GESTION
MONDIALE D'ACTIFS

ÉTATS FINANCIERS ANNUELS 2023

31 MARS 2023

Table des matières

Rapport de l'auditeur indépendant 1

Portefeuille(s)

Série Portefeuilles équilibrée CI 6

Série Portefeuilles croissance équilibrée CI 24

Série Portefeuilles équilibrée prudente CI 42

Série Portefeuilles prudente CI 57

Série Portefeuilles croissance CI 73

Série Portefeuilles de revenu CI 91

Série Portefeuilles croissance maximale CI 107

Notes des états financiers 124

Avis juridique 145

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

Rapport de l'auditeur indépendant

Aux porteurs de parts de

Fonds américain Synergy CI
Fonds d'occasions Asie CI
Fonds des marchés émergents CI
Fonds mondial de dividendes CI
Fonds de ressources mondiales CI
Fonds d'actions canadiennes sélect CI
Fonds d'actions mondiales Sélect CI
Fonds équilibré canadien CI
Fonds de croissance et de revenu canadien CI
Fonds mondial de croissance et de revenu CI
Fonds d'obligations canadiennes CI
Fonds d'obligations de sociétés CI
Fonds de rendement diversifié CI
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI
Fonds de revenu à taux variable CI
Fonds d'obligations mondiales CI
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI
Fonds de revenu élevé CI
Fonds d'obligations à rendement élevé CI
Fonds d'actions privilégiées CI
Fonds d'obligations à court terme CI
Fonds canadien de dividendes CI
Fonds d'actions canadiennes CI
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI
Fonds d'actions mondiales CI
Fonds de petites sociétés mondiales CI
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI
Fonds américain de dividendes CI
Fonds enregistré de dividendes américains CI
Fonds de dividendes américains en dollars US CI
Fonds de répartition de l'actif canadien CI
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI
Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI
Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI
Fonds mondial d'actions et de revenu CI
Fonds chefs de file mondiaux CI
Fonds d'actions internationales CI
Fonds équilibré mondial CI
Fonds américain de petites sociétés CI
Fonds de placements canadiens CI
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI
Fonds de gestion de dividendes mondiaux de qualité CI
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI
Fonds de valeur mondiale CI

Société membre d'Ernst & Young Global Limited

Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI
Fonds de valeur internationale CI
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI
Fonds d'obligations de marchés émergents CI
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI
Fonds d'obligations vertes mondiales CI
Fonds d'épargne à intérêt élevé CI
Fonds de revenu CI
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI
Fonds marché monétaire CI
Fonds de revenu américain en dollars US CI
Fonds marché monétaire É-U CI
Fonds de bitcoins CI
Fonds Ethereum CI
Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI
Mandat privé canadien de dividendes CI
Mandat privé d'actions canadiennes CI
Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI
Mandat privé alpha d'actions mondiales CI
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI
Mandat privé d'actif réel mondial CI
Mandat privé d'immobilier mondial CI
Mandat privé de petites sociétés mondiales CI
Mandat privé alpha d'actions internationales CI
Mandat privé croissance d'actions internationales CI
Mandat privé d'actions américaines CI
Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI
Mandat privé de revenu fixe canadien CI
Mandat privé d'obligations d'état améliorées mondiales CI
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI
Mandat privé d'obligations sans restriction mondiales CI
Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI
Fonds de gestion d'actions canadiennes Sélect CI
Fonds de gestion d'actions internationales Sélect CI
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI
Fonds de lancement Sélect CI

Société membre d'Ernst & Young Global Limited

Série Portefeuilles équilibrée CI
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI
Série Portefeuilles prudente CI
Série Portefeuilles croissance CI
Série Portefeuilles de revenu CI
Série Portefeuilles croissance maximale CI
(collectivement, les « Fonds »)

Opinion

Nous avons effectué l'audit des états financiers des Fonds, qui comprennent les états de la situation financière aux 31 mars 2023 et 2022 (le cas échéant), et les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et les tableaux des flux de trésorerie pour les périodes closes à ces dates, ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des principales méthodes comptables.

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière des Fonds aux 31 mars 2023 et 2022 (le cas échéant), ainsi que de leur performance financière et de leurs flux de trésorerie pour les périodes closes à ces dates, conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS »).

Fondement de l'opinion

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

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe à la direction. Les autres informations se composent des informations contenues dans le rapport de la direction sur le rendement des Fonds. Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune forme d'assurance que ce soit sur ces informations.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours de l'audit, ou encore si les autres informations semblent autrement comporter une anomalie significative.

Nous avons obtenu le rapport de la direction sur le rendement des Fonds avant la date du présent rapport. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans les autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait dans le présent rapport. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

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

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

Société membre d'Ernst & Young Global Limited

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

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

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

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

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

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

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

EY

Société membre d'Ernst & Young Global Limited

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

L'associée responsable de la mission d'audit au terme de laquelle le présent rapport de l'auditeur indépendant est délivré est Fraser Whale.

Toronto, Canada
Le 22 juin 2023

Ernst & Young s.r.l./s.e.n.c.r.l.
Comptables professionnels agréés
Experts-comptables autorisés

EY

Société membre d'Ernst & Young Global Limited

États de la situation financière

aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	3 063 300	3 658 697
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	42 441	34 827
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 017	1 526
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	337	1 110
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	142	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	4 292	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1 027	1 012
	3 112 556	3 697 172
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	629	1 599
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	4 420	5 337
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	117	-
Frais d'administration à payer	12	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	5 178	6 936
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 107 378	3 690 236

États de la situation financière (suite)

aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	1 767 710	2 122 900	27,22	29,49	64 941 944	71 991 443
Série AT5	2 822	4 168	5,29	6,07	533 001	687 058
Série AT8	1 724	2 105	3,22	3,82	535 172	550 659
Série E	91 569	127 284	8,80	9,53	10 411 320	13 356 786
Série EF	6 601	7 312	8,80	9,55	749 876	765 973
Série EFT5	1	259	5,92	6,78	208	38 145
Série EFT8	1	1	4,62	5,48	266	228
Série ET5	1 180	1 255	5,90	6,76	199 825	185 508
Série ET8	1	1	4,60	5,46	258	223
Série F	96 311	104 325	13,53	14,67	7 116 892	7 109 478
Série FT5	1 025	969	6,51	7,46	157 591	129 991
Série FT8	510	558	5,18	6,15	98 380	90 729
Série I	1 042 678	1 191 500	28,87	31,34	36 117 602	38 021 759
Série O	82 560	113 249	10,69	11,60	7 723 531	9 761 448
Série OT5	569	614	5,86	6,72	96 982	91 329
Série OT8	333	486	4,58	5,43	72 655	89 529
Série P	11 781	13 248	9,34	10,16	1 261 022	1 304 588
Série PT5	1	1	6,89	7,90	183	162
Série PT8	1	1	5,69	6,76	222	188

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	13 920	17 314
Intérêts aux fins des distributions	3 596	125
Distributions de revenu provenant des placements	49 555	43 750
Distributions de gains en capital provenant des placements	43 005	170 047
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	7 521	167 331
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(160 659)	(197 751)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(43 062)	200 816
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(92)	(931)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	66	780
Rabais sur frais	5 584	7 307
Autres revenus	46	-
Total des autres revenus	5 604	7 156
Total des revenus	(37 458)	207 972
Charges		
Frais de gestion (note 5)	40 200	52 047
Frais d'administration (note 5)	4 265	5 514
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	940	487
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	4	1
Retenues d'impôts	861	1 199
Taxe de vente harmonisée	4 460	6 008
Autres frais	8	4
Total des charges	50 739	65 261
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(88 197)	142 711

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(67 357)	62 577	(0,99)	0,82	67 765 621	75 878 543
Série AT5	(133)	86	(0,20)	0,12	653 874	648 502
Série AT8	(67)	62	(0,13)	0,11	530 582	537 861
Série E	(4 079)	5 255	(0,35)	0,35	11 807 483	15 594 816
Série EF	(134)	376	(0,18)	0,44	738 249	868 156
Série EFT5	(5)	15	(0,13)	0,25	38 056	61 921
Série EFT8	-	-	(0,07)	0,21	243	207
Série ET5	(32)	39	(0,17)	0,22	189 368	177 245
Série ET8	-	-	(0,14)	0,14	237	204
Série F	(2 405)	3 737	(0,33)	0,53	7 306 197	7 008 708
Série FT5	(20)	34	(0,13)	0,28	152 864	121 805
Série FT8	(11)	27	(0,12)	0,29	92 614	90 752
Série I	(11 858)	62 887	(0,33)	1,63	36 438 403	38 528 534
Série O	(1 905)	7 010	(0,22)	0,63	8 707 203	11 151 130
Série OT5	(6)	30	(0,06)	0,35	92 809	86 548
Série OT8	(10)	26	(0,12)	0,31	84 199	87 191
Série P	(175)	550	(0,14)	0,46	1 287 185	1 203 940
Série PT5	-	-	(0,07)	0,39	169	147
Série PT8	-	-	(0,05)	0,33	201	169

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT5		Série AT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 122 900	2 374 237	4 168	3 636	2 105	2 374
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(67 357)	62 577	(133)	86	(67)	62
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(14 422)	(21 180)	(60)	(40)	(40)	(20)
Profits nets réalisés	(76 149)	(129 728)	(317)	(243)	(213)	(123)
Remboursement de capital	(317)	-	(1)	(215)	(1)	(183)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(90 888)	(150 908)	(378)	(498)	(254)	(326)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	133 399	286 601	276	1 835	156	413
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	88 618	150 271	204	266	107	135
Rachat de parts rachetables	(418 962)	(599 878)	(1 315)	(1 157)	(323)	(553)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(196 945)	(163 006)	(835)	944	(60)	(5)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(355 190)	(251 337)	(1 346)	532	(381)	(269)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 767 710	2 122 900	2 822	4 168	1 724	2 105

	Série E		Série EF		Série EFT5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	127 284	164 046	7 312	9 206	259	472
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(4 079)	5 255	(134)	376	(5)	15
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(850)	(1 453)	(63)	(91)	(5)	(5)
Profits nets réalisés	(4 488)	(8 898)	(333)	(555)	(23)	(32)
Remboursement de capital	(19)	-	(1)	-	-	(22)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(5 357)	(10 351)	(397)	(646)	(28)	(59)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 975	6 127	900	531	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	5 162	10 347	375	590	-	-
Rachat de parts rachetables	(33 416)	(48 140)	(1 455)	(2 745)	(225)	(169)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(26 279)	(31 666)	(180)	(1 624)	(225)	(169)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(35 715)	(36 762)	(711)	(1 894)	(258)	(213)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	91 569	127 284	6 601	7 312	1	259

	Série EFT8		Série ET5		Série ET8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	1 255	1 290	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(32)	39	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(20)	(12)	-	-
Profits nets réalisés	-	-	(107)	(75)	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(65)	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(127)	(152)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	2	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	82	79	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	(1)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	84	78	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(75)	(35)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	1 180	1 255	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série F		Série FT5		Série FT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	104 325	99 272	969	936	558	454
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 405)	3 737	(20)	34	(11)	27
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(946)	(1 199)	(19)	(11)	(12)	(6)
Profits nets réalisés	(4 995)	(7 342)	(102)	(67)	(64)	(39)
Remboursement de capital	(21)	-	-	(49)	-	(50)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(5 962)	(8 541)	(121)	(127)	(76)	(95)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	22 171	30 299	168	139	14	244
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	5 621	8 124	36	36	26	39
Rachat de parts rachetables	(27 439)	(28 566)	(7)	(49)	(1)	(111)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	353	9 857	197	126	39	172
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(8 014)	5 053	56	33	(48)	104
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	96 311	104 325	1 025	969	510	558

	Série I		Série O		Série OT5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 191 500	1 283 475	113 249	138 421	614	625
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(11 858)	62 887	(1 905)	7 010	(6)	30
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(12 239)	(15 831)	(1 022)	(1 698)	(11)	(8)
Profits nets réalisés	(64 621)	(96 968)	(5 397)	(10 400)	(60)	(47)
Remboursement de capital	(269)	-	(23)	-	-	(31)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(77 129)	(112 799)	(6 442)	(12 098)	(71)	(86)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	58 456	77 136	2 014	10 944	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	77 035	112 756	6 442	12 098	39	53
Rachat de parts rachetables	(195 326)	(231 955)	(30 798)	(43 126)	(7)	(8)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(59 835)	(42 063)	(22 342)	(20 084)	32	45
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(148 822)	(91 975)	(30 689)	(25 172)	(45)	(11)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 042 678	1 191 500	82 560	113 249	569	614

	Série OT8		Série P		Série PT5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	486	683	13 248	12 411	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(10)	26	(175)	550	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(10)	(6)	(136)	(164)	-	-
Profits nets réalisés	(54)	(38)	(716)	(1 007)	-	-
Remboursement de capital	-	(42)	(3)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(64)	(86)	(855)	(1 171)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	1 085	2 140	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	41	58	855	1 171	-	-
Rachat de parts rachetables	(120)	(195)	(2 377)	(1 853)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(79)	(137)	(437)	1 458	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(153)	(197)	(1 467)	837	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	333	486	11 781	13 248	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série PT8		Total du Fonds	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	3 690 236	4 091 542
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(88 197)	142 711
Distributions aux porteurs de parts rachetables				
Revenu net de placement	-	-	(29 855)	(41 724)
Profits nets réalisés	-	-	(157 639)	(255 562)
Remboursement de capital	-	-	(655)	(657)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(188 149)	(297 943)
Transactions sur parts rachetables				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	220 616	416 409
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	184 643	296 023
Rachat de parts rachetables	-	-	(711 771)	(958 506)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	(306 512)	(246 074)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(582 858)	(401 306)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	3 107 378	3 690 236

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(88 197)	142 711
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(7 521)	(167 331)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	7	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	940	487
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	160 659	197 751
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 889 344	1 243 094
Achat de placements et de dérivés	(1 360 217)	(661 644)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(92 560)	(213 797)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(142)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	117	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	12	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	773	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	503 215	541 272
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 510)	(1 920)
Produit de l'émission de parts rachetables	160 961	325 501
Montant versé au rachat de parts rachetables	(653 045)	(865 443)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(495 594)	(541 862)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(7)	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	7 621	(590)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	34 827	35 418
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	42 441	34 827
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	13 060	16 318
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3 454	45
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(4)	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.

Série Portefeuilles équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	1 364 152	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	50 544 272	57 447 437	
	45 828 148	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	461 632 570	431 334 529	
	17 051 643	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	151 474 635	134 827 338	
	5 351 297	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	110 895 052	130 406 303	
	2 549 858	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	55 289 919	60 234 784	
	6 125 362	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	66 675 767	67 788 773	
	580 737	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	21 334 026	22 874 233	
	18 385 126	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	185 686 206	169 286 565	
	10 491 527	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	177 982 273	178 224 812	
	3 658 085	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	36 942 515	37 325 635	
	4 964 021	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	40 810 149	37 535 445	
	7 700 808	Fonds d'actions internationales CI (série I)	151 394 753	159 013 984	
	6 801 761	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	115 481 742	126 478 070	
	11 030 118	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	120 263 323	141 328 906	
	199 353	Fonds de métaux précieux CI (série I)	15 637 859	15 398 108	
USD	1 710 000	CI Private Markets Fund (Series I)	23 530 455	23 120 356	
	3 238 850	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	69 194 464	76 059 535	
	6 259 419	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	118 529 919	136 347 052	
USD	3 906 126	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	51 551 621	50 637 403	
	2 134 749	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	74 888 557	80 594 667	
	1 703 179	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	64 303 642	64 460 729	
			2 164 043 719	**2 200 724 664**	**70,82**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	1 938 450	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	36 733 628	36 171 477	
	935 127	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	18 682 019	19 151 401	
	4 974 130	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	31 934 142	36 510 114	
	6 554 894	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	68 874 620	66 597 723	
	11 433 857	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	109 828 858	109 765 027	
	761 064	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	20 285 646	15 403 935	
	908 700	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	11 654 895	11 336 033	
	3 516 965	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	79 244 358	87 924 125	
	1 806 436	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	39 115 732	37 104 195	
	3 246 895	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	79 092 728	83 558 843	
	2 146 038	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	72 685 852	73 823 707	
	2 904 320	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	75 344 571	77 254 912	
USD	1 452 004	iShares China Large-Cap ETF	52 702 737	57 949 182	
USD	102 038	iShares Russell 1000 Value ETF	20 203 216	20 997 317	
	1 886 132	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	27 224 798	27 914 754	
USD	450 027	iShares TIPS Bond ETF	72 113 809	67 055 317	
USD	95 747	FNB VanEck Semiconductor	33 412 920	34 057 331	
			849 134 529	**862 575 393**	**27,76**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**3 013 178 248**	**3 063 300 057**	**98,58**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(730 087)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**3 012 448 161**	**3 063 300 057**	**98,58**
Contrat(s) de change à terme				388 230	0,01
Total du portefeuille de placements			**3 012 448 161**	3 063 688 287	98,59
Autres actifs (passifs) nets				43 689 609	1,41
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**3 107 377 896**	**100,00**

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

Série Portefeuilles équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	17 863 710	USD	13 194 358	1,35	36 103
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	301 187	USD	224 359	1,34	(1 819)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	1 059 334	USD	779 539	1,36	6 534
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	271 250	USD	203 811	1,33	(4 006)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	4 942 982	USD	3 639 234	1,36	30 618
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	11 160 407	USD	8 246 474	1,35	18 153
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	9 232 571	USD	6 881 500	1,34	(65 393)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	279 346	USD	207 750	1,34	(1 230)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	5 394 400	CAD	7 198 707	0,75	86 662
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	4 944 372	USD	3 639 234	1,36	32 008
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	9 230 303	USD	6 881 500	1,34	(67 662)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	10 474 453	USD	7 831 220	1,34	(106 730)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	7 643 881	CAD	10 164 557	0,75	163 501
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	3 709 000	CAD	5 049 798	0,73	(38 369)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	271 796	USD	203 811	1,33	(3 459)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	13 135 132	USD	9 607 000	1,37	167 269
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	5 184 795	USD	3 776 500	1,37	87 143
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	3 707 310	USD	2 729 425	1,36	23 037
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	17 854 210	USD	13 194 358	1,35	26 603
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	97 865	USD	72 395	1,35	48
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	373 573	USD	278 737	1,34	(2 873)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	4 413 600	CAD	5 890 458	0,75	70 298
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	2 472 243	USD	1 819 617	1,36	16 060
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	11 732 031	USD	8 743 000	1,34	(81 107)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	11 011 269	USD	8 246 474	1,34	(130 985)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	270 938	USD	203 811	1,33	(4 317)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	2 505 538	USD	1 843 944	1,36	16 518
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	10 475 314	USD	7 831 220	1,34	(105 868)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	4 575 119	CAD	6 083 940	0,75	97 750
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	7 510 000	CAD	10 159 821	0,74	(12 656)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	279 614	USD	207 750	1,35	(961)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	5 184 533	USD	3 776 500	1,37	86 882
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	2 473 651	USD	1 819 617	1,36	17 469
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	11 159 541	USD	8 246 474	1,35	17 287
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	301 126	USD	224 359	1,34	(1 881)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	2 506 622	USD	1 843 944	1,36	17 603
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**388 230**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	1 017	(417)	-	600
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	1 017	(417)	-	600
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(629)	417	-	(212)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(629)	417	-	(212)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	1 526	(289)	-	1 237
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	1 526	(289)	-	1 237
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 599)	289	-	(1 310)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1 599)	289	-	(1 310)

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

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 31 mars 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) (%)
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	178 225	29,5
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	126 478	28,7
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	37 326	28,6
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	83 559	26,8
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	57 447	25,6
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	67 789	20,5
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	50 637	20,0
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	136 347	19,9
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	77 255	16,9
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	80 595	16,5
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	19 151	16,4
Fonds d'actions internationales CI	993 649	159 014	16,0
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	37 535	15,9
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	87 924	14,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	73 824	13,9
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	431 335	12,9
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	64 461	12,7
CI Private Markets Fund	199 700	23 120	11,6
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	134 827	11,4
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	169 287	10,7
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	37 104	9,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	141 329	9,1
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	66 598	9,1
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	109 765	8,1
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	130 406	7,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	11 336	7,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	36 510	7,1
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	36 172	6,0
Fonds de métaux précieux CI	270 947	15 398	5,7
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	60 235	4,1
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	76 060	2,8
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	15 404	2,3
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	22 874	1,9
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	27 915	1,4
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	57 949	0,7
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	34 057	0,3
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	67 055	0,2
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	20 997	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds de revenu américain en dollars US CI	235 338	97 391	41,4
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	148 601	36,1
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	335 633	113 640	33,9
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	159 469	31,0
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	238 268	23,9
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	230 142	22,1
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	75 339	19,8
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	106 728	18,7
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	89 857	18,2
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	35 530	18,0
Fonds d'obligations mondiales CI	420 519	74 862	17,8
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	393 992	15,6
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	163 793	15,5
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	149 420	14,9
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	541 183	80 848	14,9
Fonds canadien de dividendes CI	1 809 271	221 765	12,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	69 531	11,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	44 288	11,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	33 355	9,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	30 205	9,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	2 318 662	205 231	8,9
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 816 999	152 095	8,4
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 137 088	76 013	6,7
Fonds de métaux précieux CI	369 497	23 514	6,4
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI	2 090 747	110 773	5,3
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	136 139	5,2
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 225 363	110 677	5,0
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	39 216	3,5
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	37 441	1,8
Fonds de revenu CI	5 478 653	95 521	1,7
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	58 408	0,6
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	56 645	0,1

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	931	478
Paiements indirects†	337	199

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT5		Série AT8		Série E	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	71 991 443	77 226 547	687 058	547 358	550 659	549 761	13 356 786	16 508 104
Parts rachetables émises contre trésorerie	4 854 409	9 178 007	50 576	271 268	46 324	95 652	223 884	628 024
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3 338 302	4 922 373	38 212	41 442	32 526	32 719	602 159	1 049 471
Parts rachetables rachetées	(15 242 210)	(19 335 484)	(242 845)	(173 010)	(94 337)	(127 473)	(3 771 509)	(4 828 813)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	64 941 944	71 991 443	533 001	687 058	535 172	550 659	10 411 320	13 356 786

	Série EF		Série EFT5		Série EFT8		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	765 973	924 234	38 145	63 503	228	195	185 508	174 121
Parts rachetables émises contre trésorerie	104 394	52 160	15	-	-	-	451	423
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	43 813	59 879	24	57	38	33	13 866	11 146
Parts rachetables rachetées	(164 304)	(270 300)	(37 976)	(25 415)	-	-	-	(182)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	749 876	765 973	208	38 145	266	228	199 825	185 508

	Série ET8		Série F		Série FT5		Série FT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	223	193	7 109 478	6 482 911	129 991	114 482	90 729	65 421
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-	1 586 452	1 931 044	23 112	16 745	2 666	34 737
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	35	30	427 435	536 620	5 571	4 570	5 095	5 993
Parts rachetables rachetées	-	-	(2 006 473)	(1 841 097)	(1 083)	(5 806)	(110)	(15 422)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	258	223	7 116 892	7 109 478	157 591	129 991	98 380	90 729

	Série I		Série O		Série OT5		Série OT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	38 021 759	39 207 728	9 761 448	11 424 558	91 329	84 823	89 529	111 214
Parts rachetables émises contre trésorerie	1 989 079	2 306 634	186 652	867 190	-	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	2 755 217	3 499 660	621 997	1 014 059	6 825	7 594	8 867	9 918
Parts rachetables rachetées	(6 648 453)	(6 992 263)	(2 846 566)	(3 544 359)	(1 172)	(1 088)	(25 741)	(31 603)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	36 117 602	38 021 759	7 723 531	9 761 448	96 982	91 329	72 655	89 529

†*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.

Transactions sur parts rachetables (note 4) (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série P		Série PT5		Série PT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 304 588	1 170 132	162	141	188	159
Parts rachetables émises contre trésorerie	113 823	193 871	-	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	94 401	112 137	21	21	34	29
Parts rachetables rachetées	(251 790)	(171 552)	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 261 022	1 304 588	183	162	222	188

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

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	2,000	0,20
Série AT5	2,000	0,20
Série AT8	2,000	0,20
Série E	1,850	0,15
Série EF	0,850	0,15
Série EFT5	0,850	0,15
Série EFT8	0,850	0,15
Série ET5	1,850	0,15
Série ET8	1,850	0,15
Série F	0,900	0,20
Série FT5	0,900	0,20
Série FT8	0,900	0,20
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT8	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,20
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,20
Série PT8	Payés directement par les investisseurs	0,20

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	24 837
Garanties (hors trésorerie)	-	25 333

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	104	918
Charges	(38)	(138)
Revenu tiré des prêts de titres	66	780
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	36,8	15,0

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB $ CA)	36 172
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	57 447
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	19 151
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	431 335
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	134 827
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	130 406
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	60 235
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	67 789
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	22 874
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	169 287
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	178 225
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	36 510
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	66 598
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	109 765
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	37 326
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	37 535
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	15 404
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	11 336
Fonds d'actions internationales CI (série I)	159 014
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	126 478
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	87 924
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	37 104
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	83 559
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	141 329
Fonds de métaux précieux CI (série I)	15 398
CI Private Markets Fund (série I)	23 120
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	76 060
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	136 347
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	50 637
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	80 595
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	73 824
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	77 255
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	64 461

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	113 640
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	393 992
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	76 013
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	221 765
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	110 677
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	110 773
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	152 095
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	159 469
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	69 531
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	80 848
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	74 862
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	39 216
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	30 205
Fonds de revenu CI (série I)	95 521
Fonds d'actions internationales CI (série I)	149 420
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	148 601
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	163 793
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	33 355
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	35 530
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	106 728
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	205 231
Fonds de métaux précieux CI (série I)	23 514
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	136 139
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	230 142
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	238 268
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	97 391
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	89 857
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	44 288
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	75 339

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	13,87
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	5,73
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	5,45
Fonds d'actions internationales CI (série I)	5,12
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	4,55
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	4,39
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	4,34
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	4,20
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	4,07
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	3,53
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2,83
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,69
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,59
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,49
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	2,45
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,38
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	2,18
iShares TIPS Bond ETF	2,16
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	2,14
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	2,07
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	1,94
iShares China Large-Cap ETF	1,86
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	1,85
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	1,63
Autres actifs (passifs) nets	1,41
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	1,21
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	1,20
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,19
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,17
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	1,16
FNB VanEck Semiconductor	1,10
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	0,90
CI Private Markets Fund (Series I)	0,74
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	0,74
iShares Russell 1000 Value ETF	0,68
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,62
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,50
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,50
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,36
Contrat(s) de change à terme	0,01
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	10,80
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	6,50
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	6,20
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	6,00
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	5,60
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,40
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	4,30
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	4,10
Fonds d'actions internationales CI (série I)	4,00
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	4,00
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	3,70
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	3,10
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	3,00
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	3,00
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,90
Fonds de revenu CI (série I)	2,60
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,60
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,40
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	2,20
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	2,10
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	2,00
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,90
FNB VanEck Vectors Semiconductor	1,60
iShares TIPS Bond ETF	1,50
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,20
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,10
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	1,00
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
Autres actifs (passifs) nets	0,90
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,90
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	0,80
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,60
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 306 330 000 $ (365 870 000 $ au 31 mars 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.

