titre emprunté augmente entre la date de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds dénoue sa position vendeur en achetant ce titre. Le Fonds réalise un profit si le prix du titre baisse entre ces dates. Le profit ou la perte qui seraient réalisés si la position était fermée à la date d'évaluation sont indiqués dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés ». Lorsque la position vendeur est liquidée, les profits et les pertes sont réalisés et inclus au poste « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés », dans les états du résultat global. Les frais versés à un courtier pour l'emprunt de titres sont inclus dans les états du résultat global au poste « Frais d'emprunt de titres ».

## **p. 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.

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.

## **q. Placements dans des entreprises associées, des coentreprises, des filiales et des entités structurées non consolidées**

Les filiales sont des entités, y compris les investissements dans d'autres entités d'investissement, sur lesquelles 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 investissent dans un ou des FNB, qui sont présentés dans le tableau du portefeuille de placements, et ces Fonds ont déterminé que leurs investissements dans ces FNB répondent à la définition d'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.



# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## r. Lingots d'or

Le lingot d'or est mesuré à la JVRN.

Les lingots d'or sont enregistrés à la date de transaction, qui est la date à laquelle un Fonds s'engage à acheter ou à vendre le lingot d'or. Toute perte ou tout profit latent découlant des avoirs en lingots est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des lingots d'or et des dérivés », dans les états du résultat global, jusqu'au moment où les avoirs en lingots sont vendus. À ce moment, les pertes ou les profits sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente des lingots d'or et de dérivés ».

## s. 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.

## t. 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/des actionnaires 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 série du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts/des actionnaires 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.

## u. Soldes comparatifs

Les états financiers comparatifs ont été reclassés par rapport aux états présentés antérieurement dans le but de rendre leur présentation conforme à celle des états financiers de la période en cours.

## 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 :

### *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/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 auprès 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 le rendement de leurs 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/ACTIONS RACHETABLES

Chaque Fonds, sauf la FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, la Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI First Asset, est autorisé à émettre un nombre illimité de parts ordinaires rachetables et transférables, y compris les séries couvertes et non couvertes en dollars canadiens, les séries couvertes en dollars américains et les séries en dollars américains, selon le cas, dont chacune représente une participation indivise dans les actifs nets du Fonds. Dans le cas de Fonds à séries multiples, des parts entières de chaque série de parts peuvent être converties en parts entières de toute autre série de parts du Fonds en fonction de leur valeur liquidative respective, et les fractions de parts restantes sont rachetées à leur valeur liquidative.

Le capital autorisé de la société de placement, y compris : La Catégorie FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, la Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI comprennent un nombre illimité de séries d'actions à dividende non cumulatif, rachetables, sans droit de vote (chacune une « catégorie de société »), pouvant être émises dans un nombre illimité de séries, et une série d'actions avec droit de vote désignée comme les actions de catégorie J. Chaque catégorie de société est un fonds de placement

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

distinct ayant des objectifs de placement spécifiques et qui se rapporte à un portefeuille distinct de placements. Chaque catégorie de société a le droit d'émettre un nombre illimité d'actions de fonds négociés en Bourse. Les actions de FNB sont libellées en dollars canadiens.

Un courtier ou un preneur ferme désigné peut, un jour de Bourse donné, transmettre un ordre de souscription visant un multiple intégral du nombre prescrit de parts/d'actions de chaque Fonds. Un jour de Bourse est tout jour pendant lequel une séance est tenue à la Bourse de Toronto/NEO.

Si l'ordre de souscription est accepté, le Fonds émettra généralement les parts/les actions au courtier ou au preneur ferme désigné dans un délai de trois jours de Bourse suivant la date de prise d'effet de la souscription. Pour chaque nombre prescrit de parts/d'actions émises, un courtier ou un preneur ferme désigné doit remettre un paiement composé : i) d'un panier de parts/d'actions pertinentes et d'un montant au comptant suffisant pour que la valeur des parts/des actions et du montant au comptant soit égale à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de la souscription; ou ii) sur approbation du gestionnaire, d'un montant au comptant suffisant pour que sa valeur soit égale à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de la souscription, dans chaque cas plus les frais de souscription applicables établis par le gestionnaire.

Les parts/les actions de chaque Fonds peuvent également être émises aux porteurs de parts/aux actionnaires du Fonds au réinvestissement automatique de toutes les distributions conformément à la politique de distribution du Fonds.

