



GESTION
MONDIALE D'ACTIFS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2023

30 SEPTEMBRE 2023

Table des matières

Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI	1
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI.....	16
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI.....	31
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI.....	46
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI.....	58
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI.....	70
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI.....	82
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI.....	95
Notes des états financiers	109
Avis juridique	129

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

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

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	383 861	379 605
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	15 642	13 488
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	62	93
Swaps, options sur swaps et options	-	19
Montant à recevoir pour la vente de placements	591	2 045
Montant à recevoir pour la souscription de parts	419	1 158
Dividendes à recevoir	30	15
Intérêts à recevoir	54	45
Rabais sur frais à recevoir	128	133
Autres comptes débiteurs	-	-
	400 787	396 601
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	57
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	26	13
Frais d'administration à payer	3	2
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	943	1 731
Montant à payer pour le rachat de parts	747	1 143
Autres comptes créditeurs	-	-
	1 719	2 946
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	399 068	393 655

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
Série A	246 833	239 030	11,15	11,34	22 146 032	21 080 046
Série AT5	328	181	8,79	9,16	37 274	19 706
Série E	9 440	10 097	11,15	11,34	846 350	890 028
Série ET5	1	1	8,77	9,15	133	130
Série F	86 798	83 482	11,21	11,35	7 739 925	7 357 979
Série FT5	46	48	8,85	9,18	5 250	5 247
Série I	16 686	18 059	11,27	11,36	1 480 984	1 590 027
Série O	13 928	14 624	11,25	11,35	1 238 342	1 288 765
Série OT5	20	20	8,88	9,18	2 148	2 160
Série P	24 987	28 112	11,23	11,34	2 224 108	2 480 058
Série PT5	1	1	8,87	9,18	140	136

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	3 825	2 384
Intérêts aux fins des distributions	1 115	1 267
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(34)	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	3 280	(1 803)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(11 908)	(33 330)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(3 722)	(31 482)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	48	134
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(3)	43
Rabais sur frais	788	701
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	833	878
Total des revenus	(2 889)	(30 604)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	2 134	1 703
Frais d'administration (note 5)	287	239
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	292	415
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	123	164
Taxe de vente harmonisée	266	203
Total des charges	3 103	2 725
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 992)	(33 329)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(4 327)	(20 233)	(0,20)	(1,15)	21 642 959
Série AT5	(6)	(19)	(0,18)	(0,98)	32 181	18 988
Série E	(157)	(1 235)	(0,18)	(1,16)	863 656	1 066 769
Série ET5	-	-	(0,16)	(0,99)	132	124
Série F	(1 040)	(6 179)	(0,14)	(1,07)	7 542 475	5 772 024
Série FT5	(1)	(6)	(0,10)	(0,95)	5 248	5 239
Série I	(129)	(566)	(0,09)	(0,58)	1 512 728	978 218
Série O	(121)	(1 449)	(0,10)	(1,09)	1 248 666	1 343 167
Série OT5	-	(1)	(0,08)	(0,92)	2 157	2 116
Série P	(211)	(3 635)	(0,09)	(1,18)	2 356 301	3 070 346
Série PT5	-	(6)	0,12	(0,40)	138	14 436

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	239 030	195 693	181	188	10 097	12 758	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(4 327)	(20 233)	(6)	(19)	(157)	(1 235)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(7)	-	(8)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(5)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(7)	(5)	(8)	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	33 876	35 388	157	1	274	442	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	3	3	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(21 746)	(15 027)	-	-	(766)	(994)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	12 130	20 361	160	4	(492)	(552)	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 803	128	147	(20)	(657)	(1 787)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	246 833	195 821	328	168	9 440	10 971	1	1

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	83 482	58 289	48	53	18 059	3 645	14 624	16 577
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 040)	(6 179)	(1)	(6)	(129)	(566)	(121)	(1 449)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(1)	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(1)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(1)	(1)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	14 851	23 423	-	-	373	14 739	647	373
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(10 495)	(6 713)	-	-	(1 617)	(2 553)	(1 222)	(1 694)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	4 356	16 710	-	-	(1 244)	12 186	(575)	(1 321)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 316	10 531	(2)	(7)	(1 373)	11 620	(696)	(2 770)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	86 798	68 820	46	46	16 686	15 265	13 928	13 807

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

États financiers (non audité)

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) 30 septembre (en milliers de dollars)

	Série OT5		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	20	21	28 112	44 010	1	1	393 655	331 236
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(1)	(211)	(3 635)	-	(6)	(5 992)	(33 329)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(16)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	(1)	-	-	-	(4)	-	(11)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	(1)	-	-	-	(4)	(16)	(11)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	1 343	2 598	-	175	51 521	77 139
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	3	3
Rachat de parts rachetables	-	-	(4 257)	(18 711)	-	(1)	(40 103)	(45 693)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	(2 914)	(16 113)	-	174	11 421	31 449
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(2)	(3 125)	(19 748)	-	164	5 413	(1 891)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	20	19	24 987	24 262	1	165	399 068	329 345

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(5 992)	(33 329)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(3 280)	1 803
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	11 908	33 330
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(3)	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	292	415
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	98 586	96 774
Achat de placements et de dérivés	(111 104)	(115 206)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(15)	(22)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(9)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	14	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	2	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	5	15
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(9 596)	(16 221)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(14)	(8)
Produit de l'émission de parts rachetables	47 191	62 858
Montant versé au rachat de parts rachetables	(35 430)	(31 703)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	11 747	31 147
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	3	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2 151	14 926
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13 488	7 381
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	15 642	22 308
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 106	1 267
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3 688	2 211
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	1 340 005	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	13 415 499	12 823 848	
	535 800	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	10 096 981	10 073 040	
	524 936	Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	10 568 235	10 724 443	
	1 409 044	FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	25 650 386	23 686 030	
	667 329	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	4 709 066	5 458 751	
	5 958 313	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	61 615 686	56 425 224	
	1 684 639	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	16 325 370	15 902 992	
	1 465 800	FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	29 459 970	28 671 048	
USD	285 880	Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	7 146 606	7 142 714	
	340 000	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	4 229 796	4 137 800	
	417 270	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	10 551 424	9 697 355	
	387 184	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	7 166 938	7 670 115	
	383 256	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	9 480 267	10 025 977	
	752 420	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	19 898 013	18 509 532	
	1 193 000	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	24 351 233	24 325 270	
	434 617	FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	8 036 965	6 840 872	
	470 495	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	15 908 025	16 109 749	
	785 744	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	21 209 085	20 232 908	
	419 528	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	15 320 902	17 099 961	
USD	609 897	FNB FTSE Japon Franklin	21 850 910	21 910 984	
	342 900	FNB Horizons Equal Weight Banks Index	6 621 412	6 460 236	
USD	63 296	iShares Core MSCI Europe ETF	4 382 377	4 269 359	
	823 545	iShares S&P/TSX 60 Index ETF	23 895 575	24 459 287	
USD	88 849	FNB JPMorgan Active Value	6 088 255	6 186 013	
USD	350 111	SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	10 539 600	9 429 924	
USD	158 175	FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	5 950 780	5 588 019	
	-		394 469 356	383 861 451	96,2
		Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	394 469 356	383 861 451	96,2
		Commissions et autres coûts de transaction	(557 150)		
		Total du portefeuille de placements avant les dérivés	393 912 206	383 861 451	96,2
		Contrat(s) de change à terme		62 495	0,0
		Total du portefeuille de placements	393 912 206	383 923 946	96,2
		Autres actifs (passifs) nets		15 144 464	3,8
		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		399 068 410	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Contract(s) contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 décembre 2023	USD	2 916 605	JPY	423 547 000	0,01	62 495
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								62 495

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	93	(28)	-	65
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	93	(28)	-	65
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(57)	28	-	(29)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(57)	28	-	(29)