Risque de change

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

au 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	254 797	(125 822)	128 975	4,2
Total	254 797	(125 822)	128 975	4,2

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	212 662	–	212 662	5,8
Total	212 662	–	212 662	5,8

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 12 898 000 $ (21 266 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	2 177 605	–	23 120	2 200 725
Fonds négocié(s) en bourse	862 575	–	–	862 575
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	388	–	388
Total	3 040 180	388	23 120	3 063 688

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	2 827 370	–	–	2 827 370
Fonds négocié(s) en bourse	831 327	–	–	831 327
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	(73)	–	(73)
Total	3 658 697	(73)	–	3 658 624

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	23 530	–	–	–	–	(410)	23 120
Total	–	23 530	–	–	–	–	(410)	23 120

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (410 099 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière

aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	1 677 671	1 867 664
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	22 949	32 309
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	743	733
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	184	594
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	77	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	4 003	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	570	700
	1 706 197	1 902 000
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	493	731
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	2 375	1 169
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	5	-
Frais de gestion à payer	64	-
Frais d'administration à payer	7	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	2 944	1 900
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 703 253	1 900 100

États de la situation financière (suite)

aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	968 411	1 102 091	15,22	16,81	63 613 929	65 549 498
Série AT5	2 636	3 473	5,53	6,46	476 718	537 354
Série AT6	306	452	6,41	7,58	47 633	59 587
Série AT8	207	279	3,37	4,08	61 308	68 375
Série E	43 898	53 218	8,73	9,65	5 026 553	5 516 155
Série EF	2 819	3 591	8,75	9,67	322 257	371 220
Série EFT5	47	50	5,87	6,86	7 977	7 327
Série EFT8	31	37	4,57	5,54	6 701	6 655
Série ET5	1	1	5,84	6,83	215	188
Série ET8	1	1	4,56	5,52	276	234
Série F	52 305	48 899	14,76	16,32	3 544 548	2 996 426
Série FT8	199	482	3,87	4,69	51 438	102 881
Série I	576 222	625 151	12,56	13,91	45 882 322	44 947 160
Série O	46 810	51 954	10,85	12,01	4 315 750	4 327 262
Série OT5	1	1	5,85	6,85	229	197
Série OT8	94	102	4,57	5,54	20 605	18 477
Série P	9 264	10 317	9,20	10,18	1 007 171	1 013 446
Série PT8	1	1	5,59	6,78	238	198

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	7 333	8 801
Intérêts aux fins des distributions	1 895	62
Distributions de revenu provenant des placements	22 452	16 941
Distributions de gains en capital provenant des placements	47 396	92 120
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	2 011	84 885
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(101 977)	(80 813)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(20 890)	121 996
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	545	(417)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	21	236
Rabais sur frais	3 159	3 743
Autres revenus	18	-
Total des autres revenus	3 743	3 562
Total des revenus	(17 147)	125 558
Charges		
Frais de gestion (note 5)	21 196	24 940
Frais d'administration (note 5)	2 456	2 873
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	519	168
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	7	-
Retenues d'impôts	410	410
Taxe de vente harmonisée	2 304	2 824
Autres frais	9	1
Total des charges	26 902	31 217
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(44 049)	94 341

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(34 994)	44 184	(0,55)	0,69	63 873 629	64 485 517
Série AT5	(123)	186	(0,24)	0,31	518 764	589 032
Série AT6	(21)	22	(0,42)	0,33	48 926	67 486
Série AT8	(10)	10	(0,15)	0,18	66 423	58 461
Série E	(1 610)	2 559	(0,31)	0,45	5 275 613	5 648 149
Série EF	(110)	153	(0,31)	0,45	352 078	346 856
Série EFT5	(1)	3	(0,13)	0,37	7 513	6 868
Série EFT8	(1)	(1)	(0,13)	(0,72)	6 672	1 709
Série ET5	-	-	(0,19)	0,27	199	175
Série ET8	-	-	(0,15)	0,22	251	213
Série F	(820)	2 117	(0,24)	0,78	3 440 668	2 708 165
Série FT8	(16)	22	(0,16)	0,23	98 589	95 111
Série I	(5 602)	41 139	(0,12)	0,94	45 311 534	43 985 674
Série O	(623)	3 316	(0,15)	0,78	4 284 879	4 248 081
Série OT5	-	-	(0,05)	0,43	208	179
Série OT8	(1)	6	(0,06)	0,37	19 177	17 129
Série P	(117)	625	(0,12)	0,64	994 794	975 333
Série PT8	-	-	(0,06)	0,43	213	177

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT5		Série AT6	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 102 091	1 135 833	3 473	4 359	452	611
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(34 994)	44 184	(123)	186	(21)	22
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(6 055)	(9 382)	(34)	(34)	(4)	(5)
Profits nets réalisés	(59 586)	(75 261)	(331)	(270)	(39)	(37)
Remboursement de capital	(140)	-	(1)	(203)	-	(33)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(65 781)	(84 643)	(366)	(507)	(43)	(75)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	79 504	135 339	72	233	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	64 470	84 294	133	207	24	42
Rachat de parts rachetables	(176 879)	(212 916)	(553)	(1 005)	(106)	(148)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(32 905)	6 717	(348)	(565)	(82)	(106)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(133 680)	(33 742)	(837)	(886)	(146)	(159)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	968 411	1 102 091	2 636	3 473	306	452

	Série AT8		Série E		Série EF	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	279	287	53 218	59 845	3 591	3 405
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(10)	10	(1 610)	2 559	(110)	153
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(3)	(2)	(298)	(482)	(21)	(39)
Profits nets réalisés	(34)	(13)	(2 929)	(3 870)	(203)	(311)
Remboursement de capital	-	(21)	(7)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(37)	(36)	(3 234)	(4 352)	(224)	(350)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1	122	1 292	1 725	306	898
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	15	12	3 158	4 352	219	341
Rachat de parts rachetables	(41)	(116)	(8 926)	(10 911)	(963)	(856)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(25)	18	(4 476)	(4 834)	(438)	383
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(72)	(8)	(9 320)	(6 627)	(772)	186
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	207	279	43 898	53 218	2 819	3 591

	Série EFT5		Série EFT8		Série ET5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	50	50	37	1	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)	3	(1)	(1)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(1)	(1)	(1)	-	-	-
Profits nets réalisés	(6)	(4)	(5)	-	-	-
Remboursement de capital	-	(3)	-	(1)	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(7)	(8)	(6)	(1)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	-	38	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	5	5	1	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5	5	1	38	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3)	-	(6)	36	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	47	50	31	37	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série ET8		Série F		Série FT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	48 899	42 886	482	419
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(820)	2 117	(16)	22
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(381)	(459)	(6)	(5)
Profits nets réalisés	-	-	(3 748)	(3 678)	(60)	(41)
Remboursement de capital	-	-	(9)	-	-	(39)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(4 138)	(4 137)	(66)	(85)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	15 184	13 454	14	113
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	3 804	3 814	9	13
Rachat de parts rachetables	-	-	(10 624)	(9 235)	(224)	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	8 364	8 033	(201)	126
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	3 406	6 013	(283)	63
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	52 305	48 899	199	482

	Série I		Série O		Série OT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	625 151	652 794	51 954	53 202	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 602)	41 139	(623)	3 316	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(4 829)	(7 088)	(386)	(579)	-	-
Profits nets réalisés	(47 522)	(56 863)	(3 802)	(4 641)	-	-
Remboursement de capital	(111)	-	(9)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(52 462)	(63 951)	(4 197)	(5 220)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	48 607	30 277	1 640	2 023	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	52 403	63 925	4 197	5 219	-	-
Rachat de parts rachetables	(91 875)	(99 033)	(6 161)	(6 586)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	9 135	(4 831)	(324)	656	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(48 929)	(27 643)	(5 144)	(1 248)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	576 222	625 151	46 810	51 954	1	1

	Série OT8		Série P		Série PT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	102	103	10 317	9 692	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1)	6	(117)	625	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(2)	(1)	(76)	(117)	-	-
Profits nets réalisés	(15)	(9)	(747)	(936)	-	-
Remboursement de capital	-	(8)	(2)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(17)	(18)	(825)	(1 053)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	915	2 322	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	12	13	817	1 043	-	-
Rachat de parts rachetables	(2)	(2)	(1 843)	(2 312)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	10	11	(111)	1 053	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(8)	(1)	(1 053)	625	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	94	102	9 264	10 317	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Total du Fonds	
	2023	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 900 100	1 963 491
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(44 049)	94 341
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(12 097)	(18 194)
Profits nets réalisés	(119 027)	(145 934)
Remboursement de capital	(279)	(308)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(131 403)	(164 436)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	147 535	186 544
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	129 267	163 280
Rachat de parts rachetables	(298 197)	(343 120)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(21 395)	6 704
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(196 847)	(63 391)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 703 253	1 900 100

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(44 049)	94 341
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 011)	(84 885)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	4	15
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	519	168
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	101 977	80 813
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 197 454	498 024
Achat de placements et de dérivés	(1 042 350)	(300 322)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(69 848)	(109 061)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(77)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	64	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	7	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	410	(62)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	142 100	179 031
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 133)	(1 156)
Produit de l'émission de parts rachetables	113 178	136 173
Montant versé au rachat de parts rachetables	(262 501)	(294 841)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(151 456)	(159 824)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(4)	(15)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9 356)	19 207
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	32 309	13 117
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	22 949	32 309
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 923	8 430
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 817	35
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(6)	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

Série Portefeuilles croissance équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	860 957	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	33 163 475	36 256 776	
	18 276 512	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	187 226 433	172 018 536	
	6 815 597	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	58 350 752	53 890 927	
	3 448 556	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	83 197 291	84 038 200	
	1 591 761	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	35 116 959	37 601 849	
	3 892 708	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	42 377 244	43 080 213	
	344 384	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	14 013 225	13 564 718	
	7 313 628	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	69 563 993	67 342 425	
	6 667 482	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	112 744 093	113 263 849	
	1 453 169	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	14 675 366	14 827 560	
	1 971 831	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	14 986 650	14 910 000	
	4 920 320	Fonds d'actions internationales CI (série I)	98 096 765	101 599 687	
	4 315 291	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	72 954 868	80 242 396	
	7 400 409	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	84 287 640	99 652 422	
	127 038	Fonds de métaux précieux CI (série I)	10 024 079	9 812 444	
USD	930 000	CI Private Markets Fund (Series I)	12 797 265	12 574 229	
	2 099 548	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	44 251 240	49 304 731	
	3 980 534	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	75 377 530	86 706 781	
USD	1 565 060	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	19 790 769	20 288 798	
	1 207 187	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	43 245 625	45 575 760	
	987 300	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	37 134 955	37 366 649	
			1 163 376 217	**1 193 918 950**	**70,1**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	769 700	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	14 585 815	14 362 602	
	591 746	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	11 822 909	12 118 958	
	3 158 520	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	18 353 419	23 183 537	
	2 618 610	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	26 848 587	26 605 078	
	4 542 050	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	43 629 030	43 603 680	
	484 571	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	12 984 698	9 807 717	
	579 300	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	7 430 044	7 226 768	
	2 275 972	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	50 716 261	56 899 299	
	1 142 067	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	24 711 070	23 458 056	
	2 074 630	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	51 103 301	53 390 602	
	1 383 462	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	46 339 341	47 591 093	
	1 805 728	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	46 891 584	48 032 365	
USD	921 948	iShares China Large-Cap ETF	33 230 285	36 794 756	
USD	64 504	iShares Russell 1000 Value ETF	12 837 837	13 273 594	
	1 284 412	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	18 740 871	19 009 298	
USD	179 086	iShares TIPS Bond ETF	29 036 016	26 684 329	
USD	61 035	FNB VanEck Semiconductor	20 634 283	21 710 228	
			469 895 351	**483 751 960**	**28,4**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**1 633 271 568**	**1 677 670 910**	**98,5**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(313 264)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**1 632 958 304**	**1 677 670 910**	**98,5**
Contrat(s) de change à terme				249 790	0,01
Total du portefeuille de placements			**1 632 958 304**	1 677 920 700	98,51
Autres actifs (passifs) nets				25 332 491	1,49
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**1 703 253 191**	**100,00**

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

Série Portefeuilles croissance équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	14 207 593	USD	10 493 905	1,35	28 714
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	239 544	USD	178 440	1,34	(1 447)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	756 228	USD	556 490	1,36	4 664
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	215 734	USD	162 097	1,33	(3 186)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	3 528 652	USD	2 597 944	1,36	21 857
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	8 876 237	USD	6 558 691	1,35	14 437
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	6 841 749	USD	5 099 500	1,34	(48 459)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	222 173	USD	165 230	1,34	(978)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	3 750 450	CAD	5 004 892	0,75	60 252
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	3 529 644	USD	2 597 944	1,36	22 849
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	6 840 068	USD	5 099 500	1,34	(50 141)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	8 330 675	USD	6 228 426	1,34	(84 886)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	5 401 200	CAD	7 182 322	0,75	115 530
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	3 715 000	CAD	5 057 967	0,73	(38 431)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	216 168	USD	162 097	1,33	(2 751)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	10 016 444	USD	7 326 000	1,37	127 555
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	3 838 656	USD	2 796 000	1,37	64 518
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	2 646 541	USD	1 948 458	1,36	16 445
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	14 200 038	USD	10 493 905	1,35	21 158
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	77 835	USD	57 578	1,35	38
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	297 115	USD	221 688	1,34	(2 285)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	3 068 550	CAD	4 095 334	0,75	48 875
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	1 764 862	USD	1 298 972	1,36	11 465
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	8 088 835	USD	6 028 000	1,34	(55 920)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	8 757 623	USD	6 558 691	1,34	(104 177)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	215 486	USD	162 097	1,33	(3 434)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	1 788 631	USD	1 316 338	1,36	11 792
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	8 331 360	USD	6 228 426	1,34	(84 200)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	3 232 800	CAD	4 298 939	0,75	69 070
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	5 923 000	CAD	8 012 865	0,74	(9 982)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	222 386	USD	165 230	1,35	(765)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	3 838 463	USD	2 796 000	1,37	64 324
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 765 868	USD	1 298 972	1,36	12 470
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	8 875 548	USD	6 558 691	1,35	13 749
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	239 495	USD	178 440	1,34	(1 496)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 789 405	USD	1 316 338	1,36	12 566
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**249 790**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	743	(332)	-	411
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	743	(332)	-	411
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(493)	332	-	(161)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(493)	332	-	(161)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	733	(172)	-	561
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	733	(172)	-	561
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(731)	172	-	(559)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(731)	172	-	(559)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	455 143	99 652	21,9
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	113 264	18,7
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	80 242	18,2
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	53 391	17,1
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	36 257	16,2
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	43 080	13,1
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	86 707	12,7
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	14 828	11,4
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	48 032	10,5
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	12 119	10,4
Fonds d'actions internationales CI	993 649	101 600	10,2
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	45 576	9,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	56 899	9,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	47 591	9,0
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	20 289	8,0
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	37 367	7,4
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	14 910	6,3
CI Private Markets Fund	199 700	12 574	6,3
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	23 458	5,8
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	172 018	5,2
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	84 038	4,8
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	7 227	4,7
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	53 891	4,5
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	23 183	4,5
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	67 342	4,3
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	26 605	3,7
Fonds de métaux précieux CI	270 947	9 812	3,6
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	43 604	3,2
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	37 602	2,5
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	14 363	2,4
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	49 305	1,8
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	9 808	1,5
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	13 565	1,1
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	19 009	1,0
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	36 795	0,5
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	21 710	0,2
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	26 684	0,1
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	13 274	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	576 640	126 127	21,9
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	335 633	68 450	20,4
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI	456 781	89 165	19,5
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	89 699	17,4
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	58 474	14,2
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	126 890	12,7
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	45 401	11,9
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	64 461	11,3
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	114 219	11,0
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	21 154	10,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	28 903	8,8
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	92 461	8,7
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	216 033	8,6
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	86 906	8,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	43 491	7,3
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 225 363	157 096	7,1
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	28 465	5,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	21 337	5,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	20 301	5,6
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI	2 090 747	78 039	3,7
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	90 825	3,5
Fonds de métaux précieux CI	369 497	9 973	2,7
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	28 237	2,5
Fonds de revenu CI	5 478 653	86 357	1,6
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	19 221	0,9
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	27 856	0,3
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	28 123	0,1

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	514	164
Paiements indirects†	186	68

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT5		Série AT6		Série AT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	65 549 498	64 945 967	537 354	617 489	59 587	72 974	68 375	62 454
Parts rachetables émises contre trésorerie	5 139 589	7 611 320	12 077	32 359	-	-	208	28 491
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	4 376 474	4 868 387	24 161	30 378	3 747	5 160	4 476	2 746
Parts rachetables rachetées	(11 451 632)	(11 876 176)	(96 874)	(142 872)	(15 701)	(18 547)	(11 751)	(25 316)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	63 613 929	65 549 498	476 718	537 354	47 633	59 587	61 308	68 375

	Série E		Série EF		Série EFT5		Série EFT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 516 155	5 961 714	371 220	337 969	7 327	6 688	6 655	202
Parts rachetables émises contre trésorerie	147 429	178 098	34 039	83 235	-	-	-	6 416
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	373 952	438 413	26 026	34 407	650	639	46	37
Parts rachetables rachetées	(1 010 983)	(1 062 070)	(109 028)	(84 391)	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	5 026 553	5 516 155	322 257	371 220	7 977	7 327	6 701	6 655

	Série ET5		Série ET8		Série F		Série FT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	188	166	234	200	2 996 426	2 523 931	102 881	79 311
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-	-	-	992 966	775 821	3 453	20 968
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	27	22	42	34	267 240	227 670	2 213	2 602
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-	(712 084)	(530 996)	(57 109)	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	215	188	276	234	3 544 548	2 996 426	51 438	102 881

	Série I		Série O		Série OT5		Série OT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	44 947 160	45 018 030	4 327 262	4 250 992	197	170	18 477	16 543
Parts rachetables émises contre trésorerie	3 719 017	2 011 900	146 616	158 631	-	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	4 342 071	4 494 163	402 520	424 883	32	27	2 485	2 248
Parts rachetables rachetées	(7 125 926)	(6 576 933)	(560 648)	(507 244)	-	-	(357)	(314)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	45 882 322	44 947 160	4 315 750	4 327 262	229	197	20 605	18 477

†*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.

Transactions sur parts rachetables (note 4) (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série P		Série PT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 013 446	913 400	198	166
Parts rachetables émises contre trésorerie	98 573	211 441	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	92 358	100 139	40	32
Parts rachetables rachetées	(197 206)	(211 534)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 007 171	1 013 446	238	198

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

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	2,000	0,22
Série AT5	2,000	0,22
Série AT6	2,000	0,22
Série AT8	2,000	0,22
Série E	1,850	0,15
Série EF	0,850	0,15
Série EFT5	0,850	0,15
Série EFT8	0,850	0,15
Série ET5	1,850	0,15
Série ET8	1,850	0,15
Série F	1,000	0,22
Série FT8	1,000	0,22
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT8	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,22
Série PT8	Payés directement par les investisseurs	0,22

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	2 893
Garanties (hors trésorerie)	-	2 951

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	35	278
Charges	(14)	(42)
Revenu tiré des prêts de titres	21	236
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	39,9	15,1

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB $ CA)	14 363
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	36 257
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	12 119
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	172 018
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	53 891
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	84 038
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	37 602
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	43 080
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	13 565
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	67 342
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	113 264
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	23 183
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	26 605
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	43 604
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	14 828
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	14 910
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	9 808
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	7 227
Fonds d'actions internationales CI (série I)	101 600
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	80 242
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	56 899
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	23 458
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	53 391
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	99 652
Fonds de métaux précieux CI (série I)	9 812
CI Private Markets Fund (série I)	12 574
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	49 305
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	86 707
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	20 289
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	45 576
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	47 591
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	48 032
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	37 367

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	43 491
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	28 237
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	28 903
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	92 461
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	20 301
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	21 154
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	64 461
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	21 337
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	45 401
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	68 450
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	216 033
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	157 096
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	78 039
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	89 165
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	89 699
Fonds de revenu CI (série I)	86 357
Fonds d'actions internationales CI (série I)	86 906
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	58 474
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	126 127
Fonds de métaux précieux CI (série I)	9 973
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	90 825
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	114 219
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	126 890
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	28 465

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	10,11
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	6,65
Fonds d'actions internationales CI (série I)	5,97
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	5,85
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	5,09
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	4,93
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	4,71
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	3,95
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,34
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	3,16
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,13
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	2,89
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,82
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,79
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,68
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	2,56
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	2,53
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	2,21
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	2,19
iShares China Large-Cap ETF	2,16
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	2,13
iShares TIPS Bond ETF	1,57
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	1,56
Autres actifs (passifs) nets	1,49
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,38
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,36
FNB VanEck Semiconductor	1,27
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	1,19
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,12
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	0,88
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	0,87
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	0,84
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	0,80
iShares Russell 1000 Value ETF	0,78
CI Private Markets Fund (Series I)	0,74
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,71
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,58
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,58
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,42
Contrat(s) de change à terme	0,01
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	11,40
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	8,30
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	6,70
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	6,60
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	6,00
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,90
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	4,80
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	4,70
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	4,70
Fonds d'actions internationales CI (série I)	4,60
Fonds de revenu CI (série I)	4,50
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	4,10
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	3,60
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,40
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	3,10
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,40
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2,30
Autres actifs (passifs) nets	1,60
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	1,50
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,50
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1,50
iShares TIPS Bond ETF	1,50
FNB VanEck Vectors Semiconductor	1,50
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,10
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	1,10
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,10
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,50
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 167 767 000 $ (186 766 000 $ au 31 mars 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.

Risque de change

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

au 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	132 133	(96 657)	35 476	2,1
Total	132 133	(96 657)	35 476	2,1

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	56 680	–	56 680	3,0
Total	56 680	–	56 680	3,0

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 3 548 000 $ (5 668 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	1 181 345	–	12 574	1 193 919
Fonds négocié(s) en bourse	483 752	–	–	483 752
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	250	–	250
Total	1 665 097	250	12 574	1 677 921

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	1 426 718	–	–	1 426 718
Fonds négocié(s) en bourse	440 946	–	–	440 946
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	2	–	2
Total	1 867 664	2	–	1 867 666

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	12 797	–	–	–	–	(223)	12 574
Total	–	12 797	–	–	–	–	(223)	12 574

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (223 036 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière

aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	908 248	956 242
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	12 110	64 803
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	250	262
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	99	338
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	43	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	2 146	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	231	1 242
	923 127	1 022 887
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	198	281
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	1 268	804
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	4	-
Frais de gestion à payer	40	-
Frais d'administration à payer	5	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	1 515	1 085
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	921 612	1 021 802

États de la situation financière (suite)

aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	597 135	656 615	14,62	15,55	40 836 001	42 212 936
Série AT6	434	477	6,02	6,86	71 994	69 547
Série E	37 678	46 043	8,74	9,32	4 310 790	4 940 631
Série EF	3 641	3 512	8,58	9,26	424 409	379 412
Série F	41 046	39 685	13,05	14,05	3 144 625	2 824 225
Série I	203 254	228 823	11,53	12,61	17 632 412	18 153 224
Série O	36 122	44 104	10,12	11,05	3 568 023	3 991 388
Série P	2 302	2 543	8,93	9,73	257 907	261 279

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 994	4 470
Intérêts aux fins des distributions	1 114	36
Distributions de revenu provenant des placements	16 618	13 039
Distributions de gains en capital provenant des placements	9 549	38 066
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	(6 344)	37 609
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(30 883)	(52 213)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(5 952)	41 007
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	35	(62)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	21	267
Rabais sur frais	1 702	1 906
Autres revenus	17	-
Total des autres revenus	1 775	2 111
Total des revenus	(4 177)	43 118
Charges		
Frais de gestion (note 5)	13 302	14 351
Frais d'administration (note 5)	1 551	1 665
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	255	106
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	3	-
Retenues d'impôts	268	332
Taxe de vente harmonisée	1 537	1 730
Autres frais	-	12
Total des charges	16 917	18 197
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(21 094)	24 921

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(17 452)	10 728	(0,42)	0,28	41 442 692	39 286 229
Série AT6	(13)	14	(0,18)	0,18	70 231	75 334
Série E	(1 232)	1 036	(0,27)	0,22	4 578 229	4 762 254
Série EF	(36)	96	(0,08)	0,27	449 084	369 428
Série F	(558)	867	(0,18)	0,36	3 053 658	2 457 018
Série I	(1 332)	10 420	(0,07)	0,58	17 771 391	17 974 882
Série O	(444)	1 660	(0,12)	0,46	3 746 623	3 590 338
Série P	(27)	100	(0,10)	0,40	261 412	242 967

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT6		Série E	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	656 615	640 714	477	630	46 043	48 392
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17 452)	10 728	(13)	14	(1 232)	1 036
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(3 549)	(5 808)	(7)	(5)	(266)	(432)
Profits nets réalisés	(17 847)	(34 280)	(37)	(29)	(1 336)	(2 551)
Remboursement de capital	(14)	-	-	(34)	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(21 410)	(40 088)	(44)	(68)	(1 603)	(2 983)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	79 584	133 299	-	2	1 724	4 770
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	20 634	39 786	16	30	1 526	2 978
Rachat de parts rachetables	(120 836)	(127 824)	(2)	(131)	(8 780)	(8 150)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(20 618)	45 261	14	(99)	(5 530)	(402)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(59 480)	15 901	(43)	(153)	(8 365)	(2 349)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	597 135	656 615	434	477	37 678	46 043

	Série EF		Série F		Série I	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 512	2 675	39 685	32 565	228 823	246 485
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(36)	96	(558)	867	(1 332)	10 420
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(39)	(42)	(388)	(407)	(2 894)	(3 017)
Profits nets réalisés	(197)	(247)	(1 953)	(2 404)	(14 554)	(17 809)
Remboursement de capital	-	-	(2)	-	(11)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(236)	(289)	(2 343)	(2 811)	(17 459)	(20 826)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 183	2 066	12 150	12 346	11 065	15 097
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	222	277	2 114	2 616	17 459	20 823
Rachat de parts rachetables	(1 004)	(1 313)	(10 002)	(5 898)	(35 302)	(43 176)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	401	1 030	4 262	9 064	(6 778)	(7 256)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	129	837	1 361	7 120	(25 569)	(17 662)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 641	3 512	41 046	39 685	203 254	228 823

	Série O		Série P		Total du Fonds	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	44 104	43 231	2 543	2 793	1 021 802	1 017 485
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(444)	1 660	(27)	100	(21 094)	24 921
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(504)	(513)	(30)	(31)	(7 677)	(10 255)
Profits nets réalisés	(2 532)	(3 028)	(149)	(184)	(38 605)	(60 532)
Remboursement de capital	(2)	-	-	-	(30)	(34)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 038)	(3 541)	(179)	(215)	(46 312)	(70 821)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	2 392	9 127	519	249	108 617	176 956
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	3 021	3 519	179	215	45 171	70 244
Rachat de parts rachetables	(9 913)	(9 892)	(733)	(599)	(186 572)	(196 983)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(4 500)	2 754	(35)	(135)	(32 784)	50 217
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(7 982)	873	(241)	(250)	(100 190)	4 317
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	36 122	44 104	2 302	2 543	921 612	1 021 802

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(21 094)	24 921
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	6 344	(37 609)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	9	16
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	255	106
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	30 883	52 213
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	486 987	267 099
Achat de placements et de dérivés	(452 525)	(178 139)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(26 167)	(51 105)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(43)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	40	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	5	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	239	(36)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	24 933	77 466
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 123)	(577)
Produit de l'émission de parts rachetables	91 571	152 407
Montant versé au rachat de parts rachetables	(168 065)	(173 742)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(77 617)	(21 912)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(9)	(16)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(52 684)	55 554
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	64 803	9 265
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	12 110	64 803
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3 726	4 205
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 071	32
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(3)	-
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.