Les porteurs de parts/les actionnaires peuvent, tout jour de Bourse, échanger un multiple intégral du nombre prescrit de parts de chaque Fonds contre des paniers de parts/d'actions et un montant au comptant ou, à la discrétion du gestionnaire, contre un montant au comptant uniquement. Le prix d'échange sera égal à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds visées par l'échange au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de l'ordre d'échange, payable généralement dans un délai de trois jours de Bourse suivant la date de prise d'effet de l'ordre d'échange par la remise : i) d'un panier de parts/d'actions et d'un montant au comptant suffisant pour que la valeur des parts/des actions et du montant au comptant soit égale à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds; ou ii) sur approbation du gestionnaire, uniquement d'un montant au comptant suffisant pour que sa valeur soit égale à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds, dans chaque cas moins les frais de rachat applicables établis par le gestionnaire. Les parts/actions seront rachetées dans le cadre de l'échange.

Les porteurs de parts/les actionnaires de chaque Fonds peuvent aussi, tout jour de Bourse, faire racheter des parts/des actions du Fonds à un prix de rachat par part/par action égal à 95 % du cours de clôture applicable des titres à la Bourse de Toronto/NEO, le jour de prise d'effet du rachat, moins tous frais de rachat applicables déterminés par le gestionnaire.

Les porteurs de parts/les actionnaires qui ont présenté un ordre de rachat avant la date de clôture des registres pour le versement d'une distribution n'auront pas droit à cette distribution.

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 leur structure du capital, les Fonds peuvent rajuster le montant des distributions versées aux porteurs de parts/aux actionnaires.

L'information se rapportant aux opérations sur actions/parts rachetables figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

Afin d'établir chacune des séries, le gestionnaire a effectué des placements initiaux dans le Fonds suivant.

Au 30 juin, le gestionnaire détenait des placements dans le Fonds suivant :

Fonds	2023 (en \$)
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	20
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	20
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	20
FNB de répartition de l'actif prudent CI	20
FNB de répartition de l'actif en actions CI	20
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	20

## 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 qu'il fournit aux Fonds, les Fonds versent au gestionnaire des frais de gestion annuels sur les actions du FNB applicables ou, dans le cas des Fonds, sur les parts ordinaires, les parts ordinaires couvertes, les parts ordinaires non couvertes, y compris en dollars canadiens et/ou en dollars américains, les parts de la série de FNB en dollars canadiens, les parts de la série de FNB en dollars américains et les parts de la série de FNB couvertes en dollars américains, calculées en pourcentage de la valeur liquidative quotidienne et payées mensuellement en arriérés. Le cas échéant, le gestionnaire paie la rémunération du conseiller ou du sous-conseiller en valeurs à même les frais de gestion qu'il reçoit.

### Frais d'administration

Le gestionnaire est responsable de tous les coûts et dépenses des Fonds suivants : FNB indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1 à 5 ans CI, FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB indiciel biorévolution CI, FNB d'obligations convertibles canadiennes CI, FNB Indice d'actions canadiennes CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB indiciel sécurité numérique CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI, Fonds de lingots d'or CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI, FNB d'épargne à intérêt élevé CI, FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI, FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI, FNB Indice Morningstar International Momentum CI, FNB Indice Morningstar International Valeur CI, FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI, FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI, FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI, FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI, FNB Indice 1000 É.-U. CI, FNB Indice 500 É.-U. CI et FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA), sauf les frais de gestion, frais de courtage et commissions, coûts de tout instrument financier utilisé pour atteindre l'objectif de placement des Fonds, coûts raisonnables associés au Comité d'examen indépendant (CEI), impôts sur le revenu, retenues d'impôt, tous les

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

biens et services applicables ou autres taxes de vente, y compris la TPS/TVH, les coûts de conformité à toute nouvelle exigence gouvernementale ou réglementaire introduite après l'établissement des Fonds, tous les coûts associés à l'impression et à la distribution de tout document que les autorités de réglementation des valeurs mobilières exigent d'envoyer aux porteurs de parts/actionnaires, tous les frais de transaction engagés par le dépositaire et toutes les dépenses extraordinaires plus les taxes applicables. Le gestionnaire paie, à même les frais de gestion, tous les autres coûts et charges liés à l'exploitation des Fonds, y compris, s'il y a lieu, les frais d'administration, les frais juridiques, les frais de comptabilité, les frais de garde, les honoraires d'audit, les honoraires de l'agent chargé de la tenue des registres, les honoraires de l'agent des transferts et les frais à payer aux autres fournisseurs de services, y compris les fournisseurs de l'indice, le cas échéant. Par conséquent, ces Fonds n'ont pas d'autres charges.

Les frais d'administration sont calculés comme un pourcentage annuel de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes d'application, y compris la TVH, la TPS et la TVQ.