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice 1000 É.-U. CI	82 580	24 325	29,5
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI	24 200	6 841	28,3
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	104 367	28 671	27,5
FNB alpha Marchés émergents CI	89 464	23 686	26,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	75 742	12 824	16,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	205 295	20 233	9,9
Fonds de lingots d'or CI	81 870	7 143	8,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	209 894	17 100	8,1
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	759 485	56 425	7,4
Fonds de produits de base généraux CI Auspice	145 257	10 724	7,4
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	137 689	6 460	4,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	94 116	4 138	4,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	270 159	10 026	3,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	591 221	16 110	2,7
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	311 501	7 670	2,5
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	540 768	9 697	1,8
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	565 472	10 073	1,8
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 067 307	15 903	1,5
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 303 147	18 510	1,4
FNB FTSE Japon Franklin	2 026 210	21 911	1,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	510 009	5 459	1,1
FNB JPMorgan Active Value	791 972	6 186	0,8
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 469 857	9 430	0,4
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	10 944 450	24 459	0,2
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2 656 672	5 588	0,2
iShares Core MSCI Europe ETF	5 375 820	4 269	0,1

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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) (%)
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	87 477	28 685	32,8
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	26 437	7 420	28,1
FNB alpha Marchés émergents CI	84 716	22 433	26,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	17 585	18,5
FNB Indice 500 É.-U. CI	125 345	22 175	17,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	173 939	15 941	9,2
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	9 994	8,6
Fonds de lingots d'or CI	70 540	5 060	7,2
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	51 103	7,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	197 470	13 504	6,8
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	12 338	4,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	15 069	2,9
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	9 894	2,5
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	3 144	2,0
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	11 844	1,9
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	9 532	1,6
FNB JPMorgan Active Value	446 855	6 310	1,4
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	17 633	1,3
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	19 008	1,2
FNB FTSE Japon Franklin	1 362 079	15 914	1,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	5 302	1,0
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 299 191	9 325	0,4
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	11 015 224	23 934	0,2
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	3 379 362	6 774	0,2
iShares Core MSCI Europe ETF	5 739 072	8 056	0,1
FNB BMO Equal Weight Banks Index	3 801 476	4 133	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	46 790 631	7 495	-

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	290	412
Paielements indirects†	108	116

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	21 080 046	16 683 554	19 706	18 810	890 028	1 087 781	130	122
Parts rachetables émises	2 981 881	3 204 566	17 258	70	24 033	40 200	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	310	329	-	-	3	4
Parts rachetables rachetées	(1 915 895)	(1 354 374)	-	-	(67 711)	(89 706)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	22 146 032	18 533 746	37 274	19 209	846 350	1 038 275	133	126

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	7 357 979	4 964 911	5 247	5 237	1 590 027	310 130	1 288 765	1 411 757
Parts rachetables émises	1 304 515	2 116 283	-	-	32 404	1 350 468	56 826	33 260
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	3	4	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(922 569)	(609 632)	-	-	(141 447)	(231 752)	(107 249)	(150 391)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	7 739 925	6 471 562	5 250	5 241	1 480 984	1 428 846	1 238 342	1 294 626

	Série OT5		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 160	2 119	2 480 058	3 746 359	136	126
Parts rachetables émises	-	-	118 175	237 434	-	18 586
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3	4	-	-	4	10
Parts rachetables rachetées	(15)	(16)	(374 125)	(1 708 134)	-	(74)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 148	2 107	2 224 108	2 275 659	140	18 648

†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.

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,500	0,150
Série AT5	1,500	0,150
Série E	1,500	0,150
Série ET5	1,500	0,150
Série F	0,500	0,150
Série FT5	0,500	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	30 059	2 716
Garanties (hors trésorerie)	31 562	2 771

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

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

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	69	158
Charges	(21)	(24)
Revenu tiré des prêts de titres	48	134
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	15,2

Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	12 824
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB \$ CA)	10 073
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	10 724
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	23 686
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	5 459
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	56 425
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	15 903
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	28 671
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	7 143
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	4 138
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	9 697
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	7 670
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	10 026
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	18 510
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	24 325
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	6 841
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 110
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	20 233
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	17 100

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	10 488
FNB de produits de base généraux CI Auspice (couvert en \$ CA) (parts ordinaires)	2 580
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB \$ CA)	15 067
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	4 761
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	45 408
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	6 303
FNB secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	6 246
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	5 717
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1 995
FNB d'obligations de qualité supérieure CI (parts ordinaires)	20 992
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	8 075
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	9 907
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	9 068
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	9 714
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	17 003
FNB Indice 500 É.-U. CI	17 586
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	6 422
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	11 875
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	10 437
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	11 494

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	14,2
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	7,2
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	6,1
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	6,1
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	5,9
FNB FTSE Japon Franklin	5,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	4,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4,3
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4,0
Autres actifs (passifs) nets	3,8
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	3,2
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,7
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	2,5
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,5
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2,4
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	2,4
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,9
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,8
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	1,7
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	1,6
FNB JPMorgan Active Value	1,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,4
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1,4
iShares Core MSCI Europe ETF	1,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1,0
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	12,9
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	7,3
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	6,1
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	5,7
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	5,6
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	4,8
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	4,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4,1
FNB FTSE Japon Franklin	4,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,8
Autres actifs (passifs) nets	3,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,1
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,0
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,5
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	2,5
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	2,4
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	2,4
iShares Core MSCI Europe ETF	2,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	1,9
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI (parts ordinaires)	1,9
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1,7
FNB JPMorgan Active Value	1,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,4
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,3
FNB BMO Equal Weight Banks Index	1,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,8
Contrat(s) de change à terme	0,0
Option(s)	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 38 386 000 \$ (37 961 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	54 978	3 957	58 935	14,8
Yen japonais	-	(3 894)	(3 894)	(1,0)
Total	54 978	63	55 041	13,8

au 31 mars 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	58 983	(7 816)	51 167	13,0
Total	58 983	(7 816)	51 167	13,0

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 5 504 000 \$ (5 117 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	383 861	-	-	383 861
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	63	-	63
Total	-	63	-	383 924

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	379 605	-	-	379 605
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	36	-	36
Option(s)	19	-	-	19
Total	379 624	36	-	379 660

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	239 115	224 680
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	10 142	8 194
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	39	56
Swaps, options sur swaps et options	-	11
Montant à recevoir pour la vente de placements	544	1 216
Montant à recevoir pour la souscription de parts	467	798
Dividendes à recevoir	24	13
Intérêts à recevoir	33	26
Rabais sur frais à recevoir	75	76
Autres comptes débiteurs	-	-
	250 439	235 070
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	28
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	17	8
Frais d'administration à payer	2	1
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	1 075	1 547
Montant à payer pour le rachat de parts	503	281
Autres comptes créditeurs	-	-
	1 597	1 865
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	248 842	233 205

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
Série A	156 181	147 657	11,84	11,95	13 196 347	12 355 846
Série AT5	39	39	9,34	9,67	4 108	4 008
Série E	4 053	4 576	11,86	11,97	341 773	382 263
Série ET5	1	1	9,31	9,64	135	132
Série F	64 500	56 229	11,87	11,92	5 432 372	4 716 119
Série FT5	1	1	9,35	9,63	140	137
Série I	9 510	10 075	11,88	11,89	800 350	847 385
Série O	6 748	6 848	11,88	11,90	568 022	575 584
Série OT5	1	1	9,37	9,62	142	139
Série P	7 807	7 777	11,88	11,90	656 859	653 422
Série PT5	1	1	9,37	9,62	142	139

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

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

	2023	2022
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 354	1 226
Intérêts aux fins des distributions	418	283
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(20)	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	2 824	(128)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(6 075)	(20 343)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(499)	(18 962)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	37	33
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	23
Rabais sur frais	456	354
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	492	410
Total des revenus	(7)	(18 552)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	1 348	983
Frais d'administration (note 5)	177	125
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	185	222
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	75	73
Taxe de vente harmonisée	158	111
Total des charges	1 944	1 515
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 951)	(20 067)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(1 572)	(13 529)	(0,12)	(1,36)	12 851 772
Série AT5	-	(42)	(0,09)	(1,16)	4 052	35 752
Série E	(35)	(581)	(0,10)	(1,37)	356 287	420 057
Série ET5	-	-	(0,09)	(1,18)	133	126
Série F	(325)	(3 957)	(0,06)	(1,31)	5 172 319	3 018 159
Série FT5	-	-	(0,04)	(1,12)	138	129
Série I	(1)	(123)	-	(0,58)	826 521	212 914
Série O	(3)	(720)	-	(1,31)	582 471	552 356
Série OT5	-	-	(0,01)	(1,10)	140	130
Série P	(15)	(1 115)	(0,02)	(1,76)	644 478	632 465
Série PT5	-	-	(0,01)	(1,10)	140	130