Série Portefeuilles équilibrée prudente CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	332 232	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	14 275 668	13 991 022	
	17 276 131	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	173 829 249	162 602 943	
	6 468 113	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	57 735 207	51 143 372	
	1 339 349	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	27 181 910	32 638 718	
	616 257	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	13 469 587	14 557 708	
	1 480 646	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	16 111 581	16 386 160	
	140 550	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	5 163 335	5 536 040	
	6 944 702	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	69 372 380	63 945 431	
	2 570 087	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	42 999 143	43 659 346	
	1 458 249	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	14 726 659	14 879 385	
	1 812 482	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	14 774 770	13 705 081	
	1 945 679	Fonds d'actions internationales CI (série I)	37 800 560	40 176 319	
	1 689 941	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	26 998 519	31 424 288	
	3 017 889	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	33 972 512	38 668 214	
	49 365	Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 897 769	3 812 962	
USD	500 000	CI Private Markets Fund (Series I)	6 880 250	6 760 338	
	805 792	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	17 272 563	18 922 828	
	1 539 835	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	29 207 905	33 541 773	
USD	1 478 923	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	19 273 851	19 172 143	
	464 339	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	15 977 211	17 530 517	
	415 004	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	15 663 224	15 706 793	
			656 583 853	**658 761 381**	**71,48**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	724 150	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	13 722 643	13 512 639	
	226 298	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	4 521 923	4 634 583	
	1 218 655	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	7 726 780	8 944 928	
	2 471 681	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	25 776 696	25 112 279	
	4 311 135	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	41 410 968	41 386 896	
	186 994	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	4 987 020	3 784 759	
	222 950	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 859 534	2 781 301	
	878 369	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	19 688 366	21 959 225	
	440 295	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	9 536 495	9 043 659	
	832 486	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	20 317 342	21 424 027	
	538 586	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	18 113 670	18 527 358	
	702 006	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	18 169 384	18 673 360	
USD	355 698	iShares China Large-Cap ETF	12 942 987	14 195 834	
USD	24 880	iShares Russell 1000 Value ETF	4 939 866	5 119 791	
	458 767	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	6 517 763	6 789 752	
USD	169 442	iShares TIPS Bond ETF	26 787 572	25 247 345	
USD	23 472	FNB VanEck Semiconductor	7 524 472	8 349 021	
			245 543 481	**249 486 757**	**27,07**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**902 127 334**	**908 248 138**	**98,55**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(186 836)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**901 940 498**	**908 248 138**	**98,55**
Contrat(s) de change à terme				51 579	0,01
Total du portefeuille de placements			**901 940 498**	908 299 717	98,56
Autres actifs (passifs) nets				13 312 030	1,44
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**921 611 747**	**100,00**

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

Série Portefeuilles équilibrée prudente CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	3 472 115	USD	2 564 548	1,35	7 017
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	907 557	USD	676 053	1,34	(5 481)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	284 588	USD	209 422	1,36	1 755
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	817 348	USD	614 136	1,33	(12 070)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	1 327 923	USD	977 673	1,36	8 225
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 169 215	USD	1 602 842	1,35	3 528
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 394 847	USD	1 785 000	1,34	(16 962)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	841 743	USD	626 006	1,34	(3 705)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	1 276 550	CAD	1 703 528	0,75	20 508
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 328 296	USD	977 673	1,36	8 599
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 394 259	USD	1 785 000	1,34	(17 551)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 035 888	USD	1 522 131	1,34	(20 745)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	2 044 999	CAD	2 719 366	0,75	43 742
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	983 000	CAD	1 338 353	0,73	(10 169)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	818 994	USD	614 136	1,33	(10 424)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	3 672 423	USD	2 686 000	1,37	46 769
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 011 835	USD	737 000	1,37	17 006
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	995 962	USD	733 255	1,36	6 189
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	3 470 269	USD	2 564 548	1,35	5 171
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	19 022	USD	14 071	1,35	9
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	1 125 674	USD	839 908	1,34	(8 658)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	1 044 450	CAD	1 393 939	0,75	16 636
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	664 163	USD	488 837	1,36	4 315
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 125 232	USD	2 329 000	1,34	(21 606)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 140 227	USD	1 602 842	1,34	(25 459)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	816 408	USD	614 136	1,33	(13 009)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	673 108	USD	495 372	1,36	4 438
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	2 036 055	USD	1 522 131	1,34	(20 577)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 224 001	CAD	1 627 662	0,75	26 151
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 920 000	CAD	2 597 451	0,74	(3 236)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	842 550	USD	626 006	1,35	(2 897)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 011 784	USD	737 000	1,37	16 955
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	664 542	USD	488 837	1,36	4 693
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	2 169 046	USD	1 602 842	1,35	3 360
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	907 371	USD	676 053	1,34	(5 667)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	673 399	USD	495 372	1,36	4 729
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**51 579**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	250	(140)	-	110
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	250	(140)	-	110
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(198)	140	-	(58)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(198)	140	-	(58)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	262	(43)	-	219
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	262	(43)	-	219
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(281)	43	-	(238)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(281)	43	-	(238)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	14 879	11,4
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	19 172	7,6
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	43 659	7,2
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	31 424	7,1
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	21 424	6,9
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	13 991	6,3
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	13 705	5,8
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	16 386	5,0
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	33 542	4,9
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	162 603	4,9
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	51 143	4,3
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	18 673	4,1
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	63 946	4,1
Fonds d'actions internationales CI	993 649	40 176	4,0
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	4 635	4,0
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	17 531	3,6
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	25 112	3,4
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	21 959	3,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	18 527	3,5
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	41 387	3,1
CI Private Markets Fund	199 700	6 760	3,4
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	15 707	3,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	38 668	2,5
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	13 513	2,3
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	9 044	2,2
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	32 639	1,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	8 945	1,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	2 781	1,8
Fonds de métaux précieux CI	270 947	3 813	1,4
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	14 558	1,0
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	18 923	0,7
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	3 785	0,6
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	5 536	0,5
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	6 790	0,4
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	14 196	0,2
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	25 247	0,1
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	8 349	0,1
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	5 120	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds de lingots d'or CI	30 094	4 223	14,0
Fonds d'obligations mondiales CI	420 519	43 039	10,2
Fonds de revenu américain en dollars US CI	235 338	20 096	8,5
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	37 163	7,2
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	29 696	7,2
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	64 123	6,2
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	61 900	6,2
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	131 001	5,2
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	25 384	5,1
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	28 013	4,9
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	18 415	4,8
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	9 533	4,8
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	39 420	3,7
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	541 183	19 818	3,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	19 861	3,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	10 376	3,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	10 836	2,8
Fonds canadien de dividendes CI	1 809 271	48 636	2,7
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	9 656	2,7
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	26 301	2,6
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 137 088	28 905	2,5
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 816 999	44 464	2,4
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	2 318 662	40 040	1,7
Fonds de métaux précieux CI	369 497	5 754	1,6
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	37 176	1,4
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 225 363	30 771	1,4
Fonds de revenu CI	5 478 653	70 167	1,3
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	9 500	0,8
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	10 309	0,5
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	6 927	0,1
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	14 739	-

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	252	103
Paiements indirects†	91	43

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT6		Série E		Série EF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	42 212 936	39 266 496	69 547	82 513	4 940 631	4 949 428	379 412	275 176
Parts rachetables émises contre trésorerie	5 427 242	8 193 555	-	215	193 510	505 074	132 813	206 936
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	1 439 828	2 466 875	2 796	4 101	178 334	308 396	26 499	29 001
Parts rachetables rachetées	(8 244 005)	(7 713 990)	(349)	(17 282)	(1 001 685)	(822 267)	(114 315)	(131 701)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	40 836 001	42 212 936	71 994	69 547	4 310 790	4 940 631	424 409	379 412

	Série F		Série I		Série O		Série P	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 824 225	2 208 185	18 153 224	18 604 231	3 991 388	3 723 009	261 279	273 059
Parts rachetables émises contre trésorerie	914 142	830 795	912 535	1 127 567	233 632	803 184	55 534	23 746
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	165 802	180 152	1 557 885	1 604 410	306 480	309 164	20 561	21 514
Parts rachetables rachetées	(759 544)	(394 907)	(2 991 232)	(3 182 984)	(963 477)	(843 969)	(79 467)	(57 040)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 144 625	2 824 225	17 632 412	18 153 224	3 568 023	3 991 388	257 907	261 279

†*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.

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	2,000	0,22
Série AT6	2,000	0,22
Série E	1,850	0,15
Série EF	0,850	0,15
Série F	1,000	0,22
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,22

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	7 052
Garanties (hors trésorerie)	-	7 193

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	31	314
Charges	(10)	(47)
Revenu tiré des prêts de titres	21	267
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	32,6	15,0

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB $ CA)	13 513
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	13 991
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	4 635
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	162 603
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	51 143
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	32 639
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	14 558
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	16 386
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	5 536
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	63 946
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	43 659
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	8 945
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	25 112
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	41 387
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	14 879
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	13 705
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	3 785
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 781
Fonds d'actions internationales CI (série I)	40 176
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	31 424
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	21 959
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	9 044
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	21 424
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	38 668
Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 813
CI Private Markets Fund (série I)	6 760
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	18 923
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	33 542
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	19 172
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	17 531
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	18 527
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	18 673
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	15 707

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	131 001
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	28 905
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	48 636
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	30 771
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	44 464
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	37 163
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	19 861
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	19 818
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	43 039
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	9 500
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en $ US)	4 223
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	10 376
Fonds de revenu CI (série I)	70 167
Fonds d'actions internationales CI (série I)	26 301
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	29 696
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	39 420
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	9 656
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	9 533
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	28 013
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	40 040
Fonds de métaux précieux CI (série I)	5 754
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	37 176
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	64 123
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	61 900
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	20 096
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	25 384
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	10 836
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	18 415

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	17,65
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	6,94
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	5,55
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	4,74
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	4,49
Fonds d'actions internationales CI (série I)	4,36
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	4,20
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	3,64
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	3,54
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	3,41
iShares TIPS Bond ETF	2,74
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	2,72
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2,38
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,32
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,08
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	2,05
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,03
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,01
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	1,90
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	1,78
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	1,70
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	1,61
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	1,58
iShares China Large-Cap ETF	1,54
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	1,52
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	1,49
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	1,47
Autres actifs (passifs) nets	1,44
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,98
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,97
FNB VanEck Semiconductor	0,91
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	0,74
CI Private Markets Fund (Series I)	0,73
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	0,60
iShares Russell 1000 Value ETF	0,56
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,50
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,41
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,41
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,30
Contrat(s) de change à terme	0,01
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	12,80
Fonds de revenu CI (série I)	6,90
Autres actifs (passifs) nets	6,50
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	6,30
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	6,10
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	4,80
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	4,40
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	4,20
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	3,90
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,90
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	3,60
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	3,60
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	3,00
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	2,90
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	2,80
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,70
Fonds d'actions internationales CI (série I)	2,60
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,50
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,90
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	1,90
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,80
iShares TIPS Bond ETF	1,40
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,10
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1,00
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,90
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,90
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	0,90
FNB VanEck Vectors Semiconductor	0,70
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,60
Fonds de valeur mondiale CI (série FNB $ US)	0,40
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 90 825 000 $ (95 624 000 $ au 31 mars 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.

Risque de change

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

au 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	80 241	(33 380)	46 861	5,1
Total	80 241	(33 380)	46 861	5,1

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	46 367	–	46 367	4,5
Total	46 367	–	46 367	4,5

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2022) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 4 686 000 $ (4 637 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	652 001	–	6 760	658 761
Fonds négocié(s) en bourse	249 487	–	–	249 487
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	52	–	52
Total	901 488	52	6 760	908 300

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	744 616	–	–	744 616
Fonds négocié(s) en bourse	211 626	–	–	211 626
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	(19)	–	(19)
Total	956 242	(19)	–	956 223

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	6 880	–	–	–	–	(120)	6 760
Total	–	6 880	–	–	–	–	(120)	6 760

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (119 912 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière

aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	1 018 354	1 189 413
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	12 469	36 606
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	273	575
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	111	228
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	48	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	3 317	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	781	652
	1 035 353	1 227 474
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	165	565
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	1 949	2 193
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	34	-
Frais d'administration à payer	4	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	2 152	2 758
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 033 201	1 224 716

États de la situation financière (suite)

aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	518 617	622 364	13,89	14,81	37 324 745	42 026 951
Série AT6	88	202	5,38	6,14	16 263	32 934
Série E	33 178	44 481	8,25	8,80	4 022 480	5 057 166
Série EF	6 786	5 763	8,06	8,70	841 666	662 069
Série F	53 726	53 518	12,71	13,71	4 228 515	3 903 496
Série I	389 379	453 997	13,25	14,49	29 384 502	31 327 514
Série O	24 851	36 745	9,37	10,23	2 651 943	3 592 286
Série P	1 631	1 822	8,58	9,36	190 128	194 744
Série U	395	502	10,38	11,09	38 066	45 259
Série UT6	105	119	5,39	6,16	19 383	19 363
Série Z	4 445	5 203	10,87	11,60	409 014	448 722

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 552	5 560
Intérêts aux fins des distributions	1 292	39
Distributions de revenu provenant des placements	21 659	18 765
Distributions de gains en capital provenant des placements	9 300	41 393
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	(14 754)	39 063
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(37 958)	(66 087)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(15 909)	38 733
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	56	(29)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	72	517
Rabais sur frais	1 363	1 729
Autres revenus	24	-
Total des autres revenus	1 515	2 217
Total des revenus	(14 394)	40 950
Charges		
Frais de gestion (note 5)	11 770	14 197
Frais d'administration (note 5)	1 328	1 594
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	286	120
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	2	-
Retenues d'impôts	355	541
Taxe de vente harmonisée	1 400	1 719
Autres frais	1	-
Total des charges	15 143	18 172
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(29 537)	22 778

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(20 493)	5 113	(0,52)	0,12	39 465 312	42 321 968
Série AT6	(8)	18	(0,23)	0,42	32 244	42 163
Série E	(1 482)	534	(0,32)	0,10	4 650 622	5 242 429
Série EF	(87)	54	(0,12)	0,09	747 793	594 639
Série F	(1 049)	761	(0,26)	0,21	4 095 902	3 604 824
Série I	(5 505)	14 954	(0,19)	0,48	29 675 952	31 148 971
Série O	(701)	1 174	(0,23)	0,33	3 029 822	3 582 098
Série P	(26)	98	(0,14)	0,44	191 122	222 133
Série U	(16)	15	(0,40)	0,25	40 852	61 631
Série UT6	(4)	2	(0,19)	0,06	19 371	19 351
Série Z	(166)	55	(0,38)	0,12	432 504	453 422

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT6		Série E	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	622 364	664 082	202	853	44 481	49 764
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(20 493)	5 113	(8)	18	(1 482)	534
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(4 929)	(7 497)	(5)	(3)	(370)	(558)
Profits nets réalisés	(12 449)	(22 627)	(13)	(9)	(934)	(1 685)
Remboursement de capital	(9)	-	-	(16)	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(17 387)	(30 124)	(18)	(28)	(1 305)	(2 243)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	43 407	85 929	-	-	518	2 826
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	17 049	29 949	1	2	1 245	2 243
Rachat de parts rachetables	(126 323)	(132 585)	(89)	(643)	(10 279)	(8 643)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(65 867)	(16 707)	(88)	(641)	(8 516)	(3 574)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(103 747)	(41 718)	(114)	(651)	(11 303)	(5 283)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	518 617	622 364	88	202	33 178	44 481

	Série EF		Série F		Série I	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 763	4 977	53 518	47 955	453 997	481 060
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(87)	54	(1 049)	761	(5 505)	14 954
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(111)	(91)	(839)	(762)	(8 735)	(8 214)
Profits nets réalisés	(280)	(276)	(2 119)	(2 301)	(22 059)	(24 790)
Remboursement de capital	-	-	(2)	-	(17)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(391)	(367)	(2 960)	(3 063)	(30 811)	(33 004)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	2 088	2 813	11 089	14 536	18 559	30 531
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	380	367	2 843	2 957	30 780	32 992
Rachat de parts rachetables	(967)	(2 081)	(9 715)	(9 628)	(77 641)	(72 536)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1 501	1 099	4 217	7 865	(28 302)	(9 013)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 023	786	208	5 563	(64 618)	(27 063)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	6 786	5 763	53 726	53 518	389 379	453 997

	Série O		Série P		Série U	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	36 745	40 003	1 822	3 092	502	779
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(701)	1 174	(26)	98	(16)	15
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(547)	(641)	(34)	(33)	(4)	(8)
Profits nets réalisés	(1 382)	(1 935)	(85)	(100)	(10)	(24)
Remboursement de capital	(1)	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 930)	(2 576)	(119)	(133)	(14)	(32)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 366	2 948	128	149	-	2
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 924	2 576	118	133	13	31
Rachat de parts rachetables	(12 553)	(7 380)	(292)	(1 517)	(90)	(293)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(9 263)	(1 856)	(46)	(1 235)	(77)	(260)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(11 894)	(3 258)	(191)	(1 270)	(107)	(277)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	24 851	36 745	1 631	1 822	395	502

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série UT6		Série Z		Total du Fonds	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	119	132	5 203	5 813	1 224 716	1 298 510
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(4)	2	(166)	55	(29 537)	22 778
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(3)	(2)	(44)	(64)	(15 621)	(17 873)
Profits nets réalisés	(8)	(5)	(112)	(192)	(39 451)	(53 944)
Remboursement de capital	-	(8)	-	-	(30)	(24)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(11)	(15)	(156)	(256)	(55 102)	(71 841)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	134	224	77 289	139 958
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1	-	154	251	54 508	71 501
Rachat de parts rachetables	-	-	(724)	(884)	(238 673)	(236 190)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1	-	(436)	(409)	(106 876)	(24 731)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(14)	(13)	(758)	(610)	(191 515)	(73 794)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	105	119	4 445	5 203	1 033 201	1 224 716

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(29 537)	22 778
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	14 754	(39 063)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	2	3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	286	120
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	37 958	66 087
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	667 536	335 050
Achat de placements et de dérivés	(521 930)	(198 663)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(30 959)	(60 158)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(47)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	34	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	4	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	117	(4)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	138 218	126 150
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(595)	(340)
Produit de l'émission de parts rachetables	58 477	115 119
Montant versé au rachat de parts rachetables	(220 235)	(218 158)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(162 353)	(103 379)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	(3)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(24 135)	22 771
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	36 606	13 838
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	12 469	36 606
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 197	5 154
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 245	25
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.

Série Portefeuilles prudente CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	297 602	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	12 788 337	12 532 662	
	23 619 957	Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	238 474 681	222 311 034	
	8 743 149	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	78 946 252	69 132 081	
	1 197 391	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	24 290 020	29 179 350	
	587 743	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	14 619 562	13 884 132	
	1 382 933	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 106 248	15 304 779	
	126 935	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	4 663 243	4 999 736	
	9 491 089	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	94 683 003	87 392 053	
	2 311 595	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	39 348 632	39 268 226	
	1 864 279	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	18 827 103	19 022 353	
	2 444 022	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	20 034 447	18 480 470	
	1 753 085	Fonds d'actions internationales CI (série I)	33 881 547	36 199 450	
	1 520 650	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	25 760 103	28 276 326	
	2 511 112	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	27 969 340	32 174 881	
	44 420	Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 553 778	3 430 993	
USD	560 000	CI Private Markets Fund (série I)	7 705 880	7 571 579	
	720 718	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	15 577 474	16 924 987	
	1 381 459	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	26 314 893	30 091 908	
USD	2 073 793	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	27 233 671	26 883 793	
	465 789	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	15 736 777	17 585 250	
	371 013	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	14 020 051	14 041 836	
			759 535 042	**744 687 879**	**72,07**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	987 900	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	18 720 705	18 434 214	
	204 185	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4 079 651	4 181 709	
	1 096 116	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	6 663 177	8 045 491	
	3 383 765	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	36 224 402	34 379 052	
	5 897 967	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	56 653 416	56 620 484	
	167 823	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	4 513 057	3 396 738	
	200 050	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 565 821	2 495 624	
	779 786	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	17 093 347	19 494 650	
	396 623	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	8 611 000	8 146 636	
	764 227	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	19 011 722	19 667 382	
	478 195	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 257 878	16 449 908	
	631 692	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 355 434	16 803 007	
USD	320 124	iShares China Large-Cap ETF	11 756 736	12 776 083	
USD	22 279	iShares Russell 1000 Value ETF	4 386 653	4 584 559	
	410 260	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	5 852 854	6 071 848	
USD	232 343	iShares TIPS Bond ETF	36 614 472	34 619 775	
USD	21 082	FNB VanEck Semiconductor	7 258 261	7 498 894	
			272 618 586	**273 666 054**	**26,49**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**1 032 153 628**	**1 018 353 933**	**98,56**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(174 210)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**1 031 979 418**	**1 018 353 933**	**98,56**
Contrat(s) de change à terme				107 643	0,01
Total du portefeuille de placements			**1 031 979 418**	1 018 461 576	98,57
Autres actifs (passifs) nets				14 739 050	1,43
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**1 033 200 626**	**100,00**

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

Série Portefeuilles prudente CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	4 879 878	USD	3 604 338	1,35	9 862
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	82 276	USD	61 289	1,34	(497)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	297 169	USD	218 679	1,36	1 833
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	74 098	USD	55 676	1,33	(1 094)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	1 386 624	USD	1 020 892	1,36	8 589
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 048 718	USD	2 252 711	1,35	4 959
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 328 435	USD	1 735 500	1,34	(16 492)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	76 310	USD	56 752	1,34	(336)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	1 222 650	CAD	1 631 599	0,75	19 642
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 387 014	USD	1 020 892	1,36	8 979
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 327 863	USD	1 735 500	1,34	(17 064)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 861 334	USD	2 139 275	1,34	(29 156)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	2 024 355	CAD	2 691 915	0,75	43 301
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	952 000	CAD	1 296 147	0,73	(9 848)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	74 247	USD	55 676	1,33	(945)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	4 021 070	USD	2 941 000	1,37	51 207
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 331 723	USD	970 000	1,37	22 383
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 039 989	USD	765 669	1,36	6 463
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	4 877 282	USD	3 604 338	1,35	7 267
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	26 734	USD	19 776	1,35	13
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	102 050	USD	76 143	1,34	(785)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	1 000 350	CAD	1 335 082	0,75	15 933
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	693 523	USD	510 446	1,36	4 505
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 695 831	USD	2 009 000	1,34	(18 637)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 007 978	USD	2 252 711	1,34	(35 782)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	74 013	USD	55 676	1,33	(1 179)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	702 863	USD	517 270	1,36	4 634
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	2 861 570	USD	2 139 275	1,34	(28 920)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 211 645	CAD	1 611 231	0,75	25 887
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 886 000	CAD	2 551 454	0,74	(3 178)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	76 383	USD	56 752	1,35	(263)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 331 655	USD	970 000	1,37	22 316
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	693 918	USD	510 446	1,36	4 900
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	3 048 482	USD	2 252 711	1,35	4 722
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	82 259	USD	61 289	1,34	(514)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	703 167	USD	517 270	1,36	4 938
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**107 643**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	273	(110)	-	163
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	273	(110)	-	163
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(165)	110	-	(55)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(165)	110	-	(55)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	575	(143)	-	432
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	575	(143)	-	432
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(565)	143	-	(422)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(565)	143	-	(422)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	19 022	14,6
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	26 884	10,6
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	18 480	7,8
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	222 311	6,7
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	39 268	6,5
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	28 276	6,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	19 667	6,3
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	69 132	5,8
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	12 533	5,6
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	87 392	5,5
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	34 379	4,7
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	15 305	4,6
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	30 092	4,4
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	56 620	4,2
CI Private Markets Fund	199 700	7 572	3,8
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	16 803	3,7
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	4 182	3,6
Fonds d'actions internationales CI	993 649	36 199	3,6
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	17 585	3,6
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	18 434	3,1
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	19 495	3,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	16 450	3,1
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	14 042	2,8
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	32 175	2,1
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	8 147	2,0
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	29 179	1,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	8 045	1,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	2 496	1,6
Fonds de métaux précieux CI	270 947	3 431	1,3
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	13 884	0,9
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	16 925	0,6
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	3 397	0,5
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	5 000	0,4
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	6 072	0,3
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	12 776	0,2
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	34 620	0,1
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	7 499	0,1
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	4 585	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds de lingots d'or CI	30 094	6 976	23,2
Fonds d'obligations mondiales CI	420 519	59 621	14,2
Fonds de revenu américain en dollars US CI	235 338	32 016	13,6
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	90 247	9,1
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	204 282	8,1
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	541 183	37 885	7,0
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	25 069	6,1
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	60 167	5,8
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	29 488	5,7
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	10 916	5,5
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	29 553	5,2
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	25 742	5,2
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 137 088	55 263	4,9
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	17 485	4,6
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	42 828	4,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	22 365	3,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	13 735	3,6
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 816 999	62 289	3,4
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	10 476	2,9
Fonds canadien de dividendes CI	1 809 271	46 586	2,6
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	24 863	2,5
Fonds de revenu CI	5 478 653	125 249	2,3
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	2 318 662	46 372	2,0
Fonds de métaux précieux CI	369 497	7 302	2,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	6 208	1,9
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	12 045	1,1
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	26 259	1,0
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	12 393	0,6
iShares iBoxx $ High Yield Corporate Bond ETF	17 132 759	15 012	0,1
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	11 771	0,1
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	18 950	-

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	283	116
Paiements indirects†	102	48

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT6		Série E		Série EF	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	42 026 951	43 056 503	32 934	125 450	5 057 166	5 432 144	662 069	548 232
Parts rachetables émises contre trésorerie	3 113 418	5 496 351	-	-	62 900	310 965	250 045	298 438
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	1 246 638	1 938 870	89	261	153 416	244 630	48 086	40 568
Parts rachetables rachetées	(9 062 262)	(8 464 773)	(16 760)	(92 777)	(1 251 002)	(930 573)	(118 534)	(225 169)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	37 324 745	42 026 951	16 263	32 934	4 022 480	5 057 166	841 666	662 069

	Série F		Série I		Série O		Série P	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 903 496	3 356 469	31 327 514	31 827 236	3 592 286	3 750 285	194 744	316 849
Parts rachetables émises contre trésorerie	852 829	999 129	1 377 688	1 982 869	141 086	270 775	14 295	14 885
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	228 061	207 459	2 375 810	2 197 017	209 823	242 922	14 091	13 754
Parts rachetables rachetées	(755 871)	(659 561)	(5 696 510)	(4 679 608)	(1 291 252)	(671 696)	(33 002)	(150 744)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	4 228 515	3 903 496	29 384 502	31 327 514	2 651 943	3 592 286	190 128	194 744

	Série U		Série UT6		Série Z	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	45 259	67 446	19 363	19 344	448 722	481 321
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	188	-	-	12 477	18 416
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	1 298	2 684	20	19	14 388	20 745
Parts rachetables rachetées	(8 491)	(25 059)	-	-	(66 573)	(71 760)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	38 066	45 259	19 383	19 363	409 014	448 722

†*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.