## *Coûts d'exploitation*

Les Fonds suivants : FNB de FPI canadiennes CI, FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, FNB alpha Marchés émergents CI, FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI, FNB alpha innovation mondiale CI, FNB Secteur financier mondial CI, FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI, FNB d'obligations de qualité supérieure CI, FNB Indice MSCI Canada Pondération faible risqué CI, FNB d'actions privilégiées CI, Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI, FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI et FNB Indice Chefs de file américains CI, sont responsables de tous les coûts liés à leur fonctionnement et à leur administration, qui sont présentés dans leurs états du revenu global.

## *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 charges, ou à les prendre en charge, peut se poursuivre indéfiniment ou être abandonnée en tout temps sans avis aux porteurs de parts/aux actionnaires. 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 imputer à un Fonds des frais de gestion inférieurs à ceux que le gestionnaire est autrement en droit d'imputer à certains investisseurs dans un Fonds. L'écart dans le montant des frais de gestion est payé par le Fonds aux investisseurs concernés à titre de distribution de titres additionnels (distributions des frais de gestion) du Fonds. Les distributions des frais de gestion sont négociables entre le gestionnaire et l'investisseur et dépendent principalement de l'importance du placement de l'investisseur dans le Fonds. Les distributions des frais de gestion aux investisseurs admissibles n'ont pas d'incidence négative sur le Fonds ou sur tout autre investisseur dans le Fonds. Le gestionnaire peut augmenter ou diminuer le montant des distributions des frais de gestion pour certains investisseurs de temps à autre. Les rabais sur frais de gestion sont inclus 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 frais de gestion et d'administration dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir les ratios des frais de gestion de chaque série de chaque Fonds.

## **6. PRÊT DE TITRES**

Les Fonds, à l'exception du FNB d'épargne à intérêt élevé CI et Fonds de lingots d'or CI, 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**

Tous les Fonds, à l'exception de FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaïane de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB Indice MSCI Canada Pondération faible risqué CI et Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI se qualifient comme une 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.

Les FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaïane de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

CI Galaxy et FNB de répartition de l'actif de croissance CI se qualifient comme des fiducies unitaires en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et ne sont pas soumis à l'impôt sur leur revenu net, y compris les gains en capital nets réalisés pour l'année d'imposition, qui est payé ou payable à leurs porteurs de parts à la fin de l'année d'imposition. Toutefois, toute partie du revenu imposable de chacun des Fonds et du montant net des gains en capital réalisés qui n'est pas ainsi versée ou payable sera imposable pour ce Fonds. Chaque Fonds a l'intention de verser la totalité de son revenu net imposable et une partie suffisante du montant net de ses gains en capital réalisés de manière à ne pas devoir payer l'impôt sur le revenu. 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. À l'occasion, un Fonds pourra verser des distributions supérieures à ses revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

La fin de l'exercice financier pour tous les Fonds est le 15 décembre, à l'exception du FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, du FNB alpha Marchés émergents CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, du FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, du FNB indiciel métavers CI Galaxy, du FNB alpha Innovation mondiale CI, du FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, du FNB d'épargne à intérêt élevé CI, du FNB Indice 1000 É.-U. CI et du FNB Indice 500 É.-U. CI, dont la fin de l'exercice financier est le 31 décembre.

Le FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, la Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI sont des catégories de société distinctes de la société de placement. La société de placement répond à la définition de société de placement à capital variable au sens de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La société de placement calcule son revenu (sa perte) net et ses gains (pertes) en capital nets aux fins de l'impôt sur le revenu comme si elle était une seule entité. Les pertes nettes d'un Fonds peuvent servir à réduire les gains nets d'un autre Fonds afin de diminuer le résultat net ou les gains en capital nets de la Société du Fonds dans son ensemble. En tant que société de placement à capital variable, la Société est assujettie à l'impôt fédéral de la partie IV. Les dividendes imposables qu'elle reçoit de sociétés canadiennes imposables sont assujettis à un impôt de 38 1/3 %. Cet impôt est entièrement remboursable au moment du versement aux actionnaires de dividendes imposables. La Société du Fonds est également assujettie à l'impôt de la partie I sur ses autres revenus et ses gains en capital imposables de l'année. La totalité des impôts versés sur le montant net des gains en capital réalisés imposables est recouvrable lorsque ces gains sont distribués aux actionnaires sous forme de dividendes sur les gains en capital ou par voie de rachat d'actions à la demande des actionnaires, tant que la Société du Fonds est admissible à titre de société à fonds commun de placement. Par conséquent, la Société du Fonds ne comptabilise pas de charges d'impôts exigibles au titre des dividendes reçus de sociétés canadiennes imposables ni des gains en capital. Les revenus d'intérêts et les dividendes étrangers, déduction faite des frais applicables, sont imposés au plein taux d'imposition des sociétés de placement à capital variable. Des crédits pour les impôts étrangers payés sont accordés, sous réserve de certaines limites. Les impôts sur le revenu (le cas échéant) sont imputés aux Fonds de la Société sur une base raisonnable.