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	147 657	113 515	39	371	4 576	5 214	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 572)	(13 529)	-	(42)	(35)	(581)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(1)	-	(1)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(10)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(1)	(10)	(1)	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	26 037	25 213	-	-	52	21	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	1	10	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(15 941)	(7 547)	-	-	(539)	(64)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	10 096	17 666	1	10	(487)	(43)	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 524	4 137	-	(42)	(523)	(624)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	156 181	117 652	39	329	4 053	4 590	1	1

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	56 229	32 321	1	1	10 075	163	6 848	6 634
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(325)	(3 957)	-	-	(1)	(123)	(3)	(720)
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	15 981	10 645	-	-	54	5 840	302	353
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 385)	(2 415)	-	-	(618)	(794)	(399)	(242)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	8 596	8 230	-	-	(564)	5 046	(97)	111
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 271	4 273	-	-	(565)	4 923	(100)	(609)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	64 500	36 594	1	1	9 510	5 086	6 748	6 025

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

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) 30 septembre (en milliers de dollars)

	Série OT5		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	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	7 777	8 005	1	1	233 205	166 227
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(15)	(1 115)	-	-	(1 951)	(20 067)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(2)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(10)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(2)	(10)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	829	6 788	-	-	43 255	48 860
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	1	10
Rachat de parts rachetables	-	-	(784)	(3 416)	-	-	(25 666)	(14 478)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	45	3 372	-	-	17 590	34 392
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	30	2 257	-	-	15 637	14 315
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	7 807	10 262	1	1	248 842	180 542

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

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

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 951)	(20 067)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 824)	128
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	6 075	20 343
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	185	222
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	65 031	47 368
Achat de placements et de dérivés	(82 702)	(72 350)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(11)	(17)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(7)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	9	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	1	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	5
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(16 193)	(24 368)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	38 253	44 089
Montant versé au rachat de parts rachetables	(20 110)	(10 265)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	18 141	33 824
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 948	9 456
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 194	3 554
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	10 142	13 010
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	411	283
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 268	1 139
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	376 763	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI (parts ordinaires)	3 753 187	3 605 622	
	124 900	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	2 351 136	2 348 120	
	325 894	Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	6 557 812	6 658 014	
	1 178 073	FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	20 990 322	19 803 407	
	553 203	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	4 002 083	4 525 201	
	1 684 656	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	17 217 443	15 953 692	
	460 466	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4 459 762	4 346 799	
	480 550	FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	9 749 567	9 399 558	
USD	178 367	Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	4 478 870	4 456 501	
	283 700	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	3 527 083	3 452 629	
	342 888	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	8 694 446	7 968 717	
	321 730	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	6 104 952	6 373 472	
	318 295	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	7 800 209	8 326 597	
	628 227	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	16 339 807	15 454 384	
	999 800	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	20 411 895	20 385 922	
	123 100	FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	2 190 010	1 937 594	
	387 409	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	13 134 981	13 264 884	
	655 374	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	17 602 519	16 875 881	
	352 407	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	13 159 361	14 364 109	
USD	506 186	FNB FTSE Japon Franklin	18 013 858	18 185 093	
	281 500	FNB Horizons Equal Weight Banks Index	5 434 035	5 303 460	
USD	52 021	iShares Core MSCI Europe ETF	3 556 707	3 508 853	
	678 213	iShares S&P/TSX 60 Index ETF	19 931 600	20 142 926	
USD	74 522	FNB JPMorgan Active Value	5 125 896	5 188 512	
USD	98 405	SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	2 825 160	2 650 450	
USD	131 175	FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	4 933 662	4 634 161	
	-		242 346 363	239 114 558	96,1
		Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	242 346 363	239 114 558	96,1
		Commissions et autres coûts de transaction	(300 848)		
		Total du portefeuille de placements avant les dérivés	242 045 515	239 114 558	96,1
		Contrat(s) de change à terme		38 702	0,0
		Total du portefeuille de placements	242 045 515	239 153 260	96,1
		Autres actifs (passifs) nets		9 688 730	3,9
		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		248 841 990	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Contract(s) contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 décembre 2023	USD	1 806 235	JPY	262 300 000	0,01	38 702
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								38 702

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	39	-	-	39
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	39	-	-	39
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	56	(7)	-	49
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	56	(7)	-	49
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(28)	7	-	(21)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(28)	7	-	(21)

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice 1000 É.-U. CI	82 580	20 386	24,7
FNB alpha Marchés émergents CI	89 464	19 803	22,1
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	104 367	9 400	9,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	205 295	16 876	8,2
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI	24 200	1 938	8,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	209 894	14 364	6,8
Fonds de lingots d'or CI	81 870	4 456	5,4
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	75 742	3 606	4,8
Fonds de produits de base généraux CI Auspice	145 257	6 658	4,6
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	137 689	5 303	3,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	94 116	3 453	3,7
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	270 159	8 327	3,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	591 221	13 265	2,2
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	759 485	15 954	2,1
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	311 501	6 373	2,0
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	540 768	7 969	1,5
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 303 147	15 454	1,2
FNB FTSE Japon Franklin	2 026 210	18 185	0,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	510 009	4 525	0,9
FNB JPMorgan Active Value	791 972	5 189	0,7
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	565 472	2 348	0,4
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 067 307	4 347	0,4
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	10 944 450	20 143	0,2
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2 656 672	4 634	0,2
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 469 857	2 650	0,1
iShares Core MSCI Europe ETF	5 375 820	3 509	0,1

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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) (%)
FNB alpha Marchés émergents CI	84 716	17 654	20,8
FNB Indice 500 É.-U. CI	125 345	17 589	14,0
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	87 477	10 461	12,0
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	26 437	2 284	8,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	173 939	13 007	7,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	5 388	5,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	197 470	10 773	5,5
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	6 198	5,3
Fonds de lingots d'or CI	70 540	3 247	4,6
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	9 949	3,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	11 732	2,2
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	15 657	2,2
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	7 652	1,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	2 470	1,6
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	9 237	1,5
FNB JPMorgan Active Value	446 855	5 025	1,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	14 984	1,0
FNB FTSE Japon Franklin	1 362 079	12 602	0,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	4 185	0,8
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	4 635	0,3
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	1 157	0,2
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	11 015 224	18 589	0,2
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	3 379 362	5 428	0,2
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 299 191	2 824	0,1
iShares Core MSCI Europe ETF	5 739 072	6 295	0,1
FNB BMO Equal Weight Banks Index	3 801 476	3 383	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	46 790 631	2 277	-

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	183	219
Paielements indirects†	68	62

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12 355 846	9 226 414	4 008	35 307	382 263	423 636	132	124
Parts rachetables émises	2 166 127	2 206 017	-	28	4 429	2 057	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	100	1 020	-	-	3	4
Parts rachetables rachetées	(1 325 626)	(648 805)	-	(43)	(44 919)	(5 215)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 196 347	10 783 626	4 108	36 312	341 773	420 478	135	128

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 716 119	2 623 065	137	127	847 385	13 202	575 584	538 314
Parts rachetables émises	1 328 152	916 373	-	-	4 548	516 051	25 305	29 623
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	3	4	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(611 899)	(208 817)	-	-	(51 583)	(68 246)	(32 867)	(21 210)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	5 432 372	3 330 621	140	131	800 350	461 007	568 022	546 727

	Série OT5		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	139	127	653 422	649 461	139	127
Parts rachetables émises	-	-	68 844	584 635	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3	4	-	-	3	4
Parts rachetables rachetées	-	-	(65 407)	(302 788)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	142	131	656 859	931 308	142	131

†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.