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,900	0,20
Série AT6	1,900	0,20
Série E	1,850	0,15
Série EF	0,850	0,15
Série F	0,900	0,20
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,20
Série U	1,750	0,20
Série UT6	1,750	0,20
Série Z	1,800	0,20

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	26 987
Garanties (hors trésorerie)	-	27 527

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	118	608
Charges	(46)	(91)
Revenu tiré des prêts de titres	72	517
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	38,8	15,0

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB $ CA)	18 434
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	12 533
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4 182
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	222 311
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	69 132
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	29 179
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	13 884
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 305
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	5 000
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	87 392
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	39 268
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	8 045
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	34 379
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	56 620
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	19 022
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	18 480
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	3 397
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 496
Fonds d'actions internationales CI (série I)	36 199
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	28 276
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	19 495
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	8 147
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	19 667
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	32 175
Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 431
CI Private Markets Fund (série I)	7 572
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	16 925
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	30 092
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	26 884
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	17 585
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 450
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 803
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	14 042

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	204 282
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	55 263
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	46 586
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	62 289
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	29 488
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	22 365
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	37 885
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	59 621
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	12 045
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en $ US)	6 976
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	6 208
Fonds de revenu CI (série I)	125 249
Fonds d'actions internationales CI (série I)	24 863
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	25 069
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	42 828
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	10 476
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	10 916
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	29 553
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	46 372
Fonds de métaux précieux CI (série I)	7 302
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	26 259
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	60 167
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	90 247
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	32 016
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	25 742
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	13 735
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	17 485

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	21,53
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	8,47
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	6,69
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	5,48
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	3,80
Fonds d'actions internationales CI (série I)	3,50
iShares TIPS Bond ETF	3,35
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	3,33
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	3,11
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	2,91
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	2,82
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	2,74
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,60
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1,90
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1,89
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	1,84
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	1,79
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	1,78
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	1,70
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	1,64
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,63
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,59
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	1,48
Autres actifs (passifs) nets	1,43
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	1,36
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	1,34
iShares China Large-Cap ETF	1,24
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	1,21
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,79
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,78
CI Private Markets Fund (série I)	0,73
FNB VanEck Semiconductor	0,73
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	0,59
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	0,48
iShares Russell 1000 Value ETF	0,44
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	0,40
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,33
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,33
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,24
Contrat(s) de change à terme	0,01
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	16,70
Fonds de revenu CI (série I)	10,20
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	7,40
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	5,10
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	4,90
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	4,90
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	4,60
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	3,80
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	3,80
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,50
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	3,10
Autres actifs (passifs) nets	2,90
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,60
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	2,40
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,40
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	2,10
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,10
Fonds d'actions internationales CI (série I)	2,00
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	2,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,80
iShares TIPS Bond ETF	1,50
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,40
iShares iBoxx $ High Yield Corporate Bond ETF	1,20
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,10
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,00
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
FNB VanEck Vectors Semiconductor	1,00
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,90
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	0,90
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,60
Fonds de valeur mondiale CI (série FNB $ US)	0,60
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	0,50
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 101 835 000 $ (118 941 000 $ au 31 mars 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 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	94 518	(34 969)	59 549	5,8
Total	94 518	(34 969)	59 549	5,8

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	84 933	–	84 933	6,9
Total	84 933	–	84 933	6,9

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 5 955 000 $ (8 493 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	737 116	–	7 572	744 688
Fonds négocié(s) en bourse	273 666	–	–	273 666
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	108	–	108
Total	1 010 782	108	7 572	1 018 462

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	920 815	–	–	920 815
Fonds négocié(s) en bourse	268 598	–	–	268 598
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	10	–	10
Total	1 189 413	10	–	1 189 423

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	7 706	–	–	–	–	(134)	7 572
Total	–	7 706	–	–	–	–	(134)	7 572

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (134 301 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière

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

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	982 182	1 044 339
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	13 788	36 178
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	488	234
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	109	239
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	49	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	2 570	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	542	558
	999 728	1 081 548
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	310	256
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	654	3 090
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	38	-
Frais d'administration à payer	4	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	1 006	3 346
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	998 722	1 078 202

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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	566 589	622 567	16,19	17,94	34 991 529	34 700 098
Série AT5	445	489	6,95	8,15	64 038	59 992
Série AT6	49	51	7,17	8,51	6 775	5 950
Série AT8	578	660	3,66	4,45	157 728	148 280
Série E	19 875	23 805	9,31	10,32	2 133 808	2 307 532
Série EF	1 911	2 489	9,28	10,35	205 909	240 488
Série EFT5	1	1	6,22	7,35	219	189
Série EFT8	1	1	4,85	5,94	279	232
Série ET5	1	1	6,24	7,32	210	184
Série ET8	1	1	4,87	5,92	269	227
Série F	43 010	38 587	15,91	17,74	2 703 074	2 174 961
Série FT8	323	363	5,75	7,03	56 181	51 601
Série I	335 849	356 038	19,35	21,83	17 358 619	16 306 263
Série O	23 787	27 307	11,66	13,14	2 039 950	2 077 854
Série OT5	1	1	6,17	7,36	227	191
Série OT8	1	1	4,81	5,94	290	236
Série P	6 299	5 839	9,60	10,81	655 923	540 241
Série PT8	1	1	5,85	7,22	239	195

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 367	4 607
Intérêts aux fins des distributions	1 109	46
Distributions de revenu provenant des placements	10 552	7 537
Distributions de gains en capital provenant des placements	28 107	55 156
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	14 292	40 007
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(65 677)	(30 789)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(7 250)	76 564
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	282	(125)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	7	94
Rabais sur frais	1 592	1 764
Autres revenus	6	-
Total des autres revenus	1 887	1 733
Total des revenus	(5 363)	78 297
Charges		
Frais de gestion (note 5)	12 160	13 669
Frais d'administration (note 5)	1 418	1 583
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	300	92
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	3	-
Retenues d'impôts	198	177
Taxe de vente harmonisée	1 300	1 491
Autres frais	-	6
Total des charges	15 380	17 019
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(20 743)	61 278

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(17 654)	30 716	(0,51)	0,91	34 433 522	33 615 489
Série AT5	(13)	38	(0,22)	0,59	60 466	65 582
Série AT6	(2)	4	(0,23)	0,64	6 243	5 982
Série AT8	(18)	35	(0,12)	0,24	145 429	142 648
Série E	(711)	1 170	(0,32)	0,53	2 212 910	2 185 026
Série EF	(54)	72	(0,23)	0,44	233 996	161 605
Série EFT5	-	-	(0,11)	0,46	199	173
Série EFT8	-	-	(0,08)	0,37	249	210
Série ET5	-	-	(0,19)	0,37	193	171
Série ET8	-	-	(0,15)	0,30	243	207
Série F	(443)	2 051	(0,18)	1,04	2 479 364	1 975 501
Série FT8	(7)	17	(0,13)	0,40	52 788	44 753
Série I	(1 585)	24 815	(0,10)	1,64	16 288 271	15 152 984
Série O	(241)	1 972	(0,12)	0,99	2 048 648	1 991 051
Série OT5	-	9	(0,04)	1,50	204	6 027
Série OT8	-	5	(0,03)	1,13	255	4 696
Série P	(15)	374	(0,03)	0,77	587 233	477 723
Série PT8	-	-	(0,04)	0,54	211	175

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT5		Série AT6	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	622 567	613 971	489	664	51	110
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17 654)	30 716	(13)	38	(2)	4
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(2 612)	(3 317)	(3)	(3)	-	-
Profits nets réalisés	(38 385)	(38 862)	(50)	(32)	(6)	(3)
Remboursement de capital	(53)	-	-	(28)	-	(3)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(41 050)	(42 179)	(53)	(63)	(6)	(6)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	60 381	91 495	67	10	-	1
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	40 503	41 970	15	17	6	6
Rachat de parts rachetables	(98 158)	(113 406)	(60)	(177)	-	(64)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	2 726	20 059	22	(150)	6	(57)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(55 978)	8 596	(44)	(175)	(2)	(59)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	566 589	622 567	445	489	49	51

	Série AT8		Série E		Série EF	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	660	709	23 805	22 725	2 489	1 217
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(18)	35	(711)	1 170	(54)	72
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(6)	(4)	(95)	(127)	(12)	(14)
Profits nets réalisés	(86)	(43)	(1 396)	(1 489)	(170)	(163)
Remboursement de capital	-	(55)	(2)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(92)	(102)	(1 493)	(1 616)	(182)	(177)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	79	155	361	1 652	168	1 368
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	30	28	1 467	1 616	178	165
Rachat de parts rachetables	(81)	(165)	(3 554)	(1 742)	(688)	(156)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	28	18	(1 726)	1 526	(342)	1 377
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(82)	(49)	(3 930)	1 080	(578)	1 272
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	578	660	19 875	23 805	1 911	2 489

	Série EFT5		Série EFT8		Série ET5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	1	1	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	1	1	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série ET8		Série F		Série FT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	38 587	32 540	363	78
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(443)	2 051	(7)	17
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(231)	(231)	(4)	(2)
Profits nets réalisés	-	-	(3 402)	(2 701)	(54)	(27)
Remboursement de capital	-	-	(5)	-	-	(28)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(3 638)	(2 932)	(58)	(57)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	10 957	10 684	-	300
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	3 365	2 694	28	27
Rachat de parts rachetables	-	-	(5 818)	(6 450)	(3)	(2)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	8 504	6 928	25	325
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	4 423	6 047	(40)	285
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	43 010	38 587	323	363

	Série I		Série O		Série OT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	356 038	328 236	27 307	26 753	1	76
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 585)	24 815	(241)	1 972	-	9
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(2 289)	(2 535)	(170)	(193)	-	-
Profits nets réalisés	(33 635)	(29 699)	(2 500)	(2 266)	-	-
Remboursement de capital	(46)	-	(3)	-	-	(2)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(35 970)	(32 234)	(2 673)	(2 459)	-	(2)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	29 305	41 433	1 931	2 158	-	1
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	35 910	32 219	2 673	2 459	-	2
Rachat de parts rachetables	(47 849)	(38 431)	(5 210)	(3 576)	-	(85)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	17 366	35 221	(606)	1 041	-	(82)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(20 189)	27 802	(3 520)	554	-	(75)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	335 849	356 038	23 787	27 307	1	1

	Série OT8		Série P		Série PT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	264	5 839	5 404	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	5	(15)	374	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	(40)	(38)	-	-
Profits nets réalisés	-	-	(582)	(441)	-	-
Remboursement de capital	-	(2)	(1)	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	(2)	(623)	(479)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	1 044	867	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	621	479	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(266)	(567)	(806)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	(266)	1 098	540	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(263)	460	435	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	6 299	5 839	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Total du Fonds	
	2023	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 078 202	1 032 752
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(20 743)	61 278
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(5 462)	(6 464)
Profits nets réalisés	(80 266)	(75 726)
Remboursement de capital	(110)	(118)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(85 838)	(82 308)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	104 293	150 124
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	84 796	81 682
Rachat de parts rachetables	(161 988)	(165 326)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	27 101	66 480
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(79 480)	45 450
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	998 722	1 078 202

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(20 743)	61 278
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(14 292)	(40 007)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	14
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	300	92
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	65 677	30 789
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	634 051	220 673
Achat de placements et de dérivés	(587 691)	(168 793)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(38 659)	(62 693)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(49)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	38	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	4	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	130	(39)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	38 764	41 314
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 040)	(626)
Produit de l'émission de parts rachetables	82 866	122 196
Montant versé au rachat de parts rachetables	(142 982)	(135 751)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(61 156)	(14 181)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	2	(14)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(22 392)	27 133
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	36 178	9 059
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	13 788	36 178
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 169	4 451
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 060	26
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(3)	-
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.

Série Portefeuilles croissance CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	568 032	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	20 931 083	23 921 082	
	6 716 468	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	68 264 148	63 215 393	
	2 464 949	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	21 010 418	19 490 353	
	2 284 236	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	55 100 360	55 664 772	
	1 084 665	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	23 918 082	25 622 828	
	2 579 028	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	28 075 621	28 541 840	
	228 202	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	9 283 543	8 988 502	
	2 674 905	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	25 415 859	24 629 990	
	4 415 944	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	74 803 415	75 015 845	
	530 146	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	5 353 872	5 409 395	
	719 767	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	5 471 168	5 442 521	
	3 294 053	Fonds d'actions internationales CI (série I)	64 989 394	68 018 899	
	2 879 119	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	49 163 240	53 536 938	
	4 608 625	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	54 347 719	62 058 826	
	84 503	Fonds de métaux précieux CI (série I)	6 499 602	6 527 043	
USD	540 000	CI Private Markets Fund (Series I)	7 430 670	7 301 165	
	1 377 098	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	29 061 312	32 339 081	
	2 661 734	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	50 488 637	57 979 764	
USD	570 816	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	7 218 758	7 399 821	
	888 453	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	31 862 306	33 542 406	
	714 199	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	26 860 253	27 030 511	
			665 549 460	**691 676 975**	**69,25**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	280 650	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	5 318 318	5 236 929	
	387 965	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	7 751 352	7 945 523	
	2 091 927	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	12 507 088	15 354 744	
	958 947	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	9 834 141	9 742 902	
	1 663 003	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	15 974 108	15 964 829	
	320 954	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	8 541 169	6 496 109	
	385 100	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	4 939 254	4 804 123	
	1 537 367	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	32 862 310	38 434 174	
	757 988	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	16 093 183	15 569 074	
	1 423 058	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	34 814 372	36 622 397	
	919 907	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	30 745 971	31 644 801	
	1 235 383	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	31 790 869	32 861 188	
USD	610 429	iShares China Large-Cap ETF	22 258 446	24 362 096	
USD	42 809	iShares Russell 1000 Value ETF	8 518 411	8 809 210	
	842 794	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	12 484 337	12 473 351	
USD	65 305	iShares TIPS Bond ETF	10 624 498	9 730 633	
USD	40 633	FNB VanEck Semiconductor	12 600 403	14 453 210	
			277 658 230	**290 505 293**	**29,09**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**943 207 690**	**982 182 268**	**98,34**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(182 905)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**943 024 785**	**982 182 268**	**98,34**
Contrat(s) de change à terme				178 227	0,02
Total du portefeuille de placements			**943 024 785**	982 360 495	98,36
Autres actifs (passifs) nets				16 361 790	1,64
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**998 722 285**	**100,00**

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

Série Portefeuilles croissance CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	8 851 038	USD	6 537 487	1,35	17 888
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	149 231	USD	111 164	1,34	(901)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	494 936	USD	364 212	1,36	3 053
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	134 398	USD	100 983	1,33	(1 985)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	2 309 432	USD	1 700 303	1,36	14 305
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	5 529 713	USD	4 085 929	1,35	8 994
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	4 373 111	USD	3 259 500	1,34	(30 974)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	138 409	USD	102 935	1,34	(609)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	2 786 300	CAD	3 718 255	0,75	44 763
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	2 310 082	USD	1 700 303	1,36	14 955
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	4 372 037	USD	3 259 500	1,34	(32 049)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	5 189 839	USD	3 880 181	1,34	(52 882)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	3 428 767	CAD	4 559 452	0,75	73 340
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	1 786 000	CAD	2 431 637	0,73	(18 476)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	134 668	USD	100 983	1,33	(1 714)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	6 145 771	USD	4 495 000	1,37	78 263
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	2 621 572	USD	1 909 500	1,37	44 062
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 732 109	USD	1 275 227	1,36	10 763
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	8 846 331	USD	6 537 487	1,35	13 181
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	48 490	USD	35 870	1,35	24
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	185 096	USD	138 107	1,34	(1 424)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	2 279 700	CAD	3 042 523	0,75	36 310
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	1 155 067	USD	850 151	1,36	7 504
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	5 953 908	USD	4 437 000	1,34	(41 161)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	5 455 819	USD	4 085 929	1,34	(64 900)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	134 243	USD	100 983	1,33	(2 139)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	1 170 623	USD	861 517	1,36	7 718
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	5 190 266	USD	3 880 181	1,34	(52 455)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	2 052 233	CAD	2 729 035	0,75	43 847
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	3 885 000	CAD	5 255 780	0,74	(6 547)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	138 542	USD	102 935	1,35	(476)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	2 621 439	USD	1 909 500	1,37	43 930
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 155 725	USD	850 151	1,36	8 162
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	5 529 284	USD	4 085 929	1,35	8 565
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	149 200	USD	111 164	1,34	(932)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 171 130	USD	861 517	1,36	8 224
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**178 227**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	488	(204)	-	284
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	488	(204)	-	284
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(310)	204	-	(106)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(310)	204	-	(106)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	234	(33)	-	201
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	234	(33)	-	201
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(256)	33	-	(223)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(256)	33	-	(223)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	455 143	62 059	13,6
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	75 016	12,4
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	53 537	12,2
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	36 622	11,7
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	23 921	10,7
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	28 542	8,7
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	57 980	8,5
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	32 861	7,2
Fonds d'actions internationales CI	993 649	68 019	6,9
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	33 542	6,9
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	7 946	6,8
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	38 434	6,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	31 645	6,0
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	27 031	5,3
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	5 409	4,2
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	15 569	3,9
CI Private Markets Fund	199 700	7 301	3,7
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	55 665	3,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	4 804	3,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	15 355	3,0
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	7 400	2,9
Fonds de métaux précieux CI	270 947	6 527	2,4
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	5 442	2,3
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	63 215	1,9
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	25 623	1,7
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	19 490	1,6
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	24 630	1,6
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	9 743	1,3
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	15 965	1,2
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	32 339	1,2
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	6 496	1,0
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	5 237	0,9
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	8 989	0,8
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	12 473	0,6
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	24 362	0,3
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	14 453	0,1
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	9 731	-
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	8 809	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	576 640	97 705	16,9
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	47 682	11,6
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	335 633	38 093	11,3
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI	456 781	49 999	10,9
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	55 822	10,8
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	76 288	7,7
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	26 206	6,9
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	36 006	6,3
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	62 778	6,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	19 723	6,0
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	11 741	5,9
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 225 363	126 306	5,7
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	57 744	5,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	30 208	5,1
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	46 483	4,4
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	21 732	4,4
Fonds de métaux précieux CI	369 497	11 904	3,2
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	11 267	3,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	11 602	3,0
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	62 006	2,5
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	55 838	2,1
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI	2 090 747	42 997	2,1
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	15 461	1,4
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	10 930	0,5
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	7 638	0,1
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	10 180	-

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	297	90
Paiements indirects†	107	37

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT5		Série AT6		Série AT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	34 700 098	33 557 514	59 992	76 099	5 950	12 004	148 280	144 612
Parts rachetables émises contre trésorerie	3 677 647	4 865 699	10 011	1 170	-	103	21 332	30 436
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	2 598 110	2 283 908	2 224	2 001	878	674	8 142	6 039
Parts rachetables rachetées	(5 984 326)	(6 007 023)	(8 189)	(19 278)	(53)	(6 831)	(20 026)	(32 807)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	34 991 529	34 700 098	64 038	59 992	6 775	5 950	157 728	148 280

	Série E		Série EF		Série EFT5		Série EFT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 307 532	2 159 911	240 488	115 152	189	166	232	198
Parts rachetables émises contre trésorerie	38 497	155 117	16 766	123 466	-	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	163 690	153 008	20 002	15 639	30	23	47	34
Parts rachetables rachetées	(375 911)	(160 504)	(71 347)	(13 769)	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 133 808	2 307 532	205 909	240 488	219	189	279	232

	Série ET5		Série ET8		Série F		Série FT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	184	164	227	196	2 174 961	1 797 053	51 601	9 996
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-	-	-	667 875	568 355	40	38 277
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	26	20	42	31	220 399	148 703	5 092	3 653
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-	(360 161)	(339 150)	(552)	(325)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	210	184	269	227	2 703 074	2 174 961	56 181	51 601

	Série I		Série O		Série OT5		Série OT8	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	16 306 263	14 711 103	2 077 854	1 993 021	191	9 659	236	40 117
Parts rachetables émises contre trésorerie	1 476 188	1 807 295	157 908	157 929	-	72	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	1 941 051	1 450 709	239 701	184 405	36	283	54	37
Parts rachetables rachetées	(2 364 883)	(1 662 844)	(435 513)	(257 501)	-	(9 823)	-	(39 918)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	17 358 619	16 306 263	2 039 950	2 077 854	227	191	290	236

†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.

Transactions sur parts rachetables (note 4) (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série P		Série PT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	540 241	489 454	195	165
Parts rachetables émises contre trésorerie	105 520	77 161	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	68 028	43 509	44	30
Parts rachetables rachetées	(57 866)	(69 883)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	655 923	540 241	239	195

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

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	2,000	0,22
Série AT5	2,000	0,22
Série AT6	2,000	0,22
Série AT8	2,000	0,22
Série E	1,950	0,15
Série EF	0,950	0,15
Série EFT5	0,950	0,15
Série EFT8	0,950	0,15
Série ET5	1,950	0,15
Série ET8	1,950	0,15
Série F	1,000	0,22
Série FT8	1,000	0,22
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT8	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,22
Série PT8	Payés directement par les investisseurs	0,22

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	10	110
Charges	(3)	(16)
Revenu tiré des prêts de titres	7	94
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	33,3	14,5

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (Série FNB $ CA)	5 237
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	23 921
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	7 946
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	63 215
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	19 490
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	55 665
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	25 623
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	28 542
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	8 989
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	24 630
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	75 016
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	15 355
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	9 743
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	15 965
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	5 409
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	5 443
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	6 496
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	4 804
Fonds d'actions internationales CI (série I)	68 019
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	53 537
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	38 434
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	15 569
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	36 622
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	62 059
Fonds de métaux précieux CI (série I)	6 527
CI Private Markets Fund (série I)	7 301
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	32 339
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	57 980
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	7 400
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	33 542
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	31 645
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	32 861
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	27 030

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	38 093
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	62 006
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	126 306
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	42 997
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	49 999
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	55 822
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	30 208
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	15 461
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	19 723
Fonds d'actions internationales CI (série I)	57 744
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	47 682
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	46 483
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	11 267
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	11 741
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	36 006
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	97 705
Fonds de métaux précieux CI (série I)	11 904
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	55 838
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	62 778
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	76 288
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	21 732
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	11 602
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	26 206

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	7,50
Fonds d'actions internationales CI (série I)	6,80
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	6,33
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	6,21
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	5,81
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	5,57
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	5,36
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,85
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,67
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	3,36
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,29
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	3,24
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,17
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	2,86
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	2,71
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	2,57
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	2,47
iShares China Large-Cap ETF	2,44
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	2,40
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	1,95
Autres actifs (passifs) nets	1,64
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	1,60
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,56
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,54
FNB VanEck Semiconductor	1,45
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,25
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	0,98
iShares TIPS Bond ETF	0,97
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	0,90
iShares Russell 1000 Value ETF	0,88
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,80
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	0,74
CI Private Markets Fund (Series I)	0,73
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,65
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,65
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	0,54
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	0,54
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en $ CA)	0,52
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,48
Contrat(s) de change à terme	0,02
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	11,70
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	9,10
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	7,10
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	5,80
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	5,80
Fonds d'actions internationales CI (série I)	5,40
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	5,20
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	5,20
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	4,60
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	4,40
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,30
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	4,00
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	3,50
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,30
Autres actifs (passifs) nets	3,10
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2,80
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,40
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1,80
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,40
Fonds de métaux précieux CI (série I)	1,10
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	1,10
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,10
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,00
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
iShares TIPS Bond ETF	0,90
FNB VanEck Vectors Semiconductor	0,70
Contrat(s) de change à terme	0,20
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 98 218 000 $ (104 434 000 $ au 31 mars 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 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	72 513	(61 477)	11 036	1,1
Total	72 513	(61 477)	11 036	1,1

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	18 473	–	18 473	1,7
Total	18 473	–	18 473	1,7

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 1 104 000 $ (1 847 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	684 376	–	7 301	691 677
Fonds négocié(s) en bourse	290 505	–	–	290 505
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	178	–	178
Total	974 881	178	7 301	982 360

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	806 894	–	–	806 894
Fonds négocié(s) en bourse	237 445	–	–	237 445
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	(22)	–	(22)
Total	1 044 339	(22)	–	1 044 317

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	7 431	–	–	–	–	(130)	7 301
Total	–	7 431	–	–	–	–	(130)	7 301

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (129 505 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière
aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	1 762 614	2 052 666
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	25 248	70 213
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	564	442
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	120	1 025
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	87	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	2 980	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	868	1 628
	1 792 481	2 125 974
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	359	484
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	3 063	2 874
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	67	-
Frais d'administration à payer	8	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	3 497	3 358
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 788 984	2 122 616

États de la situation financière (suite)
aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	1 173 371	1 341 907	10,00	10,80	117 346 420	124 307 055
Série E	71 523	84 680	8,03	8,67	8 909 774	9 765 964
Série EF	5 535	6 903	8,07	8,72	686 000	792 083
Série F	107 783	117 583	10,01	10,81	10 763 687	10 879 035
Série I	311 015	431 666	9,63	10,39	32 308 419	41 536 455
Série O	111 851	131 408	7,67	8,48	14 589 751	15 497 874
Série P	5 698	5 088	8,26	8,93	689 868	569 695
Série Y	2	185	8,79	9,48	182	19 562
Série Z	2 206	3 196	8,81	9,48	250 422	337 065

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	11 259	7 740
Intérêts aux fins des distributions	2 253	35
Distributions de revenu provenant des placements	49 064	46 049
Distributions de gains en capital provenant des placements	24 179	37 903
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	3 865	34 003
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(118 094)	(65 349)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(27 474)	60 381
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	330	(33)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	535	1 890
Rabais sur frais	3 792	4 209
Autres revenus	102	-
Total des autres revenus	4 759	6 066
Total des revenus	(22 715)	66 447
Charges		
Frais de gestion (note 5)	22 619	26 317
Frais d'administration (note 5)	2 574	2 984
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	334	157
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	3	-
Retenues d'impôts	1 085	1 526
Taxe de vente harmonisée	2 466	3 165
Autres frais	-	3
Total des charges	29 082	34 153
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(51 797)	32 294

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(37 540)	13 732	(0,31)	0,10	121 248 523	125 873 351
Série E	(2 513)	953	(0,27)	0,10	9 249 665	10 117 779
Série EF	(183)	90	(0,25)	0,12	742 298	768 934
Série F	(2 596)	1 382	(0,24)	0,14	10 957 073	10 120 511
Série I	(7 048)	12 253	(0,20)	0,30	34 714 561	41 003 090
Série O	(1 804)	3 656	(0,12)	0,23	14 963 004	15 386 637
Série P	1	163	-	0,27	668 058	601 122
Série Y	(13)	5	(1,19)	0,22	10 839	23 339
Série Z	(101)	60	(0,34)	0,15	300 890	382 706

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série E		Série EF	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 341 907	1 439 421	84 680	96 948	6 903	6 590
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(37 540)	13 732	(2 513)	953	(183)	90
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(22 148)	(9 978)	(1 356)	(493)	(128)	(93)
Profits nets réalisés	(16 900)	(21 039)	(1 035)	(1 360)	(98)	(113)
Remboursement de capital	(21 767)	(29 259)	(1 333)	(1 891)	(126)	(157)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(60 815)	(60 276)	(3 724)	(3 744)	(352)	(363)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	143 306	207 128	6 293	8 581	627	1 479
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	57 318	59 195	3 432	3 711	286	296
Rachat de parts rachetables	(270 805)	(317 293)	(16 645)	(21 769)	(1 746)	(1 189)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(70 181)	(50 970)	(6 920)	(9 477)	(833)	586
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(168 536)	(97 514)	(13 157)	(12 268)	(1 368)	313
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 173 371	1 341 907	71 523	84 680	5 535	6 903

	Série F		Série I		Série O	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	117 583	103 768	431 666	450 045	131 408	142 855
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 596)	1 382	(7 048)	12 253	(1 804)	3 656
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(2 274)	(1 526)	(8 235)	(9 973)	(3 845)	(2 935)
Profits nets réalisés	(1 735)	(1 755)	(6 284)	(7 123)	(2 934)	(3 316)
Remboursement de capital	(2 235)	(2 440)	(8 093)	(9 906)	(3 779)	(4 612)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(6 244)	(5 721)	(22 612)	(27 002)	(10 558)	(10 863)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	23 250	38 622	79 332	47 567	7 753	10 451
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	5 587	5 084	22 611	27 001	10 296	10 567
Rachat de parts rachetables	(29 797)	(25 552)	(192 934)	(78 198)	(25 244)	(25 258)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(960)	18 154	(90 991)	(3 630)	(7 195)	(4 240)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(9 800)	13 815	(120 651)	(18 379)	(19 557)	(11 447)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	107 783	117 583	311 015	431 666	111 851	131 408

	Série P		Série Y		Série Z	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 088	5 985	185	244	3 196	4 305
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1	163	(13)	5	(101)	60
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(138)	(119)	(2)	(3)	(46)	(29)
Profits nets réalisés	(105)	(91)	(1)	(4)	(35)	(54)
Remboursement de capital	(136)	(127)	(2)	(5)	(45)	(76)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(379)	(337)	(5)	(12)	(126)	(159)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	2 108	487	-	2	16	87
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	379	337	5	10	109	129
Rachat de parts rachetables	(1 499)	(1 547)	(170)	(64)	(888)	(1 226)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	988	(723)	(165)	(52)	(763)	(1 010)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	610	(897)	(183)	(59)	(990)	(1 109)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	5 698	5 088	2	185	2 206	3 196

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Total du Fonds	
	2023	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 122 616	2 250 161
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(51 797)	32 294
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(38 172)	(25 149)
Profits nets réalisés	(29 127)	(34 855)
Remboursement de capital	(37 516)	(48 473)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(104 815)	(108 477)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	262 685	314 404
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	100 023	106 330
Rachat de parts rachetables	(539 728)	(472 096)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(177 020)	(51 362)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(333 632)	(127 545)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 788 984	2 122 616

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(51 797)	32 294
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(3 865)	(34 003)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(7)	(18)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	334	157
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	118 094	65 349
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 046 444	489 575
Achat de placements et de dérivés	(800 939)	(247 257)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(73 243)	(83 952)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(87)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	67	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	8	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	905	(1)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	235 914	222 144
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4 795)	(2 147)
Produit de l'émission de parts rachetables	229 152	269 382
Montant versé au rachat de parts rachetables	(505 243)	(427 072)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(280 886)	(159 837)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	7	18
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(44 972)	62 307
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	70 213	7 888
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	25 248	70 213
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10 175	6 723
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 166	33
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(3)	-
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.