La fin de l'année d'imposition de la société de placement est le 31 décembre.

## Retenues d'impôts

Certains Fonds peuvent être assujettis à un impôt étranger sur le revenu, les gains en capital à la vente de titres et certaines transactions en devises dans les pays où ils investissent. Les éventuels impôts étrangers sont comptabilisés conformément à la réglementation fiscale et aux taux établis par les

autorités fiscales des pays où les Fonds investissent. Lorsqu'il est déterminé qu'un impôt sur les gains en capital s'applique, les fonds enregistrent un passif fiscal estimé d'un montant qui serait payable si les titres étaient cédés à la date d'évaluation.

## 8. DISTRIBUTIONS

Chaque Fonds verse des distributions mensuelles ou trimestrielles à ses porteurs de parts/actionnaires. Le montant des distributions est fondé sur l'évaluation par le gestionnaire des flux de trésorerie prévus des Fonds de temps à autre.

Dans le cas des Fonds, si, au cours d'une année, un Fonds dispose, après ces distributions, d'un excédent de revenus nets ou de gains en capital nets réalisés, il entend faire une distribution spéciale, au plus tard le 31 décembre de l'exercice en question, du montant restant des revenus nets ou des gains en capital nets réalisés, de façon à ne pas être assujetti à l'impôt sur le revenu en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada), compte tenu de l'ensemble des déductions, crédits et remboursements disponibles.

Dans le cas d'une société de placement, si, au cours d'une année d'imposition, après le versement des distributions régulières, la société de placement était par ailleurs assujettie à l'impôt à l'égard des gains en capital réalisés nets, ou de l'impôt remboursable à l'égard des dividendes reçus de sociétés canadiennes imposables, la société de placement entend verser, le 31 décembre de l'année en question, un dividende spécial sur les gains en capital et/ou un dividende ordinaire pour que la société de placement ne soit pas assujettie à l'impôt sur le revenu sur ces montants en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) (compte tenu de l'ensemble des déductions, des crédits et des remboursements disponibles), ou afin de recouvrer l'impôt remboursable qu'elle ne pourrait pas par ailleurs recouvrer au versement de distributions en espèces régulières.

Cette distribution spéciale des gains en capital peut être payée sous forme de parts/d'actions et consolidée par la suite. Elle est considérée comme un revenu imposable et elle augmente le coût de base ajusté des parts/des actions pour chaque porteur de parts/actionnaire. Le nombre de parts/d'actions détenues par le porteur de parts/l'actionnaire et la valeur liquidative par part/par action du Fonds ne changent pas en raison des distributions autres qu'en trésorerie.

## 9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Le gestionnaire assure la gestion et l'administration des activités et des affaires des Fonds et, sauf dans le cas de certains Fonds, est également responsable de fournir les conseils en placement et les services de gestion de portefeuille requis par les Fonds. Ces services sont fournis dans le cours normal des activités et sont comptabilisés selon le montant de la contrepartie dont ont convenu les parties. Les achats et les ventes de titres entre les fonds sont effectués sans lien de dépendance par l'entremise d'un tiers courtier indépendant.

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 Comité d'examen indépendant (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.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## 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 période.

## 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 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 période.

## 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, à savoir le risque lié à l'effet de levier et à la vente à découvert, le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque de marché (y compris l'autre risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt). Le niveau de risque

auquel chaque Fonds est exposé est fonction de l'objectif de placement et du type de placements que 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.

L'objectif d'investissement du Fonds de lingots d'or CI est de fournir aux porteurs de parts une exposition aux lingots d'or. Les prix de l'or peuvent fluctuer quotidiennement en raison de l'évolution de la conjoncture économique et des conditions du marché, des changements politiques et des cours mondiaux de l'or. L'investissement dans l'or est hautement spéculatif et volatil.

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 lié à l'effet de levier et à la vente à découvert

Lorsqu'un Fonds investit dans des produits dérivés, emprunte des espèces à des fins de placement ou a recours à la vente à découvert physique d'actions ou d'autres actifs du portefeuille, un effet de levier peut survenir dans le Fonds. Un effet de levier survient lorsque l'exposition théorique du Fonds aux actifs sous-jacents est supérieure au montant investi. Il s'agit d'une technique de placement qui amplifie les profits et les pertes. Par conséquent, toute détérioration de la valeur ou du niveau de l'actif sous-jacent, du taux ou de l'indice peut amplifier les pertes comparativement à celles qui auraient été subies si l'actif sous-jacent avait été détenu directement par le Fonds et cela peut entraîner des pertes supérieures au montant investi dans l'instrument dérivé lui-même. L'effet de levier peut accroître la volatilité, nuire à la liquidité du Fonds et contraindre celui-ci à liquider des positions à des moments défavorables.