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,500	0,150
Série AT5	1,500	0,150
Série E	1,500	0,150
Série ET5	1,500	0,150
Série F	0,500	0,150
Série FT5	0,500	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	24 531	-
Garanties (hors trésorerie)	25 758	-

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

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

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	53	39
Charges	(16)	(6)
Revenu tiré des prêts de titres	37	33
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	15,4

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	3 606
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB \$ CA)	2 348
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	6 658
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	19 803
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	4 525
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	15 954
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4 347
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	9 400
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	4 456
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	3 453
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	7 969
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	6 373
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	8 327
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	15 454
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	20 386
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	1 938
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	13 265
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	16 876
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	14 364

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	2 612
FNB de produits de base généraux CI Auspice (couvert en \$ CA) (parts ordinaires)	1 583
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB \$ CA)	11 018
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	3 492
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	11 806
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4 845
FNB secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	4 551
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	3 095
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1 471
FNB d'obligations de qualité supérieure CI (parts ordinaires)	5 367
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	7 382
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	6 792
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	7 150
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	12 612
FNB Indice 500 É.-U. CI	12 534
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	1 625
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	8 642
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	7 744
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	8 548

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	8,2
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	8,1
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	8,0
FNB FTSE Japon Franklin	7,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6,8
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	6,4
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	6,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,3
Autres actifs (passifs) nets	3,9
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	3,8
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	3,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	3,2
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,7
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	2,6
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	2,1
FNB JPMorgan Active Value	2,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,8
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,8
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	1,7
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	1,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1,4
iShares Core MSCI Europe ETF	1,4
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	1,1
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	0,9
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	0,8
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	7,9
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	7,5
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	7,5
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	6,7
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	6,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,6
FNB FTSE Japon Franklin	5,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4,6
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	4,5
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	4,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,0
Autres actifs (passifs) nets	3,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	3,3
iShares Core MSCI Europe ETF	2,7
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,7
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2,3
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	2,3
FNB JPMorgan Active Value	2,2
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	2,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1,8
FNB BMO Equal Weight Banks Index	1,5
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,4
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	1,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1,1
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI (parts ordinaires)	1,0
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	1,0
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	0,5
Contrat(s) de change à terme	0,0
Option(s)	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 23 911 000 \$ (22 468 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	38 858	2 450	41 308	16,6
Yen japonais	-	(2 412)	(2 412)	(1,0)
Total	38 858	38	38 896	15,6

au 31 mars 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	37 720	(5 720)	32 000	13,7
Total	37 720	(5 720)	32 000	13,7

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 3 890 000\$ (3 200 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	239 115	-	-	239 115
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	39	-	39
Total	239 115	39	-	239 154

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	224 680	-	-	224 680
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	28	-	28
Option(s)	11	-	-	11
Total	224 691	28	-	224 719

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	158 976	159 472
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	6 279	5 957
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	26	43
Swaps, options sur swaps et options	-	8
Montant à recevoir pour la vente de placements	309	507
Montant à recevoir pour la souscription de parts	47	227
Dividendes à recevoir	8	4
Intérêts à recevoir	22	19
Rabais sur frais à recevoir	55	58
Autres comptes débiteurs	-	-
	165 722	166 295
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	27
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	11	6
Frais d'administration à payer	1	1
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	178	724
Montant à payer pour le rachat de parts	294	441
Autres comptes créditeurs	-	-
	484	1 199
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	165 238	165 096

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
	Série A	109 914	109 372	10,44	10,71	10 526 417
Série AT5	224	236	8,22	8,65	27 266	27 262
Série E	5 941	6 280	10,44	10,71	568 932	586 514
Série ET5	1	1	8,23	8,65	132	128
Série F	33 454	32 213	10,50	10,71	3 184 961	3 007 011
Série FT5	87	91	8,30	8,68	10 474	10 471
Série I	3 101	3 500	10,55	10,72	293 894	326 369
Série O	8 111	8 241	10,53	10,72	769 976	769 027
Série OT5	1	1	8,34	8,69	138	135
Série P	4 403	5 160	10,54	10,72	417 948	481 422
Série PT5	1	1	8,34	8,69	138	135

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	1 601	1 085
Intérêts aux fins des distributions	629	848
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(14)	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	974	(1 752)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(6 105)	(12 197)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(2 915)	(12 016)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	9	63
Profit (perte) de change sur la trésorerie	2	5
Rabais sur frais	344	316
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	355	384
Total des revenus	(2 560)	(11 632)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	926	800
Frais d'administration (note 5)	122	107
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	116	209
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	54	79
Taxe de vente harmonisée	110	94
Total des charges	1 329	1 290
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 889)	(12 922)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(2 793)	(8 574)	(0,27)	(0,95)	10 392 711
Série AT5	(6)	(15)	(0,21)	(0,68)	27 264	23 104
Série E	(146)	(503)	(0,26)	(0,95)	566 275	525 715
Série ET5	-	-	(0,22)	(0,82)	130	122
Série F	(675)	(2 493)	(0,21)	(0,93)	3 141 607	2 700 581
Série FT5	(2)	(16)	(0,17)	(0,92)	10 472	17 539
Série I	(51)	(145)	(0,16)	(0,75)	312 543	192 629
Série O	(142)	(683)	(0,18)	(0,88)	766 242	777 297
Série OT5	-	-	(0,15)	(0,74)	136	126
Série P	(74)	(493)	(0,17)	(0,99)	436 436	500 811
Série PT5	-	-	(0,15)	(0,74)	136	126

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	109 372	95 658	236	1 628	6 015	1	1	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 793)	(8 574)	(6)	(15)	(146)	(503)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(6)	-	(3)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(6)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(6)	(6)	(3)	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	16 152	16 690	-	250	236	95	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(12 817)	(7 810)	-	-	(426)	(422)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	3 335	8 880	-	250	(190)	(327)	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	542	306	(12)	229	(339)	(830)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	109 914	95 964	224	230 594	5 185	1	1	

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	32 213	31 752	91	216 350	1 147	8 241	8 698	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(675)	(2 493)	(2)	(16)	(51)	(145)	(142)	(683)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(2)	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(4)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(2)	(4)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	7 684	4 828	-	-	35	3 406	219	458
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(5 768)	(6 044)	-	(109)	(383)	(1 348)	(207)	(372)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1 916	(1 216)	-	(109)	(348)	2 058	12	86
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 241	(3 709)	(4)	(129)	(399)	1 913	(130)	(597)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	33 454	28 043	87	87 310	3 060	8 111	8 101	

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

États financiers (non audité)

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) 30 septembre (en milliers de dollars)

	Série OT5		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	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	5 160	6 641	1	1	165 096	150 131
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(74)	(493)	-	-	(3 889)	(12 922)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(11)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(10)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(11)	(10)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	113	715	-	-	24 439	26 442
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(796)	(1 957)	-	-	(20 397)	(18 062)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	(683)	(1 242)	-	-	4 042	8 380
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(757)	(1 735)	-	-	142	(4 552)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	4 403	4 906	1	1	165 238	145 579