Série Portefeuilles de revenu CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	8 596 692	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série I)	83 265 774	76 385 051	
	22 149 970	FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	230 077 792	208 475 514	
	17 266 772	Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	153 362 387	136 528 368	
	2 152 969	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	48 107 881	52 465 927	
	2 911 655	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	31 706 366	32 222 995	
	14 370 189	Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	144 120 117	132 317 829	
	2 551 717	Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI (actions I)	47 850 293	51 896 058	
	5 161 548	Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine (série I)	70 546 027	59 898 733	
	2 993 227	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	53 902 176	50 847 441	
	3 783 356	Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	38 207 610	38 603 849	
	4 978 486	Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	40 605 845	37 644 826	
	1 022 062	Catégorie de société mondiale de dividendes CI (actions I)	19 446 720	22 859 244	
	1 423 254	Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI (série I)	17 142 403	22 751 860	
	24 789 310	Fonds de revenu CI (série I)	203 111 699	179 722 497	
	1 634 666	Fonds d'actions internationales CI (série I)	30 317 056	33 754 224	
	1 514 262	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	24 915 386	28 157 543	
	5 667 348	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	68 996 866	72 615 730	
	115 320	Fonds de métaux précieux CI (série I)	9 204 544	8 907 364	
USD	980 000	CI Private Markets Fund (Series I)	13 485 290	13 250 263	
USD	4 487 205	Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	57 968 448	58 170 279	
	328 986	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	12 459 007	12 420 440	
	315 632	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	11 917 542	11 945 803	
			1 410 717 229	**1 341 841 838**	**75,01**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	259 340	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	5 181 697	5 311 283	
	1 429 101	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	9 032 371	10 489 601	
	6 886 718	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	73 245 651	69 969 055	
	7 939 244	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	76 261 113	76 216 743	
	217 908	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	5 734 708	4 410 458	
	431 950	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	5 540 148	5 388 576	
	719 709	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	14 832 328	14 782 823	
	1 116 801	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	36 826 505	38 417 954	
	819 629	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	20 959 215	21 802 131	
USD	423 216	iShares China Large-Cap ETF	15 708 943	16 890 464	
USD	550 622	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF	60 545 220	56 221 714	
USD	32 799	iShares Russell 1000 Value ETF	6 501 714	6 749 358	
	858 088	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	12 422 657	12 699 702	
USD	472 947	iShares TIPS Bond ETF	73 928 234	70 470 463	
USD	30 790	FNB VanEck Semiconductor	10 389 932	10 952 043	
			427 110 436	**420 772 368**	**23,52**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**1 837 827 665**	**1 762 614 206**	**98,53**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(170 416)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**1 837 657 249**	**1 762 614 206**	**98,53**
Contrat(s) de change à terme				204 426	0,01
Total du portefeuille de placements			**1 837 657 249**	1 762 818 632	98,54
Autres actifs (passifs) nets				26 165 534	1,46
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**1 788 984 166**	**100,00**

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

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 avril 2023	CAD	5 309 630	USD	3 921 759	1,35	10 731
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	1 700 576	USD	1 266 784	1,34	(10 271)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	1 088 724	USD	801 166	1,36	6 715
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	1 531 542	USD	1 150 765	1,33	(22 616)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	5 080 117	USD	3 740 199	1,36	31 467
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 317 208	USD	2 451 099	1,35	5 396
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	4 116 856	USD	3 068 500	1,34	(29 159)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	1 577 253	USD	1 173 006	1,34	(6 942)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	1 341 450	CAD	1 790 135	0,75	21 551
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	5 081 546	USD	3 740 199	1,36	32 896
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	4 115 844	USD	3 068 500	1,34	(30 171)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 113 322	USD	2 327 674	1,34	(31 723)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	4 459 712	CAD	5 930 365	0,75	95 392
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	3 434 000	CAD	4 675 386	0,73	(35 524)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	1 534 626	USD	1 150 765	1,33	(19 532)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	8 862 489	USD	6 482 000	1,37	112 860
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 957 770	USD	1 426 000	1,37	32 905
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	3 810 164	USD	2 805 149	1,36	23 676
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	5 306 807	USD	3 921 759	1,35	7 907
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	29 088	USD	21 518	1,35	14
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	2 109 281	USD	1 573 814	1,34	(16 223)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	1 097 550	CAD	1 464 807	0,75	17 481
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	2 540 831	USD	1 870 099	1,36	16 506
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 272 880	USD	2 451 099	1,34	(38 933)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	5 821 062	USD	4 338 000	1,34	(40 242)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	1 529 781	USD	1 150 765	1,33	(24 377)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	2 575 050	USD	1 895 101	1,36	16 977
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	3 113 578	USD	2 327 674	1,34	(31 467)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	2 669 288	CAD	3 549 587	0,75	57 031
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	3 465 000	CAD	4 687 587	0,74	(5 839)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	1 578 767	USD	1 173 006	1,35	(5 429)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 957 671	USD	1 426 000	1,37	32 806
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	2 542 278	USD	1 870 099	1,36	17 953
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	3 316 950	USD	2 451 099	1,35	5 138
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	1 700 227	USD	1 266 784	1,34	(10 619)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	2 576 165	USD	1 895 101	1,36	18 091
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**204 426**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	564	(272)	-	292
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	564	(272)	-	292
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(359)	272	-	(87)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(359)	272	-	(87)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	442	(65)	-	377
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	442	(65)	-	377
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(484)	65	-	(419)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(484)	65	-	(419)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine	149 570	59 899	40,1
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	130 309	38 604	29,6
Fonds de revenu américain en dollars US CI	253 799	58 170	22,9
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI	310 018	51 896	16,7
Fonds d'obligations mondiales CI	236 262	37 645	15,9
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	76 385	12,8
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 186 982	136 528	11,5
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	32 223	9,8
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	69 969	9,6
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	50 847	8,4
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 577 253	132 318	8,4
Catégorie de société mondiale de dividendes CI	273 786	22 859	8,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	38 418	7,3
CI Private Markets Fund	199 700	13 250	6,6
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	28 158	6,4
Fonds d'obligations canadiennes CI	3 341 853	208 477	6,2
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	76 217	5,7
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	21 802	4,8
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	72 616	4,7
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	5 311	4,6
Fonds de revenu CI	4 011 474	179 722	4,5
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	14 783	3,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	5 389	3,5
Fonds d'actions internationales CI	993 649	33 754	3,4
Fonds de métaux précieux CI	270 947	8 907	3,3
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	52 466	3,0
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	843 815	22 752	2,7
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	12 420	2,5
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	11 946	2,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	10 490	2,0
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	12 700	0,7
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	4 410	0,7
iShares iBoxx High Yield Corporate Bond FNB	17 463 843	56 222	0,3
iShares TIPS Bond ETF	30 787 500	70 470	0,2
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	16 890	0,2
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	10 952	0,1
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 052	6 749	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds mondial avantage dividendes élevés CI	291 347	196 574	67,5
Fonds de lingots d'or CI	30 094	12 104	40,2
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine	153 190	58 416	38,1
Fonds d'obligations mondiales CI	420 519	132 651	31,5
Catégorie de société mondiale de dividendes CI	356 719	98 539	27,6
Fonds de revenu américain en dollars US CI	235 338	62 495	26,6
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	429 578	75 907	17,7
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI	533 948	88 698	16,6
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	541 183	64 851	12,0
Fonds d'obligations canadiennes CI	2 517 652	289 742	11,5
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 137 088	69 157	6,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	33 876	5,7
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	1 002 180	55 980	5,6
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 816 999	96 140	5,3
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	19 684	5,2
Fonds de revenu CI	5 478 653	278 138	5,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	2 318 662	98 289	4,2
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	20 300	3,9
Fonds de métaux précieux CI	369 497	12 371	3,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	10 732	3,3
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	1 056 859	32 306	3,1
Fonds canadien de dividendes CI	1 809 271	47 461	2,6
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI	2 090 747	43 045	2,1
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	20 198	1,8
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	2 072 140	21 425	1,0
iShares iBoxx $ High Yield Corporate Bond ETF	17 132 759	61 307	0,4
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	19 941	0,2
iShares TIPS Bond ETF	42 510 493	32 339	0,1

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	329	152
Paiements indirects†	119	63

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série E		Série EF		Série F	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	124 307 055	128 533 097	9 765 964	10 772 495	792 083	729 120	10 879 035	9 263 125
Parts rachetables émises contre trésorerie	14 205 158	18 634 542	778 404	983 517	75 029	161 068	2 282 590	3 426 645
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	5 707 774	5 260 720	425 469	410 373	35 324	32 597	555 907	451 820
Parts rachetables rachetées	(26 873 567)	(28 121 304)	(2 060 063)	(2 400 421)	(216 436)	(130 702)	(2 953 845)	(2 262 555)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	117 346 420	124 307 055	8 909 774	9 765 964	686 000	792 083	10 763 687	10 879 035

	Série I		Série O		Série P		Série Y	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	41 536 455	41 824 021	15 497 874	15 948 964	569 695	646 214	19 562	24 847
Parts rachetables émises contre trésorerie	8 059 081	4 413 679	991 009	1 175 304	255 368	52 215	3	257
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	2 338 530	2 495 854	1 322 652	1 186 009	45 764	36 180	488	973
Parts rachetables rachetées	(19 625 647)	(7 197 099)	(3 221 784)	(2 812 403)	(180 959)	(164 914)	(19 871)	(6 515)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	32 308 419	41 536 455	14 589 751	15 497 874	689 868	569 695	182	19 562

	Série Z	
	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	337 065	438 584
Parts rachetables émises contre trésorerie	1 728	8 939
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	12 288	13 085
Parts rachetables rachetées	(100 659)	(123 543)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	250 422	337 065

†*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.

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	1,650	0,17
Série E	1,850	0,15
Série EF	0,850	0,15
Série F	0,900	0,17
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,17
Série Y	0,700	0,17
Série Z	1,450	0,17

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	80 338
Garanties (hors trésorerie)	-	81 945

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	811	2 223
Charges	(276)	(333)
Revenu tiré des prêts de titres	535	1 890
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	34,0	15,0

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

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

Placements dans des parties liées (note 9)
aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série I)	76 385
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	5 311
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	208 476
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	136 528
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	52 466
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	32 223
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	132 318
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI (actions I)	51 896
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine (série I)	59 899
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	50 847
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	10 490
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	69 969
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	76 217
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	38 604
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	37 645
Catégorie de société mondiale de dividendes CI (actions I)	22 859
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI (série I)	22 752
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	4 410
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	5 389
Fonds de revenu CI (série I)	179 722
Fonds d'actions internationales CI (série I)	33 754
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	28 158
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	14 783
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	72 616
Fonds de métaux précieux CI (série I)	8 907
CI Private Markets Fund (série I)	13 250
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	58 170
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	12 420
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	38 418
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	21 802
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	11 946

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)
aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série I)	75 907
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	289 742
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	69 157
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	47 461
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	43 045
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	96 140
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI (actions I)	88 698
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine (série I)	58 416
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	20 300
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	33 876
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	64 851
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	132 651
Catégorie de société mondiale de dividendes CI (actions I)	98 539
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI (série I)	55 980
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	20 198
Fonds mondial avantage dividendes élevés CI (série I)	196 574
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en $ US)	12 104
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	10 732
Fonds de revenu CI (série I)	278 138
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI (Série I)	32 306
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	98 289
Fonds de métaux précieux CI (série I)	12 371
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	62 495
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	19 684

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI (parts ordinaires)	11,65
Fonds de revenu CI (série I)	10,05
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	7,63
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	7,40
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série I)	4,27
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en $ CA)	4,26
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	4,06
iShares TIPS Bond ETF	3,94
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	3,91
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine (série I)	3,35
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	3,25
iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF	3,14
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	2,93
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI (actions I)	2,90
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	2,84
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI (série I)	2,16
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,15
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	2,10
Fonds d'actions internationales CI (série I)	1,89
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	1,80
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	1,57
Autres actifs (passifs) nets	1,46
Catégorie de société mondiale de dividendes CI (actions I)	1,28
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI (série I)	1,27
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,22
iShares China Large-Cap ETF	0,94
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,83
CI Private Markets Fund (Series I)	0,74
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	0,71
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	0,69
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	0,67
FNB VanEck Semiconductor	0,61
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,59
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,50
iShares Russell 1000 Value ETF	0,38
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,30
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,30
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,25
Contrat(s) de change à terme	0,01
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Fonds d'obligations canadiennes CI (série I)	13,70
Fonds de revenu CI (série I)	13,10
Fonds mondial avantage dividendes élevés CI (série I)	9,30
Fonds d'obligations mondiales CI (série I)	6,20
Catégorie de société mondiale de dividendes CI (actions I)	4,60
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série I)	4,60
Fonds d'obligations de sociétés CI (série I)	4,50
Catégorie de société croissance et revenu de dividendes CI (actions I)	4,20
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série I)	3,60
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI (série I)	3,30
Autres actifs (passifs) nets	3,30
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	3,10
Fonds de revenu américain en dollars US CI (série I)	2,90
iShares iBoxx $ High Yield Corporate Bond ETF	2,90
Fonds de revenu en $ US CI DoubleLine (série I)	2,80
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI (série I)	2,60
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	2,20
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	2,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,60
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI (série I)	1,50
iShares TIPS Bond ETF	1,50
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	1,00
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,00
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,00
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	0,90
FNB VanEck Vectors Semiconductor	0,90
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,60
Fonds de valeur mondiale CI (série FNB $ US)	0,60
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	0,50
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si la actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 176 261 000 $ (205 267 000 $ au 31 mars 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 31 mars 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	233 175	(69 866)	163 309	9,1
Total	233 175	(69 866)	163 309	9,1

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

Risque de change (suite)

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	188 803	–	188 803	8,9
Total	188 803	–	188 803	8,9

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

Au 31 mars 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 16 331 000 $ (18 880 000 $ au 31 mars 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 31 mars 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	1 328 592	–	13 250	1 341 842
Fonds négocié(s) en bourse	420 772	–	–	420 772
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	205	–	205
Total	1 749 364	205	13 250	1 762 819

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	1 756 209	–	–	1 756 209
Fonds négocié(s) en bourse	296 457	–	–	296 457
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	(42)	–	(42)
Total	2 052 666	(42)	–	2 052 624

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022.

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

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 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	13 485	–	–	–	–	(235)	13 250
Total	–	13 485	–	–	–	–	(235)	13 250

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (235 027 $).

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 mars 2023.

États de la situation financière
aux 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	2023	2022
Actif		
Actifs courants		
Placements	430 100	451 619
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	6 846	16 099
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	257	105
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	48	94
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	24	-
Distributions provenant de placements à recevoir	-	-
Revenu tiré des prêts de titres à recevoir (note 6)	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	336	328
	437 611	468 245
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	159	114
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	212	2 356
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	13	-
Frais d'administration à payer	2	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	-
	386	2 470
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	437 225	465 775

États de la situation financière (suite)
aux 31 mars
(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 :	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Série A	198 325	216 215	17,56	18,71	11 295 968	11 557 560
Série AT5	15	151	6,25	7,05	2 375	21 443
Série AT8	15	36	4,05	4,73	3 794	7 513
Série E	5 686	5 927	10,12	10,78	561 824	549 844
Série EF	1 232	1 482	10,12	10,78	121 771	137 434
Série EFT5	1	1	6,81	7,70	209	188
Série EFT8	1	1	5,32	6,22	266	230
Série ET5	1	1	6,80	7,67	202	182
Série ET8	1	1	5,30	6,20	258	227
Série F	16 161	12 617	22,19	23,65	728 219	533 418
Série FT8	59	56	6,08	7,09	9 594	7 907
Série I	201 517	212 910	16,29	17,41	12 374 278	12 228 641
Série O	9 780	12 192	13,27	14,18	737 029	859 502
Série OT5	1	1	6,81	7,70	216	191
Série OT8	1	1	5,32	6,23	275	235
Série P	4 428	4 182	10,31	11,01	429 557	379 688
Série PT8	1	1	6,28	7,35	233	200

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

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 859	1 605
Intérêts aux fins des distributions	457	13
Distributions de revenu provenant des placements	2 957	2 902
Distributions de gains en capital provenant des placements	13 908	26 510
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	5 887	17 874
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(26 153)	(12 458)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(1 085)	36 446
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	74	(55)
Commissions d'engagement	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	9
Rabais sur frais	698	741
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	776	695
Total des revenus	(309)	37 141
Charges		
Frais de gestion (note 5)	4 158	4 650
Frais d'administration (note 5)	494	547
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	161	23
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Frais de marge	-	-
Frais de service	-	-
Charge d'intérêts	1	-
Retenues d'impôts	59	21
Taxe de vente harmonisée	438	498
Autres frais	-	-
Total des charges	5 312	5 740
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 621)	31 401

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars
(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 A	(5 348)	12 360	(0,47)	1,13	11 286 757	11 070 489
Série AT5	(4)	-	(0,20)	0,02	18 794	14 524
Série AT8	(3)	2	(0,56)	0,32	4 701	7 375
Série E	(128)	392	(0,23)	0,72	558 434	547 240
Série EF	(19)	15	(0,14)	0,18	134 225	78 337
Série EFT5	-	-	(0,09)	0,55	195	171
Série EFT8	-	-	(0,07)	0,47	245	208
Série ET5	-	-	(0,17)	0,46	190	169
Série ET8	-	-	(0,14)	0,38	239	206
Série F	(10)	721	(0,01)	1,55	662 970	465 065
Série FT8	(1)	5	(0,11)	0,56	9 424	7 947
Série I	54	16 656	-	1,47	11 902 388	11 314 201
Série O	(167)	992	(0,21)	1,21	793 759	813 473
Série OT5	-	-	(0,01)	0,65	200	173
Série OT8	-	-	-	0,53	251	210
Série P	5	258	0,01	0,84	408 143	308 391
Série PT8	-	-	(0,01)	0,62	213	179

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

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série A		Série AT5		Série AT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	216 215	207 672	151	29	36	38
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 348)	12 360	(4)	-	(3)	2
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(168)	(1 806)	-	(1)	-	-
Profits nets réalisés	(7 552)	(14 355)	(12)	(10)	(2)	(2)
Remboursement de capital	(6)	-	-	(6)	-	(3)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(7 726)	(16 161)	(12)	(17)	(2)	(5)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	21 288	34 406	-	125	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	7 592	16 090	10	14	1	1
Rachat de parts rachetables	(33 696)	(38 152)	(130)	-	(17)	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(4 816)	12 344	(120)	139	(16)	1
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17 890)	8 543	(136)	122	(21)	(2)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	198 325	216 215	15	151	15	36

	Série E		Série EF		Série EFT5	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 927	6 614	1 482	247	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(128)	392	(19)	15	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(5)	(52)	(1)	(12)	-	-
Profits nets réalisés	(227)	(412)	(67)	(96)	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(232)	(464)	(68)	(108)	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	230	102	1	1 570	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	224	450	68	108	-	-
Rachat de parts rachetables	(335)	(1 167)	(232)	(350)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	119	(615)	(163)	1 328	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(241)	(687)	(250)	1 235	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	5 686	5 927	1 232	1 482	1	1

	Série EFT8		Série ET5		Série ET8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	1	1	1	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	1	1	1	1

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

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

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	Série F		Série FT8		Série I	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12 617	10 309	56	66	212 910	193 585
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(10)	721	(1)	5	54	16 656
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(17)	(113)	-	(1)	(271)	(2 312)
Profits nets réalisés	(757)	(901)	(8)	(5)	(12 198)	(18 385)
Remboursement de capital	(1)	-	-	(5)	(9)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(775)	(1 014)	(8)	(11)	(12 478)	(20 697)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	5 331	3 623	11	-	27 484	32 739
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	739	982	1	-	12 477	20 696
Rachat de parts rachetables	(1 741)	(2 004)	-	(4)	(38 930)	(30 069)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	4 329	2 601	12	(4)	1 031	23 366
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 544	2 308	3	(10)	(11 393)	19 325
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	16 161	12 617	59	56	201 517	212 910

	Série O		Série OT5		Série OT8	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12 192	11 973	1	1	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(167)	992	-	-	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(14)	(128)	-	-	-	-
Profits nets réalisés	(614)	(1 018)	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(628)	(1 146)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	242	1 429	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	627	1 146	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 486)	(2 202)	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 617)	373	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 412)	219	-	-	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	9 780	12 192	1	1	1	1

	Série P		Série PT8		Total du Fonds	
	2023	**2022**	**2023**	**2022**	**2023**	**2022**
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 182	3 300	1	1	465 775	433 840
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5	258	-	-	(5 621)	31 401
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(6)	(40)	-	-	(482)	(4 465)
Profits nets réalisés	(259)	(314)	-	-	(21 696)	(35 498)
Remboursement de capital	-	-	-	-	(16)	(14)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(265)	(354)	-	-	(22 194)	(39 977)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	670	1 002	-	-	55 257	74 996
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	265	354	-	-	22 004	39 841
Rachat de parts rachetables	(429)	(378)	-	-	(77 996)	(74 326)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	506	978	-	-	(735)	40 511
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	246	882	-	-	(28 550)	31 935
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	4 428	4 182	1	1	437 225	465 775

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

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 621)	31 401
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(5 887)	(17 874)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	4	6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	161	23
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	26 153	12 458
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	282 008	86 415
Achat de placements et de dérivés	(264 158)	(72 297)
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Distributions hors trésorerie provenant des placements	(16 865)	(29 412)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(24)	-
(Augmentation) diminution des revenus tirés des prêts de titres à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	13	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	2	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	46	(16)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	15 832	10 704
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(190)	(136)
Produit de l'émission de parts rachetables	46 090	64 633
Montant versé au rachat de parts rachetables	(70 981)	(63 855)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(25 081)	642
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(4)	(6)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(9 249)	11 346
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	16 099	4 759
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	6 846	16 099
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 801	1 585
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	434	11
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.