En 2023 et en 2022, le FNB d'obligations de qualité supérieure CI, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI ont exercé un effet de levier en effectuant des ventes à découvert, lesquelles exposent les Fonds au risque lié à la vente à découvert.

Le risque lié à la vente à découvert représente le risque de perte lié à la vente à découvert. Rien ne garantit que la valeur des titres baissera durant la période de la vente à découvert pour que les Fonds réalisent un profit, et la valeur des titres vendus à découvert pourrait même s'apprécier, générant une perte pour les Fonds. Les Fonds pourraient avoir des difficultés à racheter et à rendre les titres empruntés s'il n'existe pas de marché liquide pour ceux-ci. Le prêteur peut également rappeler les titres empruntés en tout temps. Le prêteur peut faire faillite, et les Fonds pourraient perdre les biens en garantie déposés auprès du prêteur. Les Fonds atténuent ce risque en déposant les biens en garantie seulement auprès d'institutions financières réglementées ou de courtiers réglementés.

Chacun des Fonds peut emprunter des espèces jusqu'à concurrence de 20 % de sa valeur liquidative et peut vendre des titres à découvert; ainsi, la valeur marchande globale des titres vendus à découvert sera limitée à 20 % de la valeur liquidative de chaque Fonds. L'utilisation combinée de la vente à découvert et des emprunts d'espèces par chacun des Fonds est assujettie à une limite globale de 20 % de la valeur liquidative de chacun des Fonds.

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le FNB d'obligations de qualité supérieure CI a été de néant million \$ (néant % de la valeur liquidative), (1,5 million \$ au 31 décembre 2022, 0,28 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

l'effet de levier utilisé au cours de la période était de néant million \$ (néant % de la valeur liquidative), (4,3 millions \$ au 31 décembre 2022, 0,8 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le FNB d'obligations de qualité supérieure CI avait donné en garantie au courtier principal des titres correspondant à néant (7 621 000 \$ au 31 décembre 2022).

Au cours de la période close le 30 juin 2023, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI a été de néant million \$ (néant % de la valeur liquidative), (0,12 million \$ au 31 décembre 2022, 0,02 % de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier utilisé au cours de la période était de néant million \$ (néant % de la valeur liquidative), (0,13 million \$ au 31 décembre 2022, 0,02 % de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2023, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI avait donné en garantie auprès du courtier principal des titres correspondant à néant (néant au 31 décembre 2022).

## 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.

L'objectif d'investissement du Fonds de lingots d'or CI est de fournir aux porteurs de parts une exposition à l'or et le Fonds ne devrait pas avoir d'exposition à d'autres investissements ou actifs. Hormis la trésorerie et les équivalents de trésorerie, le Fonds investira la quasi-totalité de ses actifs dans l'or. La valeur liquidative du Fonds peut être plus volatile que la valeur d'un portefeuille ou d'un Fonds d'investissement plus largement diversifié et peut fluctuer considérablement sur de courtes périodes. Cela peut avoir une incidence négative sur la valeur liquidative du Fonds.

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).

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/d'actions 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.

Les passifs financiers arrivent à échéance en l'espace d'un à trois mois, sauf pour les parts/les actions 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/les actionnaires 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.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## *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 les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers portant intérêt.

## **Risques propres au Fonds de lingots d'or CI**

### *Risques liés à la source de prix*

L'or est négocié dans le monde entier et 24 heures sur 24 par le biais de transactions de gré à gré (dont les principaux centres sont à Londres, New York et Zurich), ainsi que par le biais de Bourses (dont la plus

importante est le COMEX, exploité par New York Mercantile Exchange, Inc.) Le prix de l'or est déterminé deux fois par jour (en dollars américains) par un processus d'enchères mené par l'ICE Benchmark Administration Limited et publié par la London Bullion Market Association (la LBMA). L'or détenu par le Fonds est évalué sur la base du prix de l'or déterminé par la séance de l'après-midi, qui débute à 15 heures, heure de Londres, Angleterre (le LBMA Gold Price PM), ou par tout autre prix ou indice de marché sélectionné par le gestionnaire de temps à autre.

Les divergences potentielles dans le calcul du LBMA Gold Price PM, ainsi que toute modification future du LBMA Gold Price PM, pourraient avoir une incidence sur la valeur de l'or détenu par le Fonds et pourraient avoir un effet négatif sur la valeur d'un investissement dans les parts du Fonds.