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

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

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 889)	(12 922)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(974)	1 752
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	6 105	12 197
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	116	209
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	34 533	48 222
Achat de placements et de dérivés	(39 637)	(52 062)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(4)	(5)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(4)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	6	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	1	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	8
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(3 746)	(2 602)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(11)	(10)
Produit de l'émission de parts rachetables	22 736	25 152
Montant versé au rachat de parts rachetables	(18 659)	(16 445)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	4 066	8 697
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	2	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	320	6 095
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 957	3 617
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	6 279	9 713
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	626	848
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 544	1 010
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	781 265	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	7 786 017	7 476 706	
	367 100	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	6 914 919	6 901 480	
	204 828	Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4 126 136	4 184 636	
	399 864	FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	7 231 209	6 721 714	
	189 009	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1 315 611	1 546 094	
	3 450 932	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	36 145 018	32 680 325	
	1 047 202	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	10 182 068	9 885 587	
	909 150	FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	18 239 749	17 782 974	
USD	111 982	Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	2 814 603	2 797 871	
	97 100	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1 209 858	1 181 707	
	116 945	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2 939 590	2 717 802	
	109 259	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	2 042 635	2 164 421	
	108 626	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2 687 285	2 841 656	
	213 677	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	5 560 965	5 256 454	
	342 100	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	6 982 463	6 975 419	
	272 026	FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	5 070 134	4 281 689	
	131 868	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4 467 591	4 515 160	
	221 730	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5 980 740	5 709 548	
	120 091	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4 423 398	4 894 909	
USD	170 953	FNB FTSE Japon Franklin	6 131 680	6 141 608	
	95 900	FNB Horizons Equal Weight Banks Index	1 851 746	1 806 756	
USD	26 207	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	3 724 245	3 156 979	
USD	17 954	iShares Core MSCI Europe ETF	1 235 292	1 211 010	
	230 538	iShares S&P/TSX 60 Index ETF	6 744 810	6 846 979	
USD	25 493	FNB JPMorgan Active Value	1 757 851	1 774 922	
USD	220 721	SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	6 738 413	5 944 921	
USD	44 625	FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1 674 740	1 576 516	
	-		165 978 766	158 975 843	96,2
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			165 978 766	158 975 843	96,2
Commissions et autres coûts de transaction			(254 143)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			165 724 623	158 975 843	96,2
Contrat(s) de change à terme				26 113	0,0
Total du portefeuille de placements			165 724 623	159 001 956	96,2
Autres actifs (passifs) nets				6 235 791	3,8
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				165 237 747	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Contract(s) contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 décembre 2023	USD	1 218 696	JPY	176 978 000	0,01	26 113
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								26 113

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	43	(12)	-	31
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	43	(12)	-	31
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(27)	12	-	(15)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(27)	12	-	(15)

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI	24 200	4 282	17,7
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	104 367	17 783	17,0
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	75 742	7 477	9,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI	82 580	6 975	8,4
FNB alpha Marchés émergents CI	89 464	6 722	7,5
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	759 485	32 680	4,3
Fonds de lingots d'or CI	81 870	2 798	3,4
Fonds de produits de base généraux CI Auspice	145 257	4 185	2,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	205 295	5 709	2,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	209 894	4 895	2,3
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	137 689	1 807	1,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	94 116	1 182	1,3
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	565 472	6 901	1,2
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	270 159	2 842	1,1
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 067 307	9 886	0,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	591 221	4 515	0,8
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	311 501	2 164	0,7
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	540 768	2 718	0,5
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 303 147	5 256	0,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	510 009	1 546	0,3
FNB FTSE Japon Franklin	2 026 210	6 142	0,3
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 469 857	5 945	0,2
FNB JPMorgan Active Value	791 972	1 775	0,2
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	10 944 450	6 847	0,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2 656 672	1 576	0,1
iShares Core MSCI Europe ETF	5 375 820	1 211	-
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	52 401 489	3 157	-

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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) (%)
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	87 477	16 443	18,8
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	26 437	4 572	17,3
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	10 844	11,4
FNB alpha Marchés émergents CI	84 716	6 392	7,6
FNB Indice 500 É.-U. CI	125 345	6 390	5,1
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	31 444	4,3
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	3 661	3,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	173 939	4 686	2,7
Fonds de lingots d'or CI	70 540	1 841	2,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	197 470	3 851	2,0
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	7 007	1,2
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	3 485	1,1
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	11 532	0,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	4 326	0,8
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	2 823	0,7
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	3 394	0,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	855	0,6
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	5 544	0,4
FNB JPMorgan Active Value	446 855	1 770	0,4
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 299 191	5 703	0,3
FNB FTSE Japon Franklin	1 362 079	4 553	0,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	1 509	0,3
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	11 015 224	6 855	0,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	3 379 362	1 929	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	46 790 631	4 601	-
iShares Core MSCI Europe ETF	5 739 072	2 290	-
FNB BMO Equal Weight Banks Index	3 801 476	1 172	-

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	115	207
Paielements indirects†	43	58

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	10 213 619	8 600 970	27 262	120	586 514	540 922	128	120
Parts rachetables émises	1 513 760	1 578 771	-	27 135	22 117	9 225	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	4	3	-	-	4	3
Parts rachetables rachetées	(1 200 962)	(736 419)	-	-	(39 699)	(39 921)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	10 526 417	9 443 322	27 266	27 258	568 932	510 226	132	123

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 007 011	2 852 967	10 471	22 692	326 369	102 937	769 027	781 299
Parts rachetables émises	717 158	457 379	-	-	3 266	323 855	20 359	43 912
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	3	4	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(539 208)	(567 872)	-	(12 519)	(35 741)	(128 816)	(19 410)	(35 158)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 184 961	2 742 474	10 474	10 177	293 894	297 976	769 976	790 053

	Série OT5		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	135	124	481 422	596 332	135	124
Parts rachetables émises	-	-	10 509	67 841	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3	4	-	-	3	4
Parts rachetables rachetées	-	-	(73 983)	(185 800)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	138	128	417 948	478 373	138	128

†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.

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,450	0,150
Série AT5	1,450	0,150
Série E	1,450	0,150
Série ET5	1,450	0,150
Série F	0,450	0,150
Série FT5	0,450	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	8 623	-
Garanties (hors trésorerie)	9 054	-

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

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

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	13	74
Charges	(4)	(11)
Revenu tiré des prêts de titres	9	63
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	14,9

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	7 477
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB \$ CA)	6 901
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	4 185
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	6 722
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1 546
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	32 680
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	9 886
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	17 783
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	2 798
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1 182
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2 718
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	2 164
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2 842
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	5 256
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	6 975
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	4 282
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4 515
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5 709
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	4 895

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	6 920
FNB de produits de base généraux CI Auspice (couvert en \$ CA) (parts ordinaires)	1 040
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB \$ CA)	4 535
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	1 426
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	29 612
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	4 176
FNB secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	1 873
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	2 392
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	589
FNB d'obligations de qualité supérieure CI (parts ordinaires)	13 691
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	5 352
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2 937
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	2 705
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2 819
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	5 130
FNB Indice 500 É.-U. CI	5 560
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	4 035
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3 566
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3 119
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3 591

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	19,8
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	10,8
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	6,0
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	4,5
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	4,2
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	4,2
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	4,1
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	4,1
Autres actifs (passifs) nets	3,8
FNB FTSE Japon Franklin	3,7
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	3,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,5
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	3,2
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	3,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,7
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	2,6
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,5
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	1,9
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,7
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1,7
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,3
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	1,1
FNB JPMorgan Active Value	1,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1,0
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,9
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,7
iShares Core MSCI Europe ETF	0,7
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	19,0
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	10,0
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	7,0
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	6,6
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	4,2
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	4,1
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	3,9
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	3,9
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	3,4
Autres actifs (passifs) nets	3,4
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	3,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,8
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	2,8
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI (parts ordinaires)	2,8
FNB FTSE Japon Franklin	2,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,6
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,3
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,2
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	2,1
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	2,1
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,7
iShares Core MSCI Europe ETF	1,4
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	1,2
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,1
FNB JPMorgan Active Value	1,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,9
FNB BMO Equal Weight Banks Index	0,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	0,5
Contrat(s) de change à terme	0,0
Option(s)	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 15 898 000 \$ (15 947 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023~

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	22 837	1 653	24 490	14,8
Yen japonais	-	(1 627)	(1 627)	(1,0)
Total	22 837	26	22 863	13,8

au 31 mars 2023~

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	22 722	(2 788)	19 934	12,1
Total	22 722	(2 788)	19 934	12,1

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 286 000 \$ (1 993 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	158 976	-	-	158 976
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	26	-	26
Total	158 976	26	-	159 002

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	159 472	-	-	159 472
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	16	-	16
Option(s)	8	-	-	8
Total	159 480	16	-	159 496

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	7 830	6 935
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	272	279
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	2
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	47	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	2	8
Dividendes à recevoir	11	7
Intérêts à recevoir	1	1
Rabais sur frais à recevoir	1	1
Autres comptes débiteurs	-	-
	8 164	7 233
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	2
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	1	-
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	17
Montant à payer pour le rachat de parts	19	-
Autres comptes créditeurs	-	-
	20	19
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 144	7 214