Série Portefeuilles croissance maximale CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023

	Nombre de parts	Description	Coût moyen ($)	Juste valeur ($)	% de l'actif net
		FONDS			
	285 351	Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	10 787 113	12 016 769	
	1 205 052	Fonds canadien de dividendes CI (série I)	29 068 347	29 366 042	
	571 230	Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	12 615 199	13 494 053	
	1 377 883	Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 007 023	15 248 896	
	120 132	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	4 888 463	4 731 776	
	2 347 085	Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	39 345 275	39 871 099	
	1 744 928	Fonds d'actions internationales CI (série I)	34 870 754	36 031 021	
	1 513 357	Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	25 528 073	28 140 725	
	2 560 528	Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	30 022 117	34 479 554	
	44 476	Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 407 559	3 435 306	
USD	230 000	CI Private Markets Fund (Series I)	3 164 915	3 109 756	
	729 212	Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	15 291 225	17 124 449	
	1 407 811	Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	27 508 297	30 665 932	
	435 469	Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	16 196 230	16 440 563	
	386 580	Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	14 548 479	14 631 012	
			282 249 069	**298 786 953**	**68,34**
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	203 499	FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	4 065 728	4 167 660	
	1 101 138	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	6 689 595	8 082 353	
	168 931	FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	4 367 492	3 419 163	
	203 450	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 609 429	2 538 039	
	808 639	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	17 271 275	20 215 974	
	410 468	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	8 855 706	8 431 013	
	748 028	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	18 108 524	19 250 500	
	483 507	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 310 516	16 632 641	
	637 317	FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 164 583	16 952 632	
USD	321 381	iShares China Large-Cap ETF	11 765 503	12 826 250	
USD	23 124	iShares Russell 1000 Value ETF	4 697 608	4 758 443	
	432 905	iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	7 082 010	6 406 994	
USD	21 455	FNB VanEck Semiconductor	6 714 214	7 631 571	
			124 702 183	**131 313 233**	**30,03**
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			**406 951 252**	**430 100 186**	**98,37**
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(114 469)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			**406 836 783**	**430 100 186**	**98,37**
Contrat(s) de change à terme				98 052	0,02
Total du portefeuille de placements			**406 836 783**	430 198 238	98,39
Autres actifs (passifs) nets				7 026 461	1,61
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				**437 224 699**	**100,00**

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

Série Portefeuilles croissance maximale CI

Inventaire du portefeuille au 31 mars 2023 (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 avril 2023	CAD	4 185 746	USD	3 091 644	1,35	8 460
Banque de Montréal	A-1	15 mai 2023	CAD	183 923	USD	137 007	1,34	(1 111)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	282 587	USD	207 949	1,36	1 743
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	15 mai 2023	CAD	165 641	USD	124 459	1,33	(2 446)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	14 juin 2023	CAD	1 318 586	USD	970 800	1,36	8 168
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 615 058	USD	1 932 278	1,35	4 253
Citigroup Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 211 041	USD	1 648 000	1,34	(15 661)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	170 585	USD	126 865	1,34	(751)
Citigroup Inc.	A-2	15 mai 2023	USD	1 846 900	CAD	2 464 647	0,75	29 671
Citigroup Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 318 957	USD	970 800	1,36	8 538
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 210 498	USD	1 648 000	1,34	(16 204)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 454 328	USD	1 834 977	1,34	(25 008)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	1 729 085	CAD	2 299 275	0,75	36 985
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	18 avril 2023	USD	817 000	CAD	1 112 344	0,73	(8 452)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	15 mai 2023	CAD	165 975	USD	124 459	1,33	(2 112)
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	2 906 765	USD	2 126 000	1,37	37 016
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	1 230 814	USD	896 500	1,37	20 687
Goldman Sachs Group Inc.	A-2	14 juin 2023	CAD	988 960	USD	728 100	1,36	6 145
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	4 183 521	USD	3 091 644	1,35	6 234
HSBC Holdings PLC	A-2	18 avril 2023	CAD	22 931	USD	16 963	1,35	11
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	CAD	228 126	USD	170 213	1,34	(1 755)
HSBC Holdings PLC	A-2	15 mai 2023	USD	1 511 100	CAD	2 016 737	0,75	24 068
HSBC Holdings PLC	A-2	14 juin 2023	CAD	659 494	USD	485 400	1,36	4 284
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	3 189 642	USD	2 377 000	1,34	(22 051)
JPMorgan Chase & Co.	A-2	18 avril 2023	CAD	2 580 113	USD	1 932 278	1,34	(30 691)
Morgan Stanley	A-2	15 mai 2023	CAD	165 451	USD	124 459	1,33	(2 636)
Morgan Stanley	A-2	14 juin 2023	CAD	668 376	USD	491 889	1,36	4 406
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	CAD	2 454 530	USD	1 834 977	1,34	(24 806)
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 034 915	CAD	1 376 218	0,75	22 111
Banque Royale du Canada	A-1+	18 avril 2023	USD	1 982 000	CAD	2 681 327	0,74	(3 340)
Banque Royale du Canada	A-1+	15 mai 2023	CAD	170 749	USD	126 865	1,35	(587)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	1 230 752	USD	896 500	1,37	20 625
Banque Royale du Canada	A-1+	14 juin 2023	CAD	659 869	USD	485 400	1,36	4 660
Banque Toronto-Dominion	A-1+	18 avril 2023	CAD	2 614 855	USD	1 932 278	1,35	4 051
Banque Toronto-Dominion	A-1+	15 mai 2023	CAD	183 885	USD	137 007	1,34	(1 149)
Banque Toronto-Dominion	A-1+	14 juin 2023	CAD	668 665	USD	491 889	1,36	4 696
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								**98 052**

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

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 31 mars 2023

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	257	(106)	-	151
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	257	(106)	-	151
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(159)	106	-	(53)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(159)	106	-	(53)

au 31 mars 2022

		Montants admissibles à la compensation		
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	**Instruments financiers (en milliers de dollars)**	**Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)**	**Exposition nette (en milliers de dollars)**
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	105	(16)	-	89
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	105	(16)	-	89
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(114)	16	-	(98)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(114)	16	-	(98)

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

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 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	455 143	34 479	7,6
Catégorie de société des marchés émergents CI	604 260	39 871	6,6
Catégorie de société valeur internationale CI	440 541	28 141	6,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	19 251	6,2
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	224 022	12 017	5,4
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI	330 137	15 249	4,6
Catégorie de société canadienne Synergy CI	684 881	30 666	4,5
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	456 759	16 953	3,7
Fonds d'actions internationales CI	993 649	36 031	3,6
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	4 168	3,6
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	489 453	16 440	3,4
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	20 216	3,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	16 633	3,1
Fonds de valeur d'actions américaines	506 846	14 631	2,9
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	8 431	2,1
Fonds canadien de dividendes CI	1 762 666	29 366	1,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	2 538	1,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	8 082	1,6
CI Private Markets Fund	199 700	3 110	1,6
Fonds de métaux précieux CI	270 947	3 435	1,3
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	1 482 308	13 494	0,9
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 751 031	17 124	0,6
FNB Secteur financier mondial CI	677 524	3 419	0,5
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	1 199 516	4 732	0,4
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1 938 800	6 407	0,3
iShares China Large-Cap ETF	7 803 468	12 826	0,2
FNB VanEck Semiconductor	10 781 229	7 632	0,1
iShares Russell 1000 Value ETF	68 314 053	4 758	-

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

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2) (suite)

au 31 mars 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) (%)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	576 640	40 148	7,0
Catégorie de société américaine petites sociétés CI	335 633	20 899	6,2
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI	456 781	23 419	5,1
Catégorie de société valeur internationale CI	411 660	20 346	4,9
Catégorie de société des marchés émergents CI	515 128	23 013	4,5
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	1 041 094	34 783	3,3
Catégorie de société canadienne Synergy CI	996 020	32 551	3,3
Fonds d'actions internationales CI	1 005 897	32 218	3,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	328 860	9 771	3,0
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	380 361	11 182	2,9
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	197 924	5 564	2,8
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	571 950	15 364	2,7
Catégorie de société d'actions canadiennes CI	2 225 363	54 790	2,5
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	1 058 304	25 720	2,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	593 627	11 468	1,9
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI	493 922	9 274	1,9
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	363 450	5 340	1,5
Fonds de métaux précieux CI	369 497	5 000	1,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	381 181	4 936	1,3
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 598 654	29 106	1,1
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI	2 090 747	22 700	1,1
FNB Secteur financier mondial CI	1 122 873	6 666	0,6
iShares Core MSCI Europe ETF	6 465 426	4 216	0,1
FNB VanEck Vectors Semiconductor	10 439 308	3 145	-

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

Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Commissions de courtage	159	21
Paiements indirects†	58	9

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série A		Série AT5		Série AT8		Série E	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	11 557 560	10 900 170	21 443	3 785	7 513	7 318	549 844	602 512
Parts rachetables émises contre trésorerie	1 227 821	1 753 449	42	15 727	1	-	23 023	9 776
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	453 670	843 297	1 619	1 931	144	195	23 295	40 960
Parts rachetables rachetées	(1 943 083)	(1 939 356)	(20 729)	-	(3 864)	-	(34 338)	(103 404)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	11 295 968	11 557 560	2 375	21 443	3 794	7 513	561 824	549 844

	Série EF		Série EFT5		Série EFT8		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	137 434	22 459	188	164	230	195	182	161
Parts rachetables émises contre trésorerie	305	134 073	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	6 872	9 889	21	24	36	35	20	21
Parts rachetables rachetées	(22 840)	(28 987)	-	-	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	121 771	137 434	209	188	266	230	202	182

	Série ET8		Série F		Série FT8		Série I	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	227	195	533 418	427 579	7 907	8 385	12 228 641	10 893 354
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-	239 155	145 924	1 511	-	1 709 609	1 769 420
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	31	32	35 032	40 812	176	31	809 553	1 173 276
Parts rachetables rachetées	-	-	(79 386)	(80 897)	-	(509)	(2 373 525)	(1 607 409)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	258	227	728 219	533 418	9 594	7 907	12 374 278	12 228 641

	Série O		Série OT5		Série OT8		Série P	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	859 502	827 159	191	165	235	197	379 688	293 565
Parts rachetables émises contre trésorerie	18 349	95 980	-	-	-	-	64 557	87 264
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	49 875	79 714	25	26	40	38	27 128	31 696
Parts rachetables rachetées	(190 697)	(143 351)	-	-	-	-	(41 816)	(32 837)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	737 029	859 502	216	191	275	235	429 557	379 688

†*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.

Transactions sur parts rachetables (note 4) (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 31 mars

	Série PT8	
	2023	**2022**
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	200	168
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	33	32
Parts rachetables rachetées	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	233	200

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

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 31 mars 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :	Taux des frais d'administration annuels :
Série A	2,000	0,22
Série AT5	2,000	0,22
Série AT8	2,000	0,22
Série E	1,950	0,15
Série EF	0,950	0,15
Série EFT5	0,950	0,15
Série EFT8	0,950	0,15
Série ET5	1,950	0,15
Série ET8	1,950	0,15
Série F	1,000	0,22
Série FT8	1,000	0,22
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série OT8	Payés directement par les investisseurs	0,15
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,22
Série PT8	Payés directement par les investisseurs	0,22

Prêts de titres (note 6)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	-	346
Garanties (hors trésorerie)	-	353

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) 31 mars (en milliers de dollars)

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	5	11
Charges	(1)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	4	9
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	24,8	18,2

Pertes reportées en avant (note 7)

au 31 mars (en milliers de dollars)

	2023
Pertes en capital reportées en avant :	-
Pertes autres qu'en capital expirant en :	
2023	-
2024	-
2025	-
2026	-
2027	-
2028	-
2029	-
2030	-
2031	-
2032	-
2033	-
2034	-
2035	-
2036	-
2037	-
2038	-
2039	-
2040	-
2041	-
2042	-
Total	-

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2023
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	12 017
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	4 168
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	29 366
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	13 494
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	15 249
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	4 732
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	39 871
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	8 082
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	3 419
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 538
Fonds d'actions internationales CI (série I)	36 031
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	28 141
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	20 216
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	8 431
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	19 251
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	34 479
Fonds de métaux précieux CI (série I)	3 435
CI Private Markets Fund (série I)	3 110
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	17 124
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	30 666
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	16 440
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 633
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 953
Fonds de valeur d'actions américaines (Série I)	14 631

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

Placements dans des parties liées (note 9) (suite)
aux 31 mars (en milliers de dollars)

Placements	2022
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	20 899
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	54 790
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	22 700
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	23 419
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	23 013
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	11 468
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	6 666
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	9 771
Fonds d'actions internationales CI (série I)	32 218
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	20 346
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	25 720
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	5 340
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	5 564
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	15 364
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	40 148
Fonds de métaux précieux CI (série I)	5 000
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	29 106
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI (série I)	34 783
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	32 551
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	9 274
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4 936
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	11 182

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

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 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
Catégorie de société des marchés émergents CI (actions I)	9,11
Fonds d'actions internationales CI (série I)	8,23
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	7,89
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	7,01
Fonds canadien de dividendes CI (série I)	6,72
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	6,44
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,62
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	4,40
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	3,92
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,88
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,80
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	3,76
Fiducie privée d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	3,49
Fonds de valeur d'actions américaines (série I)	3,35
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	3,09
iShares China Large-Cap ETF	2,93
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	2,75
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,93
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,85
FNB VanEck Semiconductor	1,75
Autres actifs (passifs) nets	1,61
iShares S&P/TSX Capped Energy Index ETF	1,47
iShares Russell 1000 Value ETF	1,09
Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI (série I)	1,08
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires non couvertes)	0,95
Fonds de métaux précieux CI (série I)	0,79
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	0,78
CI Private Markets Fund (Series I)	0,71
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,58
Contrat(s) de change à terme	0,02
Total	100,00

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2022

Fonds	Actif net (%)
Catégorie de société d'actions canadiennes CI (actions I)	11,80
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro (série I)	8,60
Fonds gestion d'actions américaines CI Select (série I)	7,50
Catégorie de société canadienne Synergy CI (actions I)	7,00
Fonds d'actions internationales CI (série I)	6,90
Fonds d'actions canadiennes sélect CI (série I)	6,20
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	5,50
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI (série I)	5,00
Fonds d'actions de revenu canadiennes CI (série I)	4,90
Catégorie de société marchés nouveaux CI (actions I)	4,90
Catégorie de société américaine petites sociétés CI (actions I)	4,50
Catégorie de société valeur internationale CI (actions I)	4,40
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,30
Autres actifs (passifs) nets	3,00
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2,50
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,40
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	2,10
Catégorie de société d'actions américaines sélectionnées CI (actions I)	2,00
FNB Secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1,40
FNB Indice Morningstar International Momentum CI (parts ordinaires non couvertes)	1,20
Fonds de métaux précieux CI (série I)	1,10
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,10
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,10
iShares Core MSCI Europe ETF	0,90
FNB VanEck Vectors Semiconductor	0,70
Contrat(s) de change à terme	0,00
Total	100,00

Autre risque de prix

Aux 31 mars 2023 et 2022, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 31 mars 2023, si les actions détenues dans les portefeuilles de placements des fonds sous-jacents avaient augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 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 43 010 000 $ (45 162 000 $ au 31 mars 2022). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Au 31 mars 2023, le Fonds était peu exposé au risque de change puisque la plupart de ses placements étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds.

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

au 31 mars 2022~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar américain	7 949	–	7 949	1,7
Total	7 949	–	7 949	1,7

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

Au 31 mars 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 795 000 $. 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 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 31 mars 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	295 677	–	3 110	298 787
Fonds négocié(s) en bourse	131 313	–	–	131 313
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	98	–	98
Total	426 990	98	3 110	430 198

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2022

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Fonds	348 247	–	–	348 247
Fonds négocié(s) en bourse	103 372	–	–	103 372
Contrat(s) de change à terme (montant net)	–	(9)	–	(9)
Total	451 619	(9)	–	451 610

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 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 31 mars 2023

	Solde au 31 mars 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 31 mars 2023 (en milliers de dollars)
Position(s) acheteur/actifs :								
Fonds	–	3 165	–	–	–	–	(55)	3 110
Total	–	3 165	–	–	–	–	(55)	3 110

*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 mars 2023 s'est établie à (55 159 $).

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 mars 2023.

Notes des états financiers

1. LES FONDS

Les fonds suivants (les « Fonds ») sont des fiducies de fonds commun de placement à capital variable établies en vertu des lois de la province de l'Ontario par des déclarations de fiducie.

CI Investments Inc. est le gestionnaire et le fiduciaire (le « gestionnaire » et le « fiduciaire ») des Fonds. Le gestionnaire est une filiale en propriété exclusive de CI Financial Corp. (Bourse de Toronto [TSX] : CIX). À compter de juillet jusqu'en novembre 2022, la Compagnie Trust CIBC Mellon a remplacé la Fiducie RBC pour les services aux investisseurs en tant qu'administrateur des Fonds. En octobre et novembre 2022, la Compagnie Trust CIBC Mellon a remplacé la Fiducie RBC Services aux investisseurs en tant que dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds. Bank of New York Mellon est un agent de prêt (l'« Agent de prêt ») pour les Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, 2e étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 22 juin 2023.

L'objectif de chaque Fonds est de mettre en commun et de gérer l'argent versé par des investisseurs (les « porteurs de parts ») ayant des objectifs de placement semblables. Les Fonds peuvent investir dans des actions, des titres à revenu fixe, des dérivés, un ou des fonds sous-jacents ou une combinaison de ceux-ci en fonction de leurs objectifs et stratégies de placement. Les Fonds peuvent détenir des placements en vue d'obtenir un revenu ou une plus-value en capital ou les deux. Les porteurs de parts partagent le revenu, les charges et tout profit ou toute perte sur les placements des Fonds généralement en fonction de la valeur des titres qu'ils détiennent.

La « date de création » est la date à laquelle un Fonds a commencé ses activités.

	Date de création :						
	Série A	**Série AH**	**Série AT5**	**Série C**	**Série E**	**Série EF**	**Série F**
Fonds américain de petites sociétés CI	29 avril 1991	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015	8 août 2000
Fonds de bitcoins CI	5 avril 2021	-	-	-	-	-	5 avril 2021
Fonds de placements canadiens CI	29 janv. 1977	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015	17 nov. 2000
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	21 févr. 2023	-	-	-	-	-	21 févr. 2023
Fonds Ethereum CI	26 avril 2021	-	-	-	-	-	26 avril 2021
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	27 oct. 2022	-	-	-	-	-	27 oct. 2022
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	8 juill. 2021	8 juill. 2021	-	-	-	-	8 juill. 2021
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	-	-	-	23 sept. 2022
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	11 juin 2020	-	-	-	-	-	11 juin 2020
Fonds de gestion de dividendes mondiaux de qualité CI	28 févr. 2006*	-	-	-	27 juill. 2011	-	28 févr. 2006
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	-	-	-	23 sept. 2022
Fonds de valeur mondiale CI	12 juin 1996	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015	8 août 2000
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	21 févr. 2023	-	-	-	-	-	21 févr. 2023
Fonds d'épargne à intérêt élevé CI	30 juill. 2019	-	-	-	30 juill. 2019	-	30 juill. 2019
Fonds de revenu CI	5 oct. 2010	-	-	20 sept. 2010*	4 août 2015	27 nov. 2014	5 oct. 2010
Fonds de valeur internationale CI	12 juin 1996	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015	18 déc. 2001
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	24 déc. 2014	9 mars 2020	5 mars 2021	-	24 déc. 2014	4 août 2015	24 déc. 2014
Fonds marché monétaire CI	1er oct. 1990	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015	18 déc. 2001
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	17 sept. 2019	-	-	-	17 sept. 2019	-	17 sept. 2019
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	10 août 2020	12 janv. 2021	-	-	-	-	10 août 2020
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	21 févr. 2023	-	-	-	-	-	21 févr. 2023
Fonds de revenu américain en dollars US CI	4 août 2015	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	1er févr. 1977	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015	17 nov. 2000
Fonds marché monétaire É-U CI	30 janv. 1995	-	-	-	-	-	1er mai 2017

	Série FT5	**Série FH**	**Série I**	**Série IH**	**Série IT5**	**Série Prestige**	**Série O**
Fonds américain de petites sociétés CI	-	-	17 déc. 2001	-	-	-	4 août 2015
Fonds de bitcoins CI	-	-	5 avril 2021	-	-	-	-

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

Notes des états financiers (suite)

	Date de création :						
	Série FT5	**Série FH**	**Série I**	**Série IH**	**Série IT5**	**Série Prestige**	**Série O**
Fonds de placements canadiens CI	-	-	31 oct. 1996	-	-	29 août 2003	27 juill. 2011
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	-	-	30 déc. 2020	-	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	-	-	21 févr. 2023	-	-	-	-
Fonds Ethereum CI	-	-	26 avril 2021	-	-	-	-
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	-	-	27 oct. 2022	-	-	-	-
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	-	8 juill. 2021	8 juill. 2021	8 juill. 2021	-	-	-
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	-	23 sept. 2022	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	-	-
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	-	-	11 juin 2020	-	-	-	-
Fonds de gestion de dividendes mondiaux de qualité CI	-	-	12 mai 2006	-	-	-	27 juill. 2011
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	-	-	1er juin 2017	-	-	-	-
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	-	23 sept. 2022	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	-	-
Fonds de valeur mondiale CI	-	-	17 déc. 2001	-	-	-	30 juill. 2013
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	-	-	21 févr. 2023	-	-	-	-
Fonds d'épargne à intérêt élevé CI	-	-	30 juill. 2019	-	-	-	30 juill. 2019
Fonds de revenu CI	-	-	5 oct. 2010	-	-	-	30 juill. 2013
Fonds de valeur internationale CI	-	-	17 déc. 2001	-	-	29 août 2003	30 juill. 2013
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	5 mars 2021	9 mars 2020	24 déc. 2014	9 mars 2020	5 mars 2021	-	24 déc. 2014
Fonds marché monétaire CI	-	-	18 déc. 2001	-	-	29 août 2003	27 juill. 2011
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	-	-	17 sept. 2019	-	-	-	17 sept. 2019
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	-	12 janv. 2021	14 janv. 2019	12 janv. 2021	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	-	-	21 févr. 2023	-	-	-	-
Fonds de revenu américain en dollars US CI	-	-	4 août 2015	-	-	-	4 août 2015
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	-	-	31 oct. 1996	-	-	29 août 2003	27 juill. 2011
Fonds marché monétaire É-U CI	-	-	4 juill. 2016	-	-	-	-

	Série P	**Série PH**	**Série PP**	**Série W**	**Série WH**	**Série X**	**Série Y**
Fonds américain de petites sociétés CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds de bitcoins CI	5 avril 2021	-	-	5 avril 2021^	-	-	-
Fonds de placements canadiens CI	1er mai 2017	-	-	22 nov. 2019^	-	-	-
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	21 févr. 2023	-	-	21 févr. 2023^	-	-	-
Fonds Ethereum CI	26 avril 2021	-	-	3 mai 2021^	-	-	-
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	27 oct. 2022	-	-	4 nov. 2022^	-	-	-
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	8 juill. 2021	8 juill. 2021	-	12 août 2021^	12 août 2021^	-	-
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	4 nov. 2022^	4 nov. 2022^	-	-
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	11 juin 2020	-	-	11 juin 2020^	-	-	-
Fonds de gestion de dividendes mondiaux de qualité CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	23 sept. 2022	23 sept. 2022	-	4 nov. 2022^	4 nov. 2022^	-	-
Fonds de valeur mondiale CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	21 févr. 2023	-	-	21 févr. 2023^	-	-	-
Fonds d'épargne à intérêt élevé CI	30 juill. 2019	-	-	30 juill. 2019^	-	-	-
Fonds de revenu CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds de valeur internationale CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	1er mai 2017	9 mars 2020	-	27 juill. 2017^	9 mars 2020^	-	-
Fonds marché monétaire CI	1er mai 2017	-	22 nov. 2019	27 juill. 2017^	-	22 nov. 2019	22 nov. 2019
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	17 sept. 2019	-	-	17 sept. 2019^	-	-	-

^*Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.*

	Date de création :						
	Série P	**Série PH**	**Série PP**	**Série W**	**Série WH**	**Série X**	**Série Y**
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	10 août 2020	12 janv. 2021	-	8 févr. 2022^	8 févr. 2022^	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	21 févr. 2023	-	-	21 févr. 2023^	-	-	-
Fonds de revenu américain en dollars US CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	1er mai 2017	-	-	27 juill. 2017^	-	-	-
Fonds marché monétaire É-U CI	1er mai 2017	-	-	-	-	-	-

	Série Z	**Série FNB $ CA**	**Série FNB couverte en $ US**
Fonds américain de petites sociétés CI	-	-	-
Fonds de bitcoins CI	-	-	-
Fonds de placements canadiens CI	-	-	-
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	-	-	-
Fonds Ethereum CI	-	-	-
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	-	27 oct. 2022	-
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	-	8 juill. 2021	8 juill. 2021
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	-	23 sept. 2022	23 sept. 2022
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	-	11 juin 2020	-
Fonds de gestion de dividendes mondiaux de qualité CI	-	-	-
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	-	-	-
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	-	23 sept. 2022	23 sept. 2022
Fonds de valeur mondiale CI	-	-	-
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	-	-	-
Fonds d'épargne à intérêt élevé CI	-	-	-
Fonds de revenu CI	-	-	-
Fonds de valeur internationale CI	-	-	-
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	-	-	-
Fonds marché monétaire CI	17 sept. 2010*	-	-
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	-	-	-
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	-	7 janv. 2021	7 janv. 2021
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	-	-	-
Fonds de revenu américain en dollars US CI	-	-	-
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	-	-	-
Fonds marché monétaire É-U CI	-	-	-

	Série A	**Série F**	**Série I**	**Série W**
Fonds de gestion d'actions canadiennes Sélect CI	-	-	22 nov. 2006	-
Fonds de gestion d'actions internationales Sélect CI	-	-	22 nov. 2006	-
Fonds de lancement Sélect CI	7 nov. 2005	30 déc. 2005	22 mars 2006	30 déc. 2005
Fonds de gestion d'actions américaines Sélect CI	-	-	22 nov. 2006	-

	Série A	**Série AT5**	**Série AT6**	**Série AT8**	**Série D**	**Série E**	**Série ET5**
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	27 juill. 2017	-	-	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	12 déc. 2018	-	-	-	-	-	-
Fonds canadien de dividendes CI	1er févr. 2005	-	-	-	31 août 2004*	7 janv. 2014	-
Fonds d'actions canadiennes CI	27 juill. 2017	-	-	-	-	27 juill. 2017	-

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

^Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.

Notes des états financiers (suite)

	Date de création :						
	Série A	**Série AT5**	**Série AT6**	**Série AT8**	**Série D**	**Série E**	**Série ET5**
Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	-	-
Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	30 juill. 2013	-	-	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	2 juill. 2004	23 juill. 2021	-	23 juill. 2021	-	30 juill. 2013	23 juill. 2021
Fonds d'actions mondiales CI	27 juill. 2017	-	-	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds de petites sociétés mondiales CI	27 juill. 2017	22 nov. 2019	-	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	14 févr. 2011	-	-	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds américain de dividendes CI	13 juin 2006	-	7 juill. 2008*	-	13 juin 2006*	7 janv. 2014	-
Fonds enregistré de dividendes américains CI	24 déc. 2014	-	-	-	-	24 déc. 2014	-
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	27 mars 2015	-	-	24 juill. 2017	-	27 mars 2015	-

	Série ET8	**Série EF**	**Série F**	**Série FT5**	**Série FT8**	**Série I**	**Série IT8**
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	-	27 juill. 2017	27 juill. 2017	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	-	-	12 déc. 2018	-	-	27 mars 2015*~	-
Fonds canadien de dividendes CI	-	27 nov. 2014	12 juin 2006	-	-	7 juin 2006	-
Fonds d'actions canadiennes CI	-	27 juill. 2017	27 juill. 2017	-	-	27 juill. 2017	-
Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	15 nov. 2018	-
Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	1er juin 2017*	-
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	-	4 août 2015	30 juill. 2013	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	23 juill. 2021	27 nov. 2014	20 juill. 2004	23 juill. 2021	23 juill. 2021	3 sept. 2004	-
Fonds d'actions mondiales CI	-	27 juill. 2017	27 juill. 2017	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds de petites sociétés mondiales CI	-	27 juill. 2017	27 juill. 2017	-	-	27 juill. 2017	-
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	-	4 août 2015	14 févr. 2011	-	-	5 janv. 2012	-
Fonds américain de dividendes CI	-	27 nov. 2014	13 juin 2006	-	-	13 juin 2006	-
Fonds enregistré de dividendes américains CI	-	4 août 2015	24 déc. 2014	-	-	24 déc. 2014	-
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	-	27 mars 2015	27 mars 2015	-	24 juill. 2017	27 mars 2015	24 juin 2017

	Série Prestige	**Série O**	**Série OT8**	**Série P**	**Série PP**	**Série PT8**	**Série W**
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	-	27 juill. 2017	-	27 juill. 2017	-	-	-
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	-	-	-	12 déc. 2018	-	-	27 sept. 2019^
Fonds canadien de dividendes CI	-	30 juill. 2013	-	1er mai 2017	-	-	27 sept. 2019^
Fonds d'actions canadiennes CI	-	27 juill. 2017	-	27 juill. 2017	-	-	-
Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	-	-
Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI	-	-	-	-	-	-	-
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	-	30 juill. 2013	-	1er mai 2017	22 nov. 2019	-	27 juill. 2017^
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	-	30 juill. 2013	23 juill. 2021	1er mai 2017	-	-	27 sept. 2019^
Fonds d'actions mondiales CI	-	27 juill. 2017	-	27 juill. 2017	-	-	-
Fonds de petites sociétés mondiales CI	22 nov. 2019	27 juill. 2017	-	27 juill. 2017	22 nov. 2019	-	-
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	-	30 juill. 2013	-	1er mai 2017	-	-	27 sept. 2019^
Fonds américain de dividendes CI	-	31 juill. 2013	-	1er mai 2017	-	-	27 sept. 2019^
Fonds enregistré de dividendes américains CI	-	24 déc. 2014	-	1er mai 2017	-	-	-
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	-	27 mars 2015	-	1er mai 2017	-	-	-

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

^Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.