### *Risque lié à la garde de l'or*

Il existe un risque qu'une partie ou la totalité des lingots d'or du Fonds soit perdue, endommagée ou volée, nonobstant le traitement des livraisons de lingots d'or par le dépositaire d'or et le stockage des lingots d'or dans ses coffres. Les lingots d'or achetés par le Fonds sont attribués par la contrepartie concernée dans un délai et d'une manière commercialement raisonnables. Il existe une période entre le moment où le Fonds a acheté des lingots d'or et le moment où ces lingots d'or ont été entièrement attribués au Fonds, ou lorsque le Fonds rachète des parts, pendant laquelle le Fonds détiendra des lingots d'or non attribués. Le Fonds tente de limiter la durée de la période pendant laquelle les lingots d'or ne sont pas attribués. Pendant cette période, le Fonds est exposé au risque de crédit de la contrepartie et/ou des vendeurs de lingots d'or. Rien ne garantit que les pertes attribuables à la détention de lingots d'or non attribués seront récupérées par le Fonds. En outre, l'accès aux lingots d'or du Fonds pourrait être restreint par des événements naturels, des actions humaines ou des situations de pandémie. L'un ou l'autre de ces événements peut avoir un effet négatif sur les actifs du Fonds et, par conséquent, sur un investissement dans les parts du Fonds.

## **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.

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.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

---

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 DEVICES

Voici une liste des abréviations qui peuvent être utilisées dans les états financiers :

AUD	Dollar australien
MXN	Peso mexicain
BMD	Dollar des Bermudes
MYR	Ringgit malaisien
BRL	Réal brésilien
NOK	Couronne norvégienne
CAD	Dollar canadien
NZD	Dollar néo-zélandais
CHF	Franc suisse
PEN	Nouveau sol péruvien
DKK	Couronne danoise
PHP	Peso philippin
EUR	Euro
PKR	Roupie pakistanaise
GBP	Livre sterling
PLN	Zloty polonais
HKD	Dollar de Hong Kong
SEK	Couronne suédoise
IDR	Rupiah indonésienne
SGD	Dollar de Singapour
ILS	Shekel israélien
THB	Baht thaï
INR	Roupie indienne
TWD	Nouveau dollar de Taïwan
JPY	Yen japonais
USD	Dollar américain
KRW	Won sud-coréen
ZAR	Rand sud-africain



# 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 de l'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.

Morningstar® est une marque de commerce de Morningstar Inc. et est utilisée aux termes d'une licence à des fins spécifiques par Gestion mondiale d'actifs CI. FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI, FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI, FNB Indice Morningstar International Momentum CI, FNB Indice Morningstar International Valeur CI, FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI, FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI et FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI (les « Fonds Morningstar ») ne sont pas parrainés, approuvés, vendus ni promus par Morningstar ni aucune de ses filiales (collectivement, « Morningstar »), et Morningstar ne fait aucune déclaration sur les occasions d'investissement dans ce fonds.

Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI et FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI (le « Fonds MSCI ») et le fonds et les titres auxquels il est fait référence dans le présent document ne sont pas parrainés, approuvés ni promus par MSCI, et MSCI ne peut être tenue responsable de tout fonds ou titre sur lequel se basent ces derniers. Le prospectus du Fonds contient une description plus détaillée de la relation limitée entre MSCI, Gestion mondiale d'actifs CI et tout autre fonds apparenté figurant dans le prospectus des fonds.

Certaines marques de commerce de la Banque Canadienne Impériale de Commerce et/ou certaines sociétés affiliées (collectivement « CIBC ») sont utilisées aux termes de licences par Gestion mondiale d'actifs CI en relation avec le fonds. Les titres du fonds ne sont pas parrainés, promus, vendus ou soutenus de quelque façon que ce soit par la CIBC ou par l'agent de calcul de l'indice, Solactive A.G. (« Solactive »), et la CIBC ou Solactive n'offrent aucune garantie ou assurance, expresse ou implicite, quant aux résultats de l'utilisation des indices sur lesquels le Fonds est fondé, ou les indices de prix en tout temps ou à tout autre égard. Le prospectus du FNB CIBC contient une description plus détaillée de la relation limitée entre CIBC et Solactive et Gestion mondiale d'actifs CI et le FNB CIBC.