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
	Série A	5 409	5 196	8,85	9,07	611 024
Série AT5	9	9	7,91	8,31	1 126	1 099
Série F	2 442	1 719	8,87	9,04	275 245	190 110
Série FT5	32	33	7,94	8,29	4 032	4 004
Série I	121	125	8,88	9,02	13 695	13 816
Série P	122	123	8,88	9,02	13 753	13 634
Série PT5	9	9	7,94	8,27	1 164	1 136

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	53	37
Intérêts aux fins des distributions	38	12
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(13)	(181)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(220)	(460)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(142)	(592)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	-
Rabais sur frais	7	4
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	11	4
Total des revenus	(131)	(588)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	45	32
Frais d'administration (note 5)	5	4
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	5	8
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	1	2
Taxe de vente harmonisée	6	4
Total des charges	63	51
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(194)	(639)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(139)	(398)	(0,23)	(0,96)	592 701
Série AT5	-	(1)	(0,20)	(0,98)	1 111	1 052
Série F	(50)	(209)	(0,24)	(0,97)	211 280	214 605
Série FT5	(1)	(4)	(0,15)	(0,93)	4 017	3 815
Série I	(2)	(21)	(0,14)	(0,90)	13 782	24 715
Série P	(2)	(5)	(0,15)	(1,23)	13 626	3 915
Série PT5	-	(1)	(0,13)	(0,91)	1 148	1 069

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série F		Série FT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 196	3 111	9	9	1 719	2 085	33	35
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(139)	(398)	-	(1)	(50)	(209)	(1)	(4)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(1)	(1)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	923	1 628	-	-	897	245	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	1	-
Rachat de parts rachetables	(571)	(396)	-	-	(124)	(292)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	352	1 232	-	-	773	(47)	1	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	213	834	-	(1)	723	(256)	(1)	(5)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	5 409	3 945	9	8	2 442	1 829	32	30

	Série I		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	125	129	123	14	9	10	7 214	5 393
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2)	(21)	(2)	(5)	-	(1)	(194)	(639)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(1)	(1)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	107	2	108	-	-	1 822	2 088
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	1	-
Rachat de parts rachetables	(2)	(2)	(1)	-	-	-	(698)	(690)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(2)	105	1	108	-	-	1 125	1 398
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(4)	84	(1)	103	-	(1)	930	758
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	121	213	122	117	9	9	8 144	6 151

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(194)	(639)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	13	181
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	220	460
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	5	8
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 025	1 483
Achat de placements et de dérivés	(2 220)	(2 760)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(5)	(1)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(1 156)	(1 268)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 879	2 190
Montant versé au rachat de parts rachetables	(729)	(690)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	1 149	1 499
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(7)	231
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	279	142
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	272	373
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	38	12
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	47	34
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	19 716	FINB BMO ESG obligations de sociétés	534 142	499 998	
	11 666	FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	382 969	357 680	
	41 979	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	420 269	401 739	
	38 215	Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	746 432	712 710	
	40 267	Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	821 823	798 696	
	13 700	Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	267 014	257 081	
	15 805	FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	425 279	450 917	
USD	1 447	First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	177 091	184 530	
USD	3 958	Invesco Global Water ETF	192 615	181 600	
	63 412	iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	1 151 991	1 069 125	
	33 859	iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	840 758	806 183	
	20 293	iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	439 050	450 809	
USD	3 570	FNB iShares ESG Aware MSCI USA	438 769	455 365	
USD	2 378	iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	161 691	138 170	
USD	2 615	iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	256 233	267 843	
USD	6 834	KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	292 707	231 129	
	27 486	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	609 030	566 761	
	-		8 157 863	7 830 336	96,1
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			8 157 863	7 830 336	96,1
Commissions et autres coûts de transaction			(11 981)		
Total du portefeuille de placements			8 145 882	7 830 336	96,1
Autres actifs (passifs) nets				314 135	3,9
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				8 144 471	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	2	(1)	-	1
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	2	(1)	-	1
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(2)	1	-	(1)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(2)	1	-	(1)

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 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'infrastructures durables mondiales CI	4 079	257	6,3
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	15 234	799	5,2
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	44 032	713	1,6
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	116 127	1 069	0,9
FINB BMO ESG obligations de sociétés	55 158	500	0,9
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	72 732	451	0,6
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	125 782	567	0,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	75 742	402	0,5
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	83 916	358	0,4
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	166 425	451	0,3
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	104 843	231	0,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	63 914	138	0,2
Invesco Global Water ETF	337 230	182	0,1
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	2 634 814	806	-
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	1 383 658	185	-
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	16 441 615	455	-
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	1 464 687	268	-

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'infrastructures durables mondiales CI	3 783	236	6,2
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	14 975	726	4,9
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	43 141	631	1,5
FINB BMO ESG obligations de sociétés	56 806	449	0,8
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	132 682	967	0,7
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	70 840	387	0,6
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	108 016	515	0,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	364	0,4
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	88 627	314	0,4
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	207 911	704	0,3
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	173 122	391	0,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	61 511	115	0,2
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	129 393	195	0,2
Invesco Global Water ETF	378 064	156	-
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	976 346	160	-
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	4 279 302	374	-
Vanguard ESG US Stock ETF	8 285 680	251	-

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	5	8
Paielements indirects†	2	2

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série F		Série FT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	572 709	330 628	1 099	1 038	190 110	222 334	4 004	3 801
Parts rachetables émises	101 490	183 506	-	-	98 816	28 270	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	27	31	-	-	28	31
Parts rachetables rachetées	(63 175)	(44 282)	-	-	(13 681)	(33 239)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	611 024	469 852	1 126	1 069	275 245	217 365	4 032	3 832

	Série I		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13 816	13 775	13 634	1 458	1 136	1 056
Parts rachetables émises	-	11 679	214	12 492	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	28	31
Parts rachetables rachetées	(121)	(180)	(95)	(18)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	13 695	25 274	13 753	13 932	1 164	1 087

†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.

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,500	0,150
Série AT5	1,500	0,150
Série F	0,500	0,150
Série FT5	0,500	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	1 499	-
Garanties (hors trésorerie)	1 574	-

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

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

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	402
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	713
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	799
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	257
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	451

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	198
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	471
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	466
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	418

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	13,1
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	9,9
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	9,8
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	8,8
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	7,0
FINB BMO ESG obligations de sociétés	6,1
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	5,6
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	5,5
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	5,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	4,9
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	4,4
Autres actifs (passifs) nets	3,9
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	3,3
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	3,2
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	2,8
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	2,3
Invesco Global Water ETF	2,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	1,7
Total	100,0

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	13,4
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	10,1
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	9,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	8,7
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	7,1
FINB BMO ESG obligations de sociétés	6,2
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	5,4
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	5,4
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	5,2
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	5,1
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	4,3
Autres actifs (passifs) nets	3,9
Vanguard ESG US Stock ETF	3,5
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	3,3
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	2,7
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	2,2
Invesco Global Water ETF	2,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	1,6
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 783 000 \$ (693 000 \$ au 31 mars 2023). 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 résumant l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 septembre 2023~

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	1 499	-	1 499	18,4
Total	1 499	-	1 499	18,4

au 31 mars 2023~

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	1 279	(136)	1 143	15,8
Total	1 279	(136)	1 143	15,8

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 150 000 \$ (114 000 \$ au 31 mars 2023). 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 résumant les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	7 830	-	-	7 830
Total	7 830	-	-	7 830

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	6 935	-	-	6 935
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	-	-	-
Total	6 935	-	-	6 935

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	4 934	4 135
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	190	173
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	1
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	6
Montant à recevoir pour la souscription de parts	4	2
Dividendes à recevoir	7	3
Intérêts à recevoir	1	1
Rabais sur frais à recevoir	1	1
Autres comptes débiteurs	-	-
	5 137	4 322
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	2
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	3	19
Montant à payer pour le rachat de parts	23	-
Autres comptes créditeurs	-	-
	26	21
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 111	4 301