~Le 31 décembre 2017, les parts de série C ont été redésignées comme parts de série I.

	Date de création :	
	Série Y	**Série Z**
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	-	-
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	-	-
Fonds canadien de dividendes CI	-	-
Fonds d'actions canadiennes CI	-	-
Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI	-	-
Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI	-	-
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	22 nov. 2019	22 nov. 2019
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	-	-
Fonds d'actions mondiales CI	-	-
Fonds de petites sociétés mondiales CI	-	-
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	-	-
Fonds américain de dividendes CI	-	-
Fonds enregistré de dividendes américains CI	-	-
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	-	-

	Série A	**Série AT6**	**Série D**	**Série E**	**Série EF**	**Série F**	**Série H**
Fonds équilibré mondial CI	29 janv. 2007	7 juill. 2008*	29 janv. 2007*	4 août 2015	4 août 2015	29 janv. 2007	-
Fonds chefs de file mondiaux CI	1er févr. 2005	7 juill. 2008*	1er mai 2000*	4 août 2015	4 août 2015	12 juin 2006	-
Fonds d'actions internationales CI	30 sept. 2008	25 sept. 2008*	-	4 août 2015	4 août 2015	30 sept. 2008	21 févr. 2018^

	Series I	**Series O**	**Series P**
Fonds équilibré mondial CI	29 janv. 2007	30 juill. 2013	1er mai 2017
Fonds chefs de file mondiaux CI	7 juin 2006	4 août 2015	1er mai 2017
Fonds d'actions internationales CI	30 sept. 2008	4 août 2015	1er mai 2017

	Série A	**Série AH**	**Série AT6**	**Série C**	**Série D**	**Série E**	**Série EF**
Fonds d'occasions Asie CI	30 oct. 1981	-	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015
Fonds équilibré canadien CI	25 juin 1997	-	26 juill. 2012*	-	26 juill. 2012*	4 août 2015	4 août 2015
Fonds d'obligations canadiennes CI	20 janv. 1993	-	-	-	-	27 juill. 2011	5 déc. 2014
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	13 nov. 2000	-	7 sept. 2012*	-	-	4 oct. 2011	5 déc. 2014
Fonds d'obligations de sociétés CI	17 déc. 2001	-	-	-	-	27 juill. 2011	5 déc. 2014
Fonds de rendement diversifié CI	14 févr. 2011	-	-	-	-	29 août 2012	5 déc. 2014
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	29 oct. 1996	-	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015
Fonds des marchés émergents CI	10 sept. 1991	31 août 2021	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015
Fonds de revenu à taux variable CI	7 juin 2017	-	-	-	-	1er juin 2017	1er juin 2017
Fonds d'obligations mondiales CI	31 août 1992	-	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	21 déc. 2015	-	-	-	-	21 déc. 2015	21 déc. 2015
Fonds mondial de dividendes CI	20 déc. 2012	-	-	-	-	20 déc. 2012	4 août 2015
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	26 févr. 2007	-	-	-	-	4 oct. 2011	5 déc. 2014
Fonds de ressources mondiales CI	11 avril 1997	-	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015
Fonds de revenu élevé CI	18 déc. 1996	-	-	-	-	27 juill. 2011	5 déc. 2014
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	30 juill. 2013	-	-	-	-	30 juill. 2013	4 août 2015
Fonds d'actions privilégiées CI	21 déc. 2015	-	-	-	-	21 déc. 2015	21 déc. 2015
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	13 mai 1998	-	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	3 juin 1986	-	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015
Fonds d'obligations à court terme CI	1er févr. 1977	-	-	-	-	4 août 2015	4 août 2015

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

^Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.

Notes des états financiers (suite)

	Date de création :						
	Série F	**Série FH**	**Série I**	**Série IH**	**Série Prestige**	**Série O**	**Série OO**
Fonds d'occasions Asie CI	8 août 2000	-	17 déc. 2001	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds équilibré canadien CI	8 août 2000	-	15 juill. 2003	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds d'obligations canadiennes CI	8 août 2000	-	1er nov. 2001	-	29 août 2003	27 juill. 2011	-
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	30 nov. 2000	-	1er mars 2005	-	-	4 oct. 2011	-
Fonds d'obligations de sociétés CI	15 juill. 2003	-	15 juill. 2003	-	29 août 2003	27 juill. 2011	-
Fonds de rendement diversifié CI	14 févr. 2011	-	14 févr. 2011	-	-	29 août 2012	22 nov. 2019
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	28 sept. 2001	-	15 juill. 2003	-	-	27 juill. 2011	-
Fonds des marchés émergents CI	8 août 2000	31 août 2021	1er oct. 2001	31 août 2021	-	30 juill. 2013	-
Fonds de revenu à taux variable CI	1er juin 2017	-	1er juin 2017	-	-	1er juin 2017	-
Fonds d'obligations mondiales CI	8 août 2000	-	26 sept. 2001	-	29 août 2003	27 juill. 2011	-
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	21 déc. 2015	-	21 déc. 2015	-	-	21 déc. 2015	-
Fonds mondial de dividendes CI	20 déc. 2012	-	30 juill. 2013	-	-	20 déc. 2012	-
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	26 févr. 2007	-	26 févr. 2007	-	-	4 oct. 2011	-
Fonds de ressources mondiales CI	18 déc. 2001	-	-	-	-	4 août 2015	-
Fonds de revenu élevé CI	18 déc. 2001	-	8 nov. 2002	-	-	27 juill. 2011	-
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	30 juill. 2013	-	30 juill. 2013	-	-	30 juill. 2013	-
Fonds d'actions privilégiées CI	21 déc. 2015	-	21 déc. 2015	-	-	21 déc. 2015	-
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	8 août 2000	-	17 déc. 2001	-	29 août 2003	27 juill. 2011	-
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	8 août 2000	-	26 sept. 2001	-	29 août 2003	30 juill. 2013	-
Fonds d'obligations à court terme CI	17 nov. 2000	-	17 nov. 2000	-	-	30 juill. 2013	-

	Série P	**Série PH**	**Série PP**	**Série U**	**Série W**	**Série X**	**Série Y**
Fonds d'occasions Asie CI	1er mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds équilibré canadien CI	1er mai 2017	-	8 avril 2022	14 août 2009*	-	-	8 avril 2022
Fonds d'obligations canadiennes CI	1er mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017^	-	14 avril 2022*
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	1er mai 2017	-	-	-	-	-	3 nov. 2017
Fonds d'obligations de sociétés CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds de rendement diversifié CI	1er mai 2017	-	22 nov. 2019	-	27 sept. 2019^	-	22 nov. 2019
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	1er mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017^	29 août 2003*	-
Fonds des marchés émergents CI	1er mai 2017	31 août 2021	-	-	-	-	-
Fonds de revenu à taux variable CI	7 juin 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds d'obligations mondiales CI	1er mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017^	-	-
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds mondial de dividendes CI	1er mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	1er mai 2017	-	8 avril 2022	-	6 juin 2022^	-	8 avril 2022
Fonds de ressources mondiales CI	1er mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds de revenu élevé CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds d'actions privilégiées CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	1er mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017^	-	-
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	1er mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017^	-	-
Fonds d'obligations à court terme CI	1er mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019^	-	-

	Série Z	**Série ZZ**	**Série FNB $ CA**
Fonds d'occasions Asie CI	-	-	-
Fonds équilibré canadien CI	29 juin 2005*	8 avril 2022	-
Fonds d'obligations canadiennes CI	26 juill. 2012*	-	-

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

^Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.

Notes des états financiers (suite)

	Date de création :		
	Série Z	**Série ZZ**	**Série FNB $ CA**
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	3 nov. 2017	-	-
Fonds d'obligations de sociétés CI	26 juill. 2012*	-	-
Fonds de rendement diversifié CI	22 nov. 2019	-	-
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	29 août 2003*	-	-
Fonds des marchés émergents CI	-	-	-
Fonds de revenu à taux variable CI	-	-	13 avr. 2022
Fonds d'obligations mondiales CI	-	-	-
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	-	-	-
Fonds mondial de dividendes CI	-	-	-
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	8 avril 2022	-	-
Fonds de ressources mondiales CI	-	-	-
Fonds de revenu élevé CI	-	-	-
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	-	-	-
Fonds d'actions privilégiées CI	-	-	-
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	29 juin 2005	-	-
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	-	-	-
Fonds d'obligations à court terme CI	-	-	-

	Série A	**Série E**	**Série EF**	**Série F**	**Série I**	**Série O**	**Série P**
Fonds américain Synergy CI	31 août 1992	4 août 2015	4 août 2015	8 août 2000	17 déc. 2001	30 juill. 2013	1er mai 2017

	Série W
Fonds américain Synergy CI	27 juill. 2017^

	Série A	**Série AT5**	**Série AT6**	**Série AT8**	**Série E**	**Série ET5**	**Série ET8**
Série Portefeuilles équilibrée CI	9 nov. 1988	28 sept. 2007	-	28 sept. 2007	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	17 déc. 2001	14 déc. 2007	7 sept. 2012*	28 sept. 2007	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	17 déc. 2001	-	7 sept. 2012*	-	4 août 2015	-	-
Série Portefeuilles prudente CI	17 nov. 1997	-	7 sept. 2012*	-	4 août 2015	-	-
Série Portefeuilles croissance CI	18 déc. 2001	30 janv. 2008	7 sept. 2012*	28 sept. 2007	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015
Série Portefeuilles de revenu CI	17 nov. 1997	-	-	-	4 août 2015	-	-
Série Portefeuilles croissance maximale CI	18 déc. 2001	30 avril 2008	-	28 sept. 2007	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015

	Série EF	**Série EFT5**	**Série EFT8**	**Série F**	**Série FT5**	**Série FT8**	**Série I**
Série Portefeuilles équilibrée CI	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015	17 nov. 2000	6 janv. 2010	19 août 2009	31 oct. 1996
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015	18 déc. 2001	-	17 janv. 2008	29 juin 2005
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	4 août 2015	-	-	18 déc. 2001	-	-	29 juin 2005
Série Portefeuilles prudente CI	4 août 2015	-	-	17 nov. 2000	-	-	17 nov. 1997
Série Portefeuilles croissance CI	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015	18 déc. 2001	-	22 déc. 2011	9 oct. 2002
Série Portefeuilles de revenu CI	4 août 2015	-	-	17 nov. 2000	-	-	17 nov. 1997
Série Portefeuilles croissance maximale CI	4 août 2015	4 août 2015	4 août 2015	18 déc. 2001	-	28 sept. 2007	29 juin 2005

	Série O	**Série OT5**	**Série OT8**	**Série P**	**Série PT5**	**Série PT8**	**Série U**
Série Portefeuilles équilibrée CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1er mai 2017	1er mai 2017	1er mai 2017	-
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1er mai 2017	-	1er mai 2017	-
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	30 juill. 2013	-	-	1er mai 2017	-	-	-
Série Portefeuilles prudente CI	30 juill. 2013	-	-	1er mai 2017	-	-	7 sept. 2012*

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

^Les portefeuilles gérés de clientèle privée sont accessibles par l'entremise de Clientèle privée Assante, une division de CI Conseil Privé S.E.C. Les fonds utilisés dans les portefeuilles gérés de clientèle privée sont gérés par CI Investments Inc., société affiliée de CI Conseil Privé S.E.C.

	Date de création :						
	Série O	**Série OT5**	**Série OT8**	**Série P**	**Série PT5**	**Série PT8**	**Série U**
Série Portefeuilles croissance CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1er mai 2017	-	1er mai 2017	-
Série Portefeuilles de revenu CI	30 juill. 2013	-	-	1er mai 2017	-	-	-
Série Portefeuilles croissance maximale CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1er mai 2017	-	1er mai 2017	-

	Série UT6	**Série Y**	**Série Z**
Série Portefeuilles équilibrée CI	-	-	-
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	-	-	-
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	-	-	-
Série Portefeuilles prudente CI	7 sept. 2012*	-	17 sept. 2010*
Série Portefeuilles croissance CI	-	-	-
Série Portefeuilles de revenu CI	-	22 nov. 2019	22 nov. 2019
Série Portefeuilles croissance maximale CI	-	-	-

	Série A	**Série AT5**	**Série E**	**Série ET5**	**Série F**	**Série FT5**	**Série I**
Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-	3 août 2021	3 août 2021	3 août 2021
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-	3 août 2021	3 août 2021	3 août 2021
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-	3 août 2021	3 août 2021	3 août 2021
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019

	Série P	**Série PT5**	**Série O**	**Série OT5**
Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI	3 août 2021	3 août 2021	-	-
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019	21 janv. 2019

	Série A	**Série F**	**Série I**	**Série S**	**Série FNB $ CA**	**Série FNB couverte en $ US**
Mandat privé canadien de dividendes CI	17 juin 2019	17 juin 2019	17 juin 2019	-	-	-
Mandat privé d'actions canadiennes CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé de revenu fixe canadien CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	22 nov. 2019	-	-
Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	17 juill. 2020	-
Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé d'obligations d'état améliorées mondiales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé alpha d'actions mondiales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	8 avril 2022	8 avril 2022
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI	21 mai 2020	21 mai 2020	21 mai 2020	-	21 mai 2020	-
Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé d'actif réel mondial CI	21 mai 2020	21 mai 2020	21 mai 2020	-	21 mai 2020	-

**Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.*

	Série A	Série F	Série I	Série S	Série FNB $ CA	Série FNB couverte en $ US
Mandat privé d'immobilier mondial CI	21 mai 2020	21 mai 2020	21 mai 2020	-	21 mai 2020	-
Mandat privé de petites sociétés mondiales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé d'obligations sans restriction mondiales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé alpha d'actions internationales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé croissance d'actions internationales CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-
Mandat privé d'actions américaines CI	29 oct. 2018	29 oct. 2018	29 oct. 2018	-	-	-

Le 8 avril 2022, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI
Mandat privé de rendement équilibré mondial CI	Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI
Catégorie mandat privé de rendement équilibré CI	Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI
Mandat privé momentum d'actions mondiales CI	Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI
Mandat privé valeur d'actions internationales CI	Mandat privé croissance d'actions internationales CI
Mandat privé d'actions de sociétés nord-américaines à petite/moyenne capitalisation CI	Mandat privé de petites sociétés mondiales CI
Catégorie mandat privé d'actions américaines CI	Mandat privé d'actions américaines CI
Catégorie mandat privé d'actions américaines neutre en devises CI	Mandat privé d'actions américaines CI
Catégorie mandat privé d'actions de revenu canadiennes CI	Mandat privé d'actions canadiennes CI
Fonds de revenu équilibré prudent CI	Fonds équilibré canadien CI
Fonds équilibré de valeur mondiale CI	Fonds mondial de croissance et de revenu 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

Le gestionnaire a utilisé la méthode de l'acquisition pour comptabiliser la fusion des Fonds. Selon cette méthode, l'un des Fonds est désigné le Fonds acquéreur et est désigné le « Fonds prorogé » et l'autre Fonds visé par la fusion est désigné le « Fonds clôturé ». Cette désignation est fondée sur la comparaison de la valeur liquidative relative des Fonds, ainsi que sur la prise en compte du maintien de certaines caractéristiques du Fonds prorogé, telles que les objectifs et procédures de placement et les types de titres en portefeuille.

En date du 8 avril 2022, à la clôture des bureaux, le Fonds prorogé a acquis tous les actifs nets du Fonds clôturé en échange de titres du Fonds prorogé. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de cette fusion correspond à l'actif net transféré du Fonds clôturé. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont eu lieu sur une base imposable, à l'exception du Mandat privé de rendement équilibré mondial CI, du Fonds de revenu équilibré prudent CI, du Fonds équilibré de valeur mondiale CI, du FNB actif Crédit CI et du FNB actif Services publics et infrastructures CI.

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis ($)	Parts émises
Fonds de gestion canadien petite/moyenne capitalisation CI	Fonds d'actions de revenu à petite/moyenne capitalisation canadiennes CI	441 714 045	14 515 093
Mandat privé de rendement équilibré mondial CI	Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI	46 219 882	3 844 222
Catégorie mandat privé de rendement équilibré CI	Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI	29 042 043	2 410 054
Mandat privé momentum d'actions mondiales CI	Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI	1 837 972	130 106
Mandat privé valeur d'actions internationales CI	Mandat privé croissance d'actions internationales CI	661 521	52 993
Mandat privé d'actions de sociétés nord-américaines à petite/moyenne capitalisation CI	Mandat privé de petites sociétés mondiales CI	344 471	30 429
Catégorie mandat privé d'actions américaines CI	Mandat privé d'actions américaines CI	6 435 042	578 596
Catégorie mandat privé d'actions américaines neutre en devises CI	Mandat privé d'actions américaines CI	1 437 990	129 352
Catégorie mandat privé d'actions de revenu canadiennes CI	Mandat privé d'actions canadiennes CI	1 505 343	125 928
Fonds de revenu équilibré prudent CI	Fonds équilibré canadien CI	253 963 157	24 951 731
Fonds équilibré de valeur mondiale CI	Fonds mondial de croissance et de revenu CI	138 011 116	13 797 039
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

Le 23 juillet 2021, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
Fonds de revenu mensuel Cambridge	Fonds mondial d'actions et de revenu CI
Catégorie de société de revenu mensuel Cambridge	Fonds mondial d'actions et de revenu 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.

En date du 23 juillet 2021, à la clôture des bureaux, le Fonds prorogé a acquis tous les actifs nets du Fonds clôturé en échange de titres du Fonds prorogé. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de cette fusion correspond à l'actif net transféré du Fonds clôturé. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont été effectuées sur une base imposable.

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis ($)	Parts émises
Fonds de revenu mensuel Cambridge	Fonds mondial d'actions et de revenu CI	72 483 028	6 467 098
Catégorie de société de revenu mensuel Cambridge	Fonds mondial d'actions et de revenu CI	22 371 111	2 174 468

Les résultats des Fonds clôturés ne figurent pas dans ces états financiers.

Les états de la situation financière sont aux 31 mars 2023 et 2022, le cas échéant. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les exercices clos les 31 mars 2023 et 2022, sauf dans le cas des Fonds lancés au cours de l'un ou l'autre de ces exercices; pour ceux-ci, les données fournies couvrent la période allant de la date de création aux 31 mars 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 :

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 d'investissement, 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 tenues aux fins de négociation et sont donc comptabilisées en tant que passifs financiers à la JVRN. Les contrats de dérivés dont la juste valeur est négative sont présentés en tant que passifs à la JVRN.

Les obligations des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables correspondent au montant du rachat, qui se rapproche de la juste valeur. Tous les autres actifs et passifs financiers sont évalués au coût amorti, qui se rapproche de la juste valeur. Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisé s'il y a lieu, selon le taux d'intérêt effectif.

Les actifs financiers et passifs financiers sont compensés et les soldes nets sont présentés 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 titres pour lesquels il n'existe aucun prix sur le marché 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 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 titres pour lesquels il n'existe aucun prix sur le marché.

c. Trésorerie

La trésorerie comprend les dépôts en espèces et le découvert bancaire.

d. Coût des placements

Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est déterminé selon le coût moyen, commissions et coûts de transaction non compris. Le coût moyen n'inclut pas l'amortissement des primes ou des escomptes sur les titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro.

e. Opérations de placement et comptabilisation des revenus

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération, c'est-à-dire à la date où un Fonds s'engage à acheter ou à vendre un placement. Les intérêts à distribuer 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 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. Monnaie fonctionnelle et monnaie de présentation

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds, sauf pour le Fonds marché monétaire É-U CI, le Fonds de revenu américain en dollars US CI, le Fonds de dividendes américains en dollars US CI, le Fonds de bitcoins CI et le Fonds Ethereum CI, Fonds pour lesquels le dollar américain est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation. Pour les Fonds qui offrent des parts des séries AH, FH, IH, PH et WH, la valeur liquidative par part de ces séries est libellée en dollars américains.

g. Opérations sur devises

Les montants en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle comme suit : les placements, les contrats de change à terme et les autres actifs et passifs à la juste valeur, au cours du change de clôture chaque jour ouvrable; les revenus et les charges, les achats, les ventes et les règlements de placements, au cours du change en vigueur à la date des opérations en cause. Les profits et pertes de change sur la trésorerie sont présentés à titre de « Profit (perte) de change sur la trésorerie » et les profits et pertes de change se rapportant à d'autres actifs et passifs financiers sont présentés sous les postes « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés » et « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global.

h. Évaluation des parts

La valeur liquidative par part de chaque série est calculée à la fin de chaque jour ouvrable de la TSX en divisant la valeur liquidative totale de chaque série d'un Fonds par le nombre de parts en circulation de cette série.

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.

Aux 31 mars 2023 et 2022, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables utilisé aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

i. Classement des parts

Les parts de chacun 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.

j. 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 des parts de fonds sous-jacents ne sont pas assujettis aux coûts de transaction.

k. Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part

« L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part » dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque série de fonds par le nombre moyen pondéré de parts de cette série en circulation au cours de l'exercice.

l. 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 ».

m. Contrats à terme

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 ».

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 ».

o. Contrats de swap de taux d'intérêt

La juste valeur des swaps sur taux d'intérêt est déterminée en fonction des cours de clôture indicatifs fournis par des sociétés de courtage indépendantes. Les sociétés de courtage établissent la juste valeur à l'aide de modèles d'évaluation fondés sur des hypothèses qui sont étayées par des données observables du marché, y compris les taux d'intérêt du jour. Les cours de clôture indicatifs sont évalués indépendamment à l'interne afin de garantir qu'ils sont raisonnables. Tout revenu perçu et toutes charges engagées découlant des swaps sur taux d'intérêt sont enregistrés dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ». Le profit latent ou la perte latente découlant des swaps sur taux d'intérêt sont indiqués dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés ». Lorsque les swaps sur taux d'intérêt sont liquidés, tout profit et toute perte sont enregistrés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

p. Swaps sur rendement total

Les swaps sur rendement total sont des contrats conclus entre un Fonds et une contrepartie dans le cadre duquel des flux de trésorerie sont échangés en fonction du prix d'un actif de référence sous-jacent et d'un taux fixe ou variable. Pendant la durée du contrat, le Fonds verse à la contrepartie une série de paiements périodiques basés sur un taux fixe ou variable. Ces paiements s'accumulent quotidiennement et sont comptabilisés dans les états du résultat global en « frais d'intérêts ». À la date d'échéance du contrat, il y a échange de flux de trésorerie nets, le rendement total étant équivalent au rendement de l'actif de référence sous-jacent, moins un taux convenu, s'il y a lieu. En tant que receveur, le Fonds recevrait des paiements fondés sur tout rendement total net positif et aurait à effectuer des versements en cas de rendement total net négatif. Le profit latent ou la perte latente découlant des swaps sur rendement total sont indiqués dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés ». Lorsque les swaps sur rendement total sont liquidés, tout profit et toute perte sont enregistrés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

q. 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 défaut, 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 ».

r. Titres adossés à des créances hypothécaires et titres garantis par des actifs

Certains Fonds investissent dans des titres adossés à des créances hypothécaires et des titres garantis par des actifs. Ces titres peuvent comprendre : des titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques, des titres adossés à des actifs avec flux groupés, des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales, des titres garantis par des actifs, des titres garantis par des créances et autres titres qui représentent directement ou indirectement une participation dans un prêt hypothécaire sur biens immobiliers ou sont garantis par un tel prêt ou payable à partir d'un tel prêt. Les titres de créance et de capitaux propres émis par ces titres peuvent inclure des tranches avec différents niveaux de subordination. Ces titres peuvent fournir un versement mensuel composé de paiements d'intérêts et de capital.

Les titres liés aux créances hypothécaires sont créés à partir de portefeuilles de prêts hypothécaires résidentiels ou commerciaux, notamment des prêts hypothécaires consentis par des institutions d'épargne et de crédit, des banquiers hypothécaires, des banques commerciales et autres. Les titres garantis par des actifs sont créés à partir de plusieurs types d'actifs, notamment des prêts automobiles, des créances sur cartes de crédit, des prêts sur valeur domiciliaire et des prêts étudiants.

Les titres liés aux créances hypothécaires et les titres garantis par des actifs sont émis par tranches distinctes, ou par catégories de titres pour chaque opération. Les titres sont également évalués de manière générale par un service d'évaluation des cours qui utilise les cotes des sociétés de courtage ou les estimations de leurs modèles internes d'évaluation. Les modèles d'évaluation pour ces titres considèrent généralement les caractéristiques au niveau des tranches, les données actuelles du marché, les flux de trésorerie estimés et les taux de rendement fondés sur le marché pour chaque tranche, et intègrent le rendement des garanties, le cas échéant. Les valeurs comptables des titres liés à des créances hypothécaires et les titres garantis par des actifs sont incluses au poste « Placements » dans les états de la situation financière. La variation de la juste valeur des titres liés à des créances hypothécaires et les titres garantis par des actifs est comprise au poste « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » des états du résultat global.

s. 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 dans le compte sur marge pour les ventes à découvert sont incluses dans les états de la situation financière au poste « Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert ». 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 » et dans les états de la situation financière sous « Placements vendus à découvert ». 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 ».

t. Compensation des instruments financiers

Les informations présentées dans les tableaux « Compensation des instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant, 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 des biens donnés en garantie par la contrepartie est décrite dans les notes annexes propres au Fonds.

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.

u. Participations dans des entreprises associées, des coentreprises, des filiales et des entités structurées non consolidées

Les filiales sont des entités, y compris les investissements dans d'autres entités d'investissement, sur lesquelles un Fonds exerce un contrôle. Un Fonds contrôle une entité lorsqu'il est exposé ou qu'il a droit à des rendements variables en raison de ses liens avec l'entité, et qu'il a la capacité d'influer sur ces rendements du fait du pouvoir qu'il détient sur celle-ci. Les entreprises associées et les coentreprises sont des participations dans des entités sur lesquelles un Fonds exerce une influence notable ou un contrôle conjoint. Une entité structurée est une entité qui a été conçue de telle sorte que les droits de vote ou droits similaires ne sont pas les facteurs dominants pour déterminer qui contrôle l'entité, ou de telle sorte que les droits de vote sont uniquement liés à des tâches administratives et que les activités pertinentes sont régies par des dispositions contractuelles.