Le FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI n'est pas parrainé, avalisé, vendu ou promu par FTSE Global Debt Capital Markets Inc. (« FTDCM »), FTSE International Limited (« FTSE »), les sociétés du London Stock Exchange Group (la « Bourse ») ou TSX Inc. (conjointement avec FTDCM, FTSE et la Bourse, les « Parties concédantes »). Les Parties concédantes ne donnent aucune garantie ni ne font aucune déclaration, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir de l'utilisation de l'indice FTSE Canada 1-5 Year Laddered Government Bond<sup>MD</sup> (« l'indice ») et/ou du chiffre auquel ledit indice se situe à un moment particulier d'un jour donné ou autre. L'indice est compilé et calculé par FTDCM et tous les droits d'auteur sur les valeurs de l'indice et les listes constitutives sont détenus par FTDCM. Les parties concédantes ne sont pas responsables (que ce soit par négligence ou autrement) envers toute personne pour toute erreur dans l'indice et les parties concédantes ne sont pas tenues d'informer toute personne de toute erreur dans cet indice. L'indice FTSE Canada 1-5 Year Laddered Government Bond<sup>MD</sup> est une marque de commerce de FTSE Global Debt Capital Markets Inc. qui incorpore « FTSE<sup>MD</sup> » sous licence. « FTSE<sup>MD</sup> » est une marque de commerce des sociétés du London Stock Exchange Group et est utilisée aux termes d'une licence par FTDCM.

Le fonds n'est pas parrainé, endossé, vendu ou promu par FTSE Global Debt Capital Markets Inc. (« FTDCM »), FTSE International Limited (« FTSE »), les sociétés du London Stock Exchange Group (la « Bourse ») ou TSX Inc. (conjointement avec FTDCM, FTSE et la Bourse, les « Parties concédantes »). Les parties concédantes ne donnent aucune garantie ni ne font aucune déclaration, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir de l'utilisation de l'indice des obligations du gouvernement du Canada à court terme FTSE Canada (« l'indice ») et/ou du chiffre auquel ledit indice se situe à un moment particulier d'un jour donné ou autre. L'indice est compilé et calculé par FTDCM et tous les droits d'auteur sur les valeurs de l'indice et les listes constitutives sont détenus par FTDCM. Les parties concédantes ne sont pas responsables (que ce soit par négligence ou autrement) envers toute personne pour toute erreur dans l'indice et les parties concédantes ne sont pas tenues d'informer toute personne de toute erreur dans cet indice. « FTSE<sup>MD</sup> » est une marque de commerce des sociétés du London Stock Exchange Group et est utilisée aux termes d'une licence par FTDCM.

Solactive AG (« Solactive ») est le concédant de licence de l'indice Solactive Canada Broad Market (CA NTR), de l'indice Solactive Developed Markets Healthcare 150 CAD (CA NTR), de l'indice Solactive GBS United States 1000 CAD (CA NTR), de l'indice Solactive GBS United States 500 CAD à (CA NTR) et de l'indice Solactive U.S. Treasury Inflation-Linked Bond Hedged to CAD TR (les « Indices Solactive »). Les instruments financiers qui sont basés sur les indices Solactive ne sont pas commandités, endossés, promus ou vendus par Solactive de quelque manière que ce soit et Solactive ne fait aucune déclaration, garantie ou assurance expresse ou implicite en ce qui concerne : (a) l'opportunité d'investir dans les instruments financiers; (b) la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices Solactive; et/ou (c) les résultats obtenus ou à obtenir par toute personne ou entité de l'utilisation des indices Solactive. Solactive ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices Solactive et ne peut être tenue responsable de toute erreur ou omission à cet égard. Nonobstant les obligations de Solactive à l'égard de ses concédants, Solactive se réserve le droit de modifier les méthodes de calcul ou de publication concernant les indices Solactive et Solactive ne sera pas responsable de toute erreur de calcul ou de toute publication incorrecte, retardée ou interrompue concernant les indices Solactive. Solactive ne sera pas responsable de tout dommage, y compris, mais sans s'y limiter, toute perte de profits ou d'affaires, ou tout dommage particulier, accessoire, punitif, indirect ou consécutif subi ou encouru à la suite de l'utilisation (ou de l'incapacité à utiliser) des indices Solactive.

LE PRIX DE L'OR LBMA, QUI EST ADMINISTRÉ ET PUBLIÉ PAR ICE BENCHMARK ADMINISTRATION LIMITED (« IBA »), SERT D'ENTRÉE OU DE RÉFÉRENCE SOUS-JACENTE, OU EN FAIT PARTIE, POUR LE FONDS DE LINGOTS D'OR CI.

LE PRIX DE L'OR LBMA EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE PRECIOUS METALS PRICES LIMITED, ET EST AUTORISÉ À L'IBA EN TANT QU'ADMINISTRATEUR DU PRIX DE L'OR LBMA. ICE BENCHMARK ADMINISTRATION EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE L'IBA ET/OU DE SES AFFILIÉS. LE PRIX DE L'OR LBMA PM, ET LES MARQUES DE COMMERCE PRIX DE L'OR LBMA ET ICE BENCHMARK ADMINISTRATION, SONT UTILISÉS PAR PLACEMENTS CI INC. AVEC LA PERMISSION SOUS LICENCE DE L'IBA.