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
	Série A	3 783	3 326	8,85	9,02	427 689
Série AT5	9	9	7,90	8,25	1 135	1 108
Série F	1 110	896	8,93	9,05	124 349	99 013
Série FT5	50	30	7,98	8,29	6 279	3 599
Série I	20	20	8,97	9,06	2 165	2 169
Série P	130	11	8,96	9,06	14 495	1 180
Série PT5	9	9	8,01	8,30	1 161	1 133

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	38	27
Intérêts aux fins des distributions	15	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4)	(84)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(113)	(377)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(64)	(434)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(2)
Rabais sur frais	5	2
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	7	-
Total des revenus	(57)	(434)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	30	20
Frais d'administration (note 5)	3	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	6
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	1	1
Taxe de vente harmonisée	4	2
Total des charges	41	32
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(98)	(466)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(75)	(309)	(0,19)	(1,15)	399 462
Série AT5	-	(1)	(0,15)	(1,12)	1 120	1 060
Série F	(17)	(149)	(0,15)	(1,41)	111 957	104 750
Série FT5	(1)	(3)	(0,27)	(1,07)	3 872	3 547
Série I	-	(2)	(0,09)	(1,38)	2 168	1 341
Série P	(5)	(1)	(0,78)	(1,16)	5 379	1 261
Série PT5	-	(1)	(0,09)	(1,04)	1 146	1 078

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série F		Série FT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 326	2 157	9	9	896	351	30	32
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(75)	(309)	-	(1)	(17)	(149)	(1)	(3)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(1)	(1)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	660	689	-	-	319	1 913	22	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(128)	(141)	-	-	(88)	(41)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	532	548	-	-	231	1 872	22	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	457	239	-	(1)	214	1 723	20	(4)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 783	2 396	9	8	1 110	2 074	50	28

	Série I		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	20	10	11	13	9	10	4 301	2 582
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(2)	(5)	(1)	-	(1)	(98)	(466)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(1)	(1)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	10	124	-	-	-	1 125	2 612
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	(2)	-	-	(216)	(184)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	10	124	(2)	-	-	909	2 428
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	8	119	(3)	-	(1)	810	1 961
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	20	18	130	10	9	9	5 111	4 543

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(98)	(466)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	4	84
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	113	377
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	6
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	474	724
Achat de placements et de dérivés	(1 405)	(3 027)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(3)	(2)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	(1)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(913)	(2 305)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 120	2 706
Montant versé au rachat de parts rachetables	(189)	(175)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	930	2 530
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	17	225
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	173	85
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	190	310
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	15	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	34	24
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	7 121	FINB BMO ESG obligations de sociétés	189 942	180 589	
	9 620	FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	314 477	294 949	
	15 217	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	150 957	145 627	
	31 752	Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	610 393	592 175	
	14 578	Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	298 926	289 155	
	11 450	Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	224 273	214 859	
	13 274	FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	346 889	378 707	
USD	1 201	First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	145 569	153 159	
USD	3 227	Invesco Global Water ETF	152 093	148 060	
	22 865	iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	410 474	385 504	
	28 036	iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	696 409	667 536	
	16 695	iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	358 062	370 879	
USD	2 960	FNB iShares ESG Aware MSCI USA	363 209	377 558	
USD	1 967	iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	129 597	114 290	
USD	2 181	iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	210 643	223 390	
USD	5 694	KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	242 514	192 574	
	9 963	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	218 270	205 437	
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			5 062 697	4 934 448	96,5
Commissions et autres coûts de transaction			(6 635)		
Total du portefeuille de placements			5 056 062	4 934 448	96,5
Autres actifs (passifs) nets				176 914	3,5
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				5 111 362	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	1	-	-	1
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	1	-	-	1
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(2)	-	-	(2)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(2)	-	-	(2)

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 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'infrastructures durables mondiales CI	4 079	215	5,3
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	15 234	289	1,9
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	44 032	592	1,3
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	72 732	379	0,5
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	83 916	295	0,4
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	116 127	385	0,3
FINB BMO ESG obligations de sociétés	55 158	181	0,3
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	166 425	371	0,2
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	75 742	146	0,2
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	104 843	193	0,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	63 914	114	0,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	125 782	205	0,2
Invesco Global Water ETF	337 230	148	-
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	2 634 814	668	-
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	1 464 687	223	-
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	1 383 658	153	-
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	16 441 615	377	-

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'infrastructures durables mondiales CI	3 783	187	4,9
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	14 975	251	1,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	43 141	503	1,2
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	70 840	309	0,4
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	207 911	556	0,3
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	132 682	330	0,3
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	88 627	244	0,3
FINB BMO ESG obligations de sociétés	56 806	155	0,3
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	173 122	308	0,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	108 016	175	0,2
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	61 511	93	0,2
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	129 393	155	0,1
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	125	0,1
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	4 279 302	274	-
Vanguard ESG US Stock ETF	8 285 680	219	-
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	976 346	126	-
Invesco Global Water ETF	378 064	124	-

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	2	6
Paielements indirects†	1	2

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série F			Série FT5
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	368 934	229 654	1 108	1 046	99 013	37 550	3 599	3 533
Parts rachetables émises	72 893	77 910	-	-	34 999	219 025	2 652	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	27	32	-	-	28	32
Parts rachetables rachetées	(14 138)	(16 279)	-	-	(9 663)	(4 845)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	427 689	291 285	1 135	1 078	124 349	251 730	6 279	3 565

	Série I		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 169	1 034	1 180	1 364	1 133	1 064
Parts rachetables émises	-	1 125	13 362	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	28	32
Parts rachetables rachetées	(4)	(1)	(47)	(191)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 165	2 158	14 495	1 173	1 161	1 096

†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.

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,500	0,150
Série AT5	1,500	0,150
Série F	0,500	0,150
Série FT5	0,500	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	747	-
Garanties (hors trésorerie)	784	-

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

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

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	146
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	592
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	289
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	215
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	379

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	81
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	466
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	163
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	416

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	13,0
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	11,6
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	7,5
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	7,4
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	7,4
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	7,3
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	5,8
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	5,7
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	4,4
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	4,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	4,0
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	3,8
FINB BMO ESG obligations de sociétés	3,5
Autres actifs (passifs) nets	3,5
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	3,0
Invesco Global Water ETF	2,9
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	2,8
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	2,2
Total	100,0

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	12,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	11,7
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	7,7
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	7,2
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	7,2
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	6,4
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	5,8
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	5,7
Vanguard ESG US Stock ETF	5,1
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	4,3
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	4,1
Autres actifs (passifs) nets	4,0
FINB BMO ESG obligations de sociétés	3,6
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	3,6
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	2,9
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	2,9
Invesco Global Water ETF	2,9
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	2,2
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 493 000 \$ (413 000 \$ au 31 mars 2023). 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 résumant l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 septembre 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	1 216	-	1 216	23,8
Total	1 216	-	1 216	23,8

au 31 mars 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	991	(118)	873	20,3
Total	991	(118)	873	20,3

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 122 000 \$ (87 000 \$ au 31 mars 2023). 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 résumant les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	4 934	-	-	4 934
Total	4 934	-	-	4 934

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	4 135	-	-	4 135
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(1)	-	(1)
Total	4 135	(1)	-	4 134

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

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	4 681	4 873
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	179	183
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	1
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	1	2
Dividendes à recevoir	7	5
Intérêts à recevoir	1	1
Rabais sur frais à recevoir	1	1
Autres comptes débiteurs	-	-
	4 870	5 066
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	1
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	-	-
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	2	-
Autres comptes créditeurs	-	-
	2	1
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 868	5 065

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
	Série A	2 561	2 632	8,72	8,98	293 735
Série AT5	9	9	7,79	8,23	1 127	1 100
Série F	2 256	2 382	8,73	8,95	258 363	266 277
Série FT5	9	9	7,81	8,20	1 153	1 124
Série I	12	12	8,74	8,92	1 327	1 328
Série P	12	12	8,74	8,93	1 425	1 369
Série PT5	9	9	7,82	8,19	1 164	1 136