Le gestionnaire a déterminé que le ou les fonds sous-jacents ou le ou les fonds négociés en Bourse (« FNB ») détenus par les Fonds répondent généralement à la définition d'une entité structurée. Les titres adossés à des créances hypothécaires et les titres adossés à des actifs 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 fonds sous-jacent concerné et sont sensibles au risque de prix du marché découlant des incertitudes entourant les valeurs futures du fonds sous-jacent 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 du ou des fonds sous-jacents, sauf lorsque les Fonds investissent dans certaines séries/catégories du ou des fonds sous-jacents pour lesquelles la rémunération des gestionnaires de portefeuille est négociée et payée à l'extérieur du fonds sous-jacent concerné. Le ou les fonds sous-jacents financent leurs activités en émettant des parts rachetables qui donnent droit aux porteurs à une participation égale du fonds sous-jacent concerné. Les Fonds peuvent demander le rachat de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents sur une base quotidienne.

Certains Fonds effectuent des placements dans un ou des FNB. Les 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, aux États-Unis et au Japon 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.

Les placements des Fonds dans le ou les fonds sous-jacents ou le ou les FNB sont comptabilisés à la JVRN et inclus au poste « Placements » 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 FNB, le ou les fonds sous-jacents et les titres adossés à des créances hypothécaires ou les titres garantis par des actifs est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans ces entités structurées non consolidées.

Des renseignements supplémentaires se rapportant à la participation de chaque Fonds dans des entités structurées non consolidées figurent dans les notes annexes propres au Fonds, le cas échéant.

v. Retenues d'impôts

Un Fonds peut, de temps à autre, être assujetti 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.

w. Taxe de vente harmonisée

Certaines provinces, y compris l'Ontario, l'Île-du-Prince-Édouard, la Nouvelle-Écosse, le Nouveau-Brunswick et Terre-Neuve-et-Labrador (chacune, une juridiction fiscale participante), ont harmonisé leur taxe de vente provinciale (« TVP ») avec la taxe fédérale sur les produits et services (« TPS »). La taxe de vente harmonisée (« TVH ») correspond au taux de 5 % de la TPS fédérale combiné à celui de la TVP des provinces concernées. La province de Québec perçoit également la taxe de vente du Québec (« TVQ »). La TVH à verser ou à recevoir est calculée selon le lieu de résidence des porteurs de parts et la valeur de leur participation dans le Fonds à une date donnée, et non en fonction du territoire dont relève le Fonds. Le taux effectif des taxes de vente applicable à chaque série du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts entre les provinces. Il est calculé selon le taux de TVH ou, si la province concernée n'applique pas la TVH, selon le taux de TPS ou de la TVQ. Tous les montants à ce titre sont inscrits au poste « Taxe de vente harmonisée » des états du résultat global.

x. Opérations autres qu'en espèces

Les opérations autres qu'en espèces figurant dans les tableaux des flux de trésorerie comprennent le réinvestissement des distributions du ou des fonds communs sous-jacents et des dividendes en actions issus des placements en actions ainsi que les acquisitions d'actifs des fonds dissous. Le montant du réinvestissement des distributions du ou des fonds communs de placement sous-jacents et des dividendes en actions issus des placements en actions représente le revenu autre qu'en espèces comptabilisé dans les états du résultat global.

Le « produit de l'émission de parts rachetables » et les « montants versés lors du rachat de parts rachetables » dans les états des flux de trésorerie excluent les transactions hors trésorerie.

3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

La préparation de ces états financiers conformément 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 charges pour l'exercice de présentation de l'information financière. 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 sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire selon les hypothèses et les estimations sur des paramètres disponibles au moment de la préparation des états financiers. 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 d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion de placements, qui déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital ou de revenus de placement ou les deux, et qui évalue et mesure la performance de ses placements sur la base de la juste valeur. Par conséquent, les Fonds ne consolident pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent plutôt à la JVRN, comme l'exige la norme comptable.

4. PARTS RACHETABLES

Les parts rachetables émises et en circulation représentent le capital de chaque Fonds.

Série de fonds communs de placement

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts rachetables et cessibles de chaque série. En général, il n'existe aucune restriction ni exigence de capital particulière pour les Fonds, sauf en ce qui a trait au montant minimal des souscriptions/rachats.

Séries de FNB

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts des séries de FNB. Les parts des séries de fonds négocié en Bourse (FNB) sont cotées à la TSX et les porteurs de parts peuvent acheter ou vendre ces parts à la TSX par l'entremise de courtiers inscrits.

Un courtier désigné ou un courtier de FNB peut, un jour de Bourse donné, transmettre un ordre de souscription visant le nombre prescrit de parts de séries de FNB ou un multiple intégral du nombre prescrit de parts de chaque Fonds. Un jour de Bourse est tout jour pendant lequel une séance est tenue à la TSX.

Si l'ordre de souscription est accepté, le Fonds émettra généralement le nombre prescrit de parts à un courtier de FNB ou au courtier désigné (ou un multiple intégral du nombre prescrit de parts) dans un délai de deux jours de Bourse suivant la date de prise d'effet de l'ordre de souscription. Pour chaque nombre prescrit de titres émis, un courtier de FNB ou le courtier désigné doit remettre le produit de la souscription composé d'un ensemble de titres et/ou d'actifs déterminé par le gestionnaire de temps à autre qui représente les titres constituants du Fonds (un « panier de titres ») et un montant en espèces suffisant pour que la valeur du panier de titres et de la somme en espèces reçue soit égale à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts du Fonds calculée à l'heure d'évaluation à la date de prise d'effet de l'ordre de souscription en plus des frais de souscription applicables établis par le gestionnaire.

Les parts de chaque série de FNB peuvent également être émises aux porteurs de parts du Fonds au réinvestissement automatique de certaines distributions conformément à la politique de distribution du Fonds.

Les porteurs de parts peuvent échanger le nombre prescrit de titres (ou un multiple intégral de celui-ci) de chaque Fonds tout jour de Bourse contre des paniers de titres 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 du nombre prescrit de parts applicable déposé dans le cadre de l'échange déterminé à l'heure d'évaluation à la date de prise d'effet de la demande d'échange, payable au moyen de la livraison d'un panier de titres (dont la constitution est celle la plus récemment publiée avant la date de prise d'effet de la demande d'échange) et d'un montant au comptant. Les parts des séries de FNB seront rachetées dans le cadre de l'échange.

Tout jour de Bourse, les porteurs de parts des séries de FNB de chaque Fonds peuvent faire racheter : i) des parts des séries de FNB contre une somme en espèces à un prix de rachat par part des séries de FNB égal à 95 % du cours de clôture des parts des séries de FNB à la TSX à la date de prise d'effet du rachat moins les frais de rachat applicables établis par le gestionnaire, à son entière discrétion, de temps à autre; ou ii) un nombre de parts prescrit du Fonds ou un multiple de celui-ci contre une somme en espèces égale à la valeur liquidative de ce nombre de parts des séries de FNB moins les frais de rachat applicables établis par le gestionnaire, à son entière discrétion, de temps à autre.

Les porteurs de parts des séries de FNB qui ont présenté un ordre de rachat avant la date de clôture des registres pour toute distribution n'auront pas droit à cette distribution.

Les variations pertinentes relatives aux souscriptions et aux rachats de parts de chaque Fonds sont présentées dans les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables. Conformément aux politiques et aux objectifs de gestion des risques décrits aux notes 1 et 10, les Fonds s'efforcent d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant une liquidité suffisante pour régler les rachats en utilisant une facilité d'emprunt à court terme ou en cédant des placements au besoin.

L'information se rapportant aux transactions sur 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 certains Fonds.

Aux 31 mars, le gestionnaire détenait des placements dans les Fonds suivants :

Fonds	2023 (en $)	2022 (en $)
Fonds américain de petites sociétés CI	4 711	5 087
Fonds d'occasions Asie CI	2 493	2 471
Fonds de bitcoins CI	2 016	3 006
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	2 240	2 373
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 778	1 964
Fonds canadien de dividendes CI	1 664	1 711
Mandat privé canadien de dividendes CI	1 747	1 814
Fonds d'actions canadiennes CI	5 904	5 898
Mandat privé d'actions canadiennes CI	1 617	1 616
Mandat privé de revenu fixe canadien CI	1 896	1 959
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	1 264	1 332
Fonds de placements canadiens CI	1 389	1 487
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 117	1 141
Fonds de rendement diversifié CI	2 582	2 692
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	1 607	1 666
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	890	870
Fonds des marchés émergents CI	46 125	44 236
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	153 628	-
Fonds Ethereum CI	1 343	2 253
Fonds de revenu à taux variable CI	4 800	4 629
Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI	2 421	1 296

Fonds (suite)	2023 (en $)	2022 (en $)
Fonds équilibré mondial CI	1 281	1 227
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	164 449	-
Fonds d'obligations mondiales CI	872	879
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	66 014	61 939
Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI	5 624	2 944
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	2 997	3 092
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	1 487	1 478
Mandat privé d'obligations d'État améliorées mondiales CI	951	962
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	6 383	6 752
Mandat privé alpha d'actions mondiales CI	1 518	1 419
Fonds d'actions mondiales CI	6 440	6 620
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	198 015	-
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	2 530	2 578
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	1 035	-
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI	1 951	1 906
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	1 229	1 257
Mandat privé d'actif réel mondial CI	1 097	1 197
Mandat privé d'immobilier mondial CI	1 748	2 052
Fonds de ressources mondiales CI	4 977	4 813
Fonds de petites sociétés mondiales CI	3 925	4 181
Mandat privé de petites sociétés mondiales CI	4 510	1 417
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	1 661 157	1 600 057
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	197 632	-
Mandat privé d'obligations sans restriction mondiales CI	1 195	1 208
Fonds de valeur mondiale CI	4 127	3 903
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	182 712	-
Fonds de revenu élevé CI	1 374	1 450
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	2 368	2 450
Fonds de revenu CI	1 076	1 099
Mandat privé alpha d'actions internationales CI	2 978	2 761
Mandat privé croissance d'actions internationales CI	5 969	2 543
Fonds de valeur internationale CI	3 973	3 684
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	64 513	62 116
Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI	936	964
Fonds marché monétaire CI	1 030	999
Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI	8 632	8 754
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI	10 516	10 679
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI	9 184	9 328
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI	458 214	474 579
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI	458 578	476 997
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI	454 007	470 718
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI	12 619	12 774
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI	8 569	8 679
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	6 303	5 817

Fonds (suite)	2023 (en $)	2022 (en $)
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance		
CI Munro	65 379	62 772
Série Portefeuilles équilibrée CI	9 864	10 009
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	11 668	11 883
Série Portefeuilles prudente CI	1 082	1 115
Série Portefeuilles croissance CI	11 827	12 014
Série Portefeuilles croissance maximale CI	14 181	14 352
Fonds d'actions privilégiées CI	2 756	3 075
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	1 553	1 777
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	1 658	1 742
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	1 505	1 546
Fonds de lancement Sélect CI	23 902	23 338
Fonds d'obligations à court terme CI	2 040	2 027
Fonds américain Synergy CI	4 145	4 179
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	177 121	-
Fonds américain de dividendes CI	3 001	2 854
Fonds enregistré de dividendes américains CI	4 431	4 226
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	5 750	5 500
Mandat privé d'actions américaines CI	1 908	1 382
Fonds de revenu américain en dollars US CI	5 509	5 291
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	2 986	3 001
Fonds marché monétaire É-U CI	1 412	1 268

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.

Les frais de gestion sont calculés selon un pourcentage de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds (autre que les séries I, IT5, IT8, IH, O, OO, OT5, OT8, P, PH PP, PT5, PT8 et S et les séries offertes dans le cadre des Portefeuilles gérés de Clientèle privée) à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes applicables, comme la TVH, la TPS et la TVQ.

Des frais de gestion négociés entre l'investisseur et le gestionnaire sont imputés directement aux investisseurs dans les parts des séries I, IT5, IT8, IH, O, OO, OT5, OT8, P, PH, PP, PT5, PT8 et S et des séries offertes dans le cadre des Portefeuilles gérés de Clientèle privée.

Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, le Gestionnaire des Fonds a absorbé un total de 45 000 $ (100 000 $ au 31 mars 2022), 1 474 000 $ (3 248 000 $ au 31 mars 2022), 3 269 000 $ (1 646 000 $ au 31 mars 2022) et 31 000 $ US (107 000 $ US au 31 mars 2022) en frais de gestion en raison de la baisse des rendements générés par les Fonds suivants : Le Mandat privé d'infrastructures mondiales CI, le Fonds marché monétaire CI, le Fonds d'épargne à intérêt élevé CI et le Fonds marché monétaire É-U CI, respectivement.

Frais d'administration

Le gestionnaire absorbe tous les frais d'exploitation des Fonds (à part certaines taxes, certains coûts d'emprunt et certains nouveaux droits gouvernementaux) en échange de frais d'administration annuels. Les frais d'administration sont calculés selon un pourcentage annuel de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds (autre que les séries I, IT5, IT8, IH et S) à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes applicables, comme la TVH, la TPS et la TVQ.

Des frais d'administration négociés entre l'investisseur et le gestionnaire sont imputés directement aux investisseurs des parts des séries I, IT5, IT8, IH et S.

Les frais d'administration ne s'appliquent pas au Fonds marché monétaire CI, au Fonds marché monétaire É-U CI ni au Fonds de lancement Sélect CI.

Rabais sur frais

Selon la taille du placement d'un porteur de parts ou la participation de ce dernier à un programme offert par le gestionnaire à l'égard des comptes plus importants, le gestionnaire peut réduire les frais de gestion et/ou d'administration. En se basant sur la documentation pertinente qui lui est fournie, le gestionnaire peut également réduire les frais de gestion si une commission de suivi réduite a été négociée entre le porteur de parts et son représentant. À la fin de chaque trimestre, le montant de toute réduction des frais de gestion et/ou d'administration est distribué aux porteurs de parts admissibles par le Fonds sous forme de réinvestissement dans des parts additionnelles de la série correspondante du Fonds. 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 ». Le gestionnaire peut réduire les frais de gestion et les frais d'administration, ou y renoncer, sans donner d'avis aux porteurs de parts.

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 (des) fonds sous-jacent(s). Au cours de l'exercice, un Fonds peut avoir reçu une remise sur les frais de gestion et/ou d'administration de la part du gestionnaire du (des) fonds sous-jacent(s) en rapport avec son investissement dans un (des) fonds sous-jacent(s). Les rabais sur frais de gestion ou d'administration 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/d'administration de chaque série de chaque Fonds.

6. PRÊT DE TITRES

Certains Fonds ont conclu une entente de prêt de titres avec leur agent de prêt. La valeur de marché totale de tous les titres prêtés par un Fonds ne pourra pas dépasser 50 % de ses actifs. Un Fonds recevra une garantie correspondant à au moins 102 % de la valeur des titres prêtés. La garantie se composera généralement de trésorerie et d'obligations émises ou garanties par le gouvernement du Canada ou une province, par le gouvernement des États-Unis ou une de ses agences officielles, mais peut aussi comprendre des obligations d'autres gouvernements bénéficiant d'une note de crédit convenable. 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. Les revenus tirés des prêts de titres figurent au poste « Revenu tiré des prêts de titres » des états du résultat global.

7. IMPÔTS SUR LE REVENU

Les Fonds, à l'exception du Fonds d'obligations de marchés émergents CI, du Fonds d'obligations vertes mondiales CI, du Fonds d'infrastructures durables mondiales CI, du Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI, du Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI, Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI, Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI, du Fonds de gestion d'actions canadiennes Select CI, du Fonds de gestion d'actions internationales Select CI, du Fonds de lancement Select CI, du Fonds de gestion d'actions américaines Select CI, du Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI, du Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI, du Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, du Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI et du Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI répondent à la définition de fiducie de fonds commun de placement en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du résultat net des Fonds aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours de tout exercice doivent être distribuées 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.

Le Fonds d'obligations de marchés émergents CI, le Fonds d'obligations vertes mondiales CI, le Fonds d'infrastructures durables mondiales CI, le Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI le Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI, Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI, Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI, le Fonds de gestion d'actions canadiennes Select CI, le Fonds de gestion d'actions internationales Select CI, le Fonds de lancement Select CI, le Fonds de gestion d'actions américaines Select CI, le Mandat d'obligations à long terme canadiennes CI et le Mandat d'obligations à court terme canadiennes CI, le Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, le Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI et le Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI répondent à la définition de fiducie d'investissement à participation unitaire en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et ne sont pas assujettis à l'impôt sur le revenu net, y compris les gains en capital nets réalisés pour l'année d'imposition, qui sont versés ou payables aux 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.

Le reste des impôts à payer et à recouvrer est inclus dans les états de la situation financière au poste « Autres ».

Voir le tableau sur les pertes fiscales reportées dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir plus d'information sur les pertes fiscales reportées.

8. RÉINVESTISSEMENT DES DISTRIBUTIONS

Lorsqu'une distribution est versée au porteur de parts, elle l'est dans la même monnaie que les parts. Les distributions sont réinvesties automatiquement sans frais dans le même Fonds ou versées en trésorerie aux porteurs de parts. Le gestionnaire peut modifier la politique de distributions à son gré.

Certains Fonds peuvent verser des distributions notionnelles. Les distributions notionnelles sont automatiquement réinvesties sans frais dans le même Fonds, puis les parts du Fonds en circulation seront consolidées de la manière nécessaire pour augmenter la valeur liquidative par part à celle qui prévalait avant la distribution et pour s'assurer que le nombre de parts en circulation immédiatement après ce réinvestissement et cette consolidation correspond au nombre de parts en circulation immédiatement avant le réinvestissement et la consolidation. Par conséquent, aucun paiement n'est effectué et aucune nouvelle part n'est émise.

Les distributions notionnelles sont incluses dans les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables.

9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp. ou ses filiales ou dans d'autres fonds gérés par le gestionnaire.

Le gestionnaire des Fonds peut, à l'occasion, effectuer des placements initiaux dans certaines séries de certains Fonds pour favoriser l'établissement d'une série ou d'un Fonds. Les détails des placements effectués par le gestionnaire sont présentés à la note 4.

Opérations avec un émetteur lié

Ces opérations surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète les titres de CI Financial Corp. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le Comité d'examen indépendant (CEI) passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2023, les Fonds n'ont pas effectué d'opérations entre émetteurs liés et ne détenaient non plus aucune position dans CI Financial Corp. Au cours de l'exercice clos le 31 mars 2022, certains Fonds ont effectué des opérations entre émetteurs liés connexes ou détenaient des positions dans CI Financial Corp.

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. Durant les exercices clos les 31 mars 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 exercice.

Opérations entre fonds

Ces opérations entre fonds surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète un titre d'un émetteur auprès d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le CEI passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours des exercices clos les 31 mars 2023 et 2022, les Fonds ont effectué des opérations entre fonds.

10. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Conflit entre l'Ukraine et la Russie

Le conflit entre l'Ukraine et la Russie a entraîné une volatilité et une incertitude importantes sur les marchés des capitaux. Les pays membres de l'OTAN, de l'UE et du G7, y compris le Canada, ont imposé des sanctions sévères et coordonnées contre la Russie. Des mesures restrictives ont également été imposées par la Russie et certains titres ont subi une baisse importante de leur valeur ou pourraient ne plus être négociables. Ces actions ont entraîné des perturbations importantes des activités d'investissement et des entreprises ayant des activités en Russie. L'impact à plus long terme sur les normes géopolitiques, les chaînes d'approvisionnement et les évaluations des investissements est incertain.

À mesure que la situation évolue, le gestionnaire continue de surveiller les événements en cours et leur incidence sur les stratégies de placement.

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, des changements politiques, des pandémies mondiales 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.

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.

Pour atteindre son objectif de placement, le Fonds d'obligations de qualité supérieure CI et Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI exercent un effet de levier en effectuant des ventes à découvert.

Chaque Fonds peut emprunter des espèces jusqu'à concurrence de 20 % de son actif net et peut vendre des titres à découvert; ainsi, la valeur marchande globale des titres vendus à découvert sera limitée à 20 % de l'actif net du Fonds. L'utilisation combinée de la vente à découvert et des emprunts par le Fonds est assujettie à une limite globale de 20 % de l'actif net du Fonds.

Durant l'exercice clos le 31 mars 2023, la juste valeur globale la plus basse de l'effet de levier exercé par le Fonds d'obligations de qualité supérieure CI s'élevait à 4,4 millions $ (0,5 % de la valeur liquidative) (0 million $, ou 0 % de la valeur liquidative au 31 mars 2022) et la juste valeur globale la plus élevée de l'effet de levier utilisé durant l'exercice s'élevait à 7,8 millions $ (0,8 % de la valeur liquidative) (8,4 millions $, ou 0,7 % de la valeur liquidative au 31 mars 2022).

Durant l'exercice clos le 31 mars 2023, la juste valeur globale la plus basse de l'effet de levier exercé par le Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI s'élevait à 0 million $ (0 % de la valeur liquidative) (0 million $, ou 0 % de la valeur liquidative au 31 mars 2022) et la juste valeur globale la plus élevée de l'effet de levier utilisé durant l'exercice s'élevait à 0,2 million $ (0,4 % de la valeur liquidative) (0,2 million $, ou 0,4 % de la valeur liquidative au 31 mars 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.

Des renseignements ayant trait à l'exposition au risque de concentration sont présentés 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 ou dans les notes annexes propres au Fonds des états financiers 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.

Les 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, le cas échéant, 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.

Note de crédit selon le tableau sur le risque de crédit	**Note de crédit selon les tableaux sur les 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, à l'exception des soldes de la trésorerie soumise à restriction et des comptes sur marge, présentés dans les états de la situation financière sont conservés par le dépositaire. Le gestionnaire surveille régulièrement la solvabilité du dépositaire. Au 31 mars 2023, la note de crédit de la Compagnie Trust CIBC Mellon aux investisseurs était de AA (au 31 mars 2022, la note de la Fiducie RBC Services aux investisseurs était de AA-).

Toutes les opérations effectuées par un 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 est le risque qu'un Fonds ne puisse pas respecter ses engagements à temps ou à un prix raisonnable. Les Fonds sont exposés à des rachats en trésorerie quotidiens de parts rachetables. Par conséquent, les Fonds investissent la majorité de leur actif dans des placements qui sont négociés sur des marchés actifs et qui peuvent être vendus facilement. De plus, les Fonds conservent des positions en trésorerie et en équivalents de trésorerie assez élevées afin de maintenir leur niveau de liquidités. De temps à autre, les Fonds pourraient conclure un contrat dérivé ou investir dans des titres non cotés qui pourraient ne pas se négocier sur un marché organisé ou encore être illiquides. Tous les passifs financiers arrivent à échéance dans trois mois ou moins.

Risque de marché

Les placements des fonds sont exposés au risque de marché, qui est le risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des conditions du marché.

Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt). La valeur de chaque placement est influencée par les perspectives de l'émetteur et par les conditions économiques et politiques générales, de même que par les tendances du secteur et du marché. Les titres présentent tous un risque de perte de capital. Sauf pour les options vendues, les contrats à terme standardisés vendus à découvert et les placements vendus à découvert, le risque maximal provenant des instruments financiers est équivalent à leur juste valeur. Sur les options d'achat vendues, les positions vendeur à terme et les titres de capitaux propres et titres de créance vendus à découvert, la perte maximale du capital peut être illimitée.

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 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.

Les Fonds qui investissent uniquement dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents peuvent être exposés au risque de change indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents investissent dans des instruments financiers qui sont libellés en devises autres que la monnaie fonctionnelle du Fonds.

Risque de taux d' intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt varie en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur 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 parts ordinaires, les titres convertibles sont généralement moins touchés par les fluctuations de taux d'intérêt que d'autres titres de créance.

Les Fonds qui investissent uniquement dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents peuvent être exposés au risque de taux d'intérêt indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents investissent dans des instruments financiers portant intérêt.

Risques spécifiques liés aux actifs numériques

Certains Fonds peuvent être indirectement exposés aux risques suivants qui sont associés à l'investissement dans les actifs numériques.

Nature spéculative des actifs numériques

L'investissement dans les actifs numériques, comme le bitcoin ou l'ethereum, est spéculatif, les prix sont volatils et les mouvements du marché sont difficiles à prévoir. L'offre et la demande d'actifs numériques peuvent évoluer rapidement et sont affectées par divers facteurs, notamment la réglementation et les tendances économiques générales.

Risques imprévisibles

Les actifs numériques n'ont été acceptés sur le plan commercial qu'au cours des dernières années et, par conséquent, il existe peu de données sur leur potentiel d'investissement à long terme. En outre, en raison de la nature rapidement évolutive du marché des actifs numériques, y compris les progrès de la technologie sous-jacente, les changements apportés aux actifs numériques peuvent exposer les investisseurs du Fonds à des risques supplémentaires impossibles à prévoir. Cette incertitude rend un investissement dans les parts d'un Fonds très risqué.

Risque associé à la garde des actifs numériques

Lors de l'investissement dans des actifs numériques, il existe un risque de perte, de vol, de destruction ou d'inaccessibilité d'une partie ou de la totalité des avoirs en actifs numériques, potentiellement par la perte ou le vol des clés privées détenues par le dépositaire et le sous-dépositaire associées aux adresses publiques qui détiennent les actifs numériques et/ou par la destruction du matériel de stockage. De multiples vols d'actifs numériques d'autres détenteurs ont eu lieu dans le passé. En raison du processus décentralisé de transfert d'actifs numériques, les vols peuvent être difficiles à retracer, ce qui peut faire des actifs numériques une cible particulièrement attrayante pour les vols.

L'accès aux actifs numériques pourrait être restreint par des événements naturels (tels qu'un tremblement de terre ou une inondation) ou des gestes posés par les humains (telles qu'une attaque terroriste). Les actifs numériques détenus dans les comptes de dépôt peuvent être une cible attrayante pour les pirates ou les distributeurs de logiciels malveillants qui cherchent à détruire, à endommager ou à voler les actifs numériques ou les clés privées.

Les violations de la sécurité, les cyberattaques, les logiciels malveillants et les attaques de piratage informatique constituent une préoccupation majeure pour les plateformes de négociation d'actifs numériques. Toute violation de la cybersécurité causée par un piratage informatique, qui consiste en des efforts pour obtenir un accès non autorisé à des informations ou à des systèmes, ou pour provoquer des dysfonctionnements intentionnels ou la perte ou la corruption de données, de logiciels, de matériel ou d'autres équipements informatiques, ainsi que la transmission par inadvertance de virus informatiques, pourrait nuire aux activités ou à la réputation d'une société, entraînant la perte des actifs.

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 peuvent comprendre 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 américains 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 titres de fonds d'actions privés et certains dérivés. Des cours observables n'étant pas disponibles pour ces titres, les Fonds pourraient utiliser une variété de techniques d'évaluation pour calculer la juste valeur.

La politique des Fonds consiste à comptabiliser les transferts d'un niveau à l'autre de la hiérarchie à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes spécifiques aux états financiers de chaque Fonds.

11. LÉGENDE DES DEVISES

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

11. LÉGENDE DES DEVISES (suite)

TWD	Nouveau dollar de Taiwan
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, Série G5|20, Placements CI et le logo Placements CI sont des marques déposées de Gestion mondiale d'actifs CI. Les marques et noms des logos CI et icône CI sont la propriété de Gestion mondiale d'actifs CI et sont utilisés sous licence. Gestion mondiale d'actifs CI est le nom d'une société enregistrée de CI Investments Inc.

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** ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet du Fonds, est disponible à l'adresse **www.ci.com** ou à l'adresse **www.sedar.com**.

Pour plus d'informations, veuillez visit www.ci.com.