# Avis juridique

---

IBA ET SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES NE FONT AUCUNE RÉCLAMATION, PRÉDICTION, GARANTIE OU DÉCLARATION DE QUELQUE NATURE QUE CE SOIT, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS À OBTENIR DE TOUTE UTILISATION DU COURS DU PRIX DE L'OR LBMA, OU QUANT AU CARACTÈRE APPROPRIÉ OU ADÉQUAT DU PRIX DE L'OR LBMA POUR TOUT OBJECTIF PARTICULIER AUQUEL IL POURRAIT ÊTRE DESTINÉ, Y COMPRIS EN CE QUI CONCERNE LE FONDS DE LINGOTS D'OR CI. DANS TOUTE LA MESURE PERMISE PAR LA LOI APPLICABLE, TOUS LES TERMES, CONDITIONS ET GARANTIES IMPLICITES, Y COMPRIS, MAIS SANS S'Y LIMITER, EN MATIÈRE DE QUALITÉ, DE QUALITÉ MARCHANDE, D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER, DE TITRE OU D'ABSENCE DE CONTREFAÇON, EN RAPPORT AVEC LE PRIX DE L'OR LBMA, SONT EXCLUS PAR LES PRÉSENTES ET NI L'IBA NI AUCUNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES NE SERA RESPONSABLE EN MATIÈRE CONTRACTUELLE OU DÉLICTEUELLE (Y COMPRIS LA NÉGLIGENCE), POUR VIOLATION D'UNE OBLIGATION LÉGALE OU NUISANCE, OU EN VERTU DES LOIS ANTITRUST OU AUTRES, EN CE QUI CONCERNE LES INEXACTITUDES, ERREURS, OMISSIONS, RETARDS, DÉFAILLANCES, INTERRUPTIONS OU CHANGEMENTS (MATÉRIELS OU AUTRES) DU PRIX DE L'OR LBMA, OU POUR TOUT DOMMAGE, DÉPENSE OU AUTRE PERTE (DIRECTE OU INDIRECTE) QUE VOUS POURRIEZ SUBIR EN RAISON DE OU EN RELATION AVEC LE PRIX DE L'OR LBMA OU TOUTE CONFIANCE QUE VOUS POURRIEZ LUI ACCORDER.

LE PRIX DE L'OR LBMA EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE PRECIOUS METALS PRICES LIMITED, EST LICENCIÉ À ICE BENCHMARK ADMINISTRATION LIMITED (IBA) EN TANT QU'ADMINISTRATEUR DU PRIX DE L'OR LBMA, ET EST UTILISÉ PAR PLACEMENTS CI INC. AVEC LA PERMISSION SOUS LICENCE DE L'IBA. »

L'indice Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity couvert en \$ CA et l'indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds couvert en \$ CA (les « indices Alerian ») et Alerian sont des marques de service de GKD Index Partners, LLC faisant affaire sous le nom de Alerian (« Alerian ») et ont été utilisés sous licence par Gestion mondiale d'actifs CI. FNB indicel chaîne de blocs CI Galaxy et FNB indicel métavers CI Galaxy (les « FNB Galaxy ») ne sont pas émis, parrainés, endossés, vendus ou promus par Alerian ou ses affiliés. Alerian ne fait aucune déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, aux acheteurs ou aux propriétaires du FNB Galaxy ou à tout membre du public concernant l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le FNB Galaxy en particulier ou la capacité des indices Alerian à suivre la performance générale du marché. La seule relation d'Alerian avec les FNB Galaxy est la licence des marques de service et des indices Alerian, qui est déterminé, composé et calculé par Alerian sans égard à Gestion mondiale d'actifs CI ou aux FNB Galaxy. Alerian n'est pas responsable et n'a pas participé à la détermination du calendrier, des prix ou des quantités de FNB Galaxy. Alerian n'a aucune obligation ou responsabilité en ce qui concerne l'émission, l'administration, la commercialisation ou la négociation des FNB Galaxy.

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires de ces états financiers en composant le **1 800 792-9355**, en envoyant un courriel à [servicefrancais@ci.com](mailto:servicefrancais@ci.com) ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet du Fonds, est disponible à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com) ou à l'adresse [www.sedar.com](http://www.sedar.com).

**Pour plus d'informations, veuillez visit [www.ci.com](http://www.ci.com).**

SA\_F 08/23