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	29	22
Intérêts aux fins des distributions	33	14
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1)	(128)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(168)	(225)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(107)	(317)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	-
Rabais sur frais	4	3
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	8	3
Total des revenus	(99)	(314)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	24	20
Frais d'administration (note 5)	3	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	6
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	1	2
Taxe de vente harmonisée	3	3
Total des charges	33	34
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(132)	(348)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(78)	(228)	(0,26)	(0,87)	293 600
Série AT5	-	(1)	(0,24)	(0,85)	1 112	1 052
Série F	(54)	(116)	(0,21)	(0,74)	260 239	156 032
Série FT5	-	-	(0,19)	(0,79)	1 137	1 064
Série I	-	(1)	(0,18)	(0,80)	1 327	1 026
Série P	-	(1)	(0,19)	(0,81)	1 421	1 025
Série PT5	-	(1)	(0,17)	(0,77)	1 149	1 069

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série F		Série FT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 632	2 217	9	9	2 382	1 116	9	9
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(78)	(228)	-	(1)	(54)	(116)	-	-
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	173	554	-	-	77	648	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(166)	(107)	-	-	(149)	(97)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	7	447	-	-	(72)	551	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(71)	219	-	(1)	(126)	435	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 561	2 436	9	8	2 256	1 551	9	9

	Série I		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	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	10	12	10	9	10	5 065	3 381
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(1)	-	(1)	-	(1)	(132)	(348)
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	-	-	-	-	-	-	250	1 202
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(315)	(204)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(65)	998
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	(1)	-	(1)	-	(1)	(197)	650
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	12	9	12	9	9	9	4 868	4 031

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(132)	(348)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1	128
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	168	225
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	6
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	530	1 092
Achat de placements et de dérivés	(508)	(1 850)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(2)	(1)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	58	(748)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-	-
Produit de l'émission de parts rachetables	211	1 190
Montant versé au rachat de parts rachetables	(273)	(302)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(62)	888
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(4)	140
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	183	209
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	179	349
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	33	14
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	26	19
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	16 859	FINB BMO ESG obligations de sociétés	461 553	427 544	
	4 654	FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	153 667	142 692	
	36 109	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	363 500	345 563	
	15 392	Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	297 608	287 061	
	34 544	Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	703 213	685 181	
	5 550	Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	107 316	104 146	
	6 465	FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	171 871	184 446	
USD	579	First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	70 235	73 838	
USD	1 597	Invesco Global Water ETF	76 442	73 273	
	54 478	iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	998 170	918 499	
	13 621	iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	338 640	324 316	
	8 151	iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	176 892	181 074	
USD	1 445	FNB iShares ESG Aware MSCI USA	176 873	184 314	
USD	995	iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	68 160	57 813	
USD	1 098	iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	107 866	112 463	
USD	2 739	KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	123 021	92 634	
	23 558	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	528 109	485 766	
	-		4 923 136	4 680 623	96,2
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			4 923 136	4 680 623	96,2
Commissions et autres coûts de transaction			(6 094)		
Total du portefeuille de placements			4 917 042	4 680 623	96,2
Autres actifs (passifs) nets				187 378	3,8
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				4 868 001	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

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

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 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 vertes mondiales CI	15 234	685	4,5
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	4 079	104	2,5
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	116 127	919	0,8
FINB BMO ESG obligations de sociétés	55 158	428	0,8
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	44 032	287	0,7
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI	75 742	346	0,5
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	125 782	486	0,4
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	72 732	184	0,3
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	83 916	143	0,2
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	166 425	181	0,1
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	63 914	58	0,1
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	104 843	93	0,1
Invesco Global Water ETF	337 230	73	-
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	2 634 814	324	-
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	1 464 687	112	-
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	1 383 658	74	-
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	16 441 615	184	-

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 vertes mondiales CI	14 975	717	4,8
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	3 783	114	3,0
FINB BMO ESG obligations de sociétés	56 806	445	0,8
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	132 682	962	0,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	43 141	303	0,7
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	108 016	510	0,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI	94 898	360	0,4
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	70 840	187	0,3
FNB iShares ESG Aware MSCI Canada Index	207 911	341	0,2
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	88 627	151	0,2
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	173 122	187	0,1
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	61 511	53	0,1
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	129 393	95	0,1
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	976 346	73	-
Invesco Global Water ETF	378 064	75	-
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	4 279 302	174	-
Vanguard ESG US Stock ETF	8 285 680	124	-

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	1	6
Paielements indirects†	-	2

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série F		Série FT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	293 030	237 566	1 100	1 038	266 277	120 098	1 124	1 050
Parts rachetables émises	19 324	62 278	-	-	8 638	74 171	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	27	31	-	-	29	31
Parts rachetables rachetées	(18 619)	(11 728)	-	-	(16 552)	(11 117)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	293 735	288 116	1 127	1 069	258 363	183 152	1 153	1 081

	Série I		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 328	1 026	1 369	1 025	1 136	1 056
Parts rachetables émises	-	-	56	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	28	31
Parts rachetables rachetées	(1)	-	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1 327	1 026	1 425	1 025	1 164	1 087

†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.

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,450	0,150
Série AT5	1,450	0,150
Série F	0,450	0,150
Série FT5	0,450	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	1 005	-
Garanties (hors trésorerie)	1 056	-

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

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

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	346
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	287
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	685
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	104
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	184

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	203
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série de FNB en \$ CA)	197
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	448
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	177

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	18,9
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	14,1
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	10,0
FINB BMO ESG obligations de sociétés	8,8
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	7,1
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	6,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	5,9
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	3,8
FNB iShares ESG Aware MSCI USA	3,8
Autres actifs (passifs) nets	3,8
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	3,7
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	2,9
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	2,3
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	2,1
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	1,9
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	1,5
Invesco Global Water ETF	1,5
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	1,2
Total	100,0

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares ESG Aware Canadian Aggregate Bond Index ETF	19,0
Fonds d'obligations vertes mondiales CI (série FNB en \$ CA)	14,1
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	10,1
FINB BMO ESG obligations de sociétés	8,8
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	7,1
iShares ESG Aware MSCI Canada Index ETF	6,7
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI (série FNB en \$ CA)	6,0
Autres actifs (passifs) nets	3,8
iShares ESG Aware MSCI EAFE Index ETF	3,7
FNB Indice MSCI Monde Incidence ESG CI (parts ordinaires non couvertes)	3,7
iShares ESG MSCI USA Leaders ETF	3,4
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders Index	3,0
Vanguard ESG US Stock ETF	2,4
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI (série de FNB en \$ CA)	2,3
KraneShares MSCI China Clean Technology Index ETF	1,9
Invesco Global Water ETF	1,5
First Trust NASDAQ Clean Edge Smart Grid Infrastructure Index Fund	1,4
iShares ESG MSCI EM Leaders ETF	1,1
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 468 000 \$ (487 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	604	-	604	12,4
Total	604	-	604	12,4

au 31 mars 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	595	(65)	530	10,5
Total	595	(65)	530	10,5

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 60 000 \$ (53 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	4 681	-	-	4 681
Total	4 681	-	-	4 681

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	4 873	-	-	4 873
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	-	-	-
Total	4 873	-	-	4 873

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

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	142 573	130 697
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	6 351	5 307
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	23	35
Swaps, options sur swaps et options	-	6
Montant à recevoir pour la vente de placements	232	388
Montant à recevoir pour la souscription de parts	167	163
Dividendes à recevoir	18	10
Intérêts à recevoir	20	16
Rabais sur frais à recevoir	43	43
Autres comptes débiteurs	-	-
	149 427	136 665
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	24
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	11	5
Frais d'administration à payer	1	1
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	956	318
Montant à payer pour le rachat de parts	299	176
Autres comptes créditeurs	-	-
	1 267	524
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	148 160	136 141

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
Série A	96 340	87 752	12,21	12,25	7 892 565	7 166 164
Série AT5	13	12	9,64	9,91	1 353	1 201
Série E	3 447	3 725	12,21	12,25	282 245	304 177
Série ET5	1	1	9,58	9,86	141	137
Série F	41 326	38 421	12,36	12,34	3 342 569	3 114 828
Série FT5	103	48	9,77	9,98	10 521	4 781
Série I	1 038	562	12,42	12,34	83 613	45 537
Série O	2 180	2 149	12,40	12,33	175 826	174 195
Série OT5	1	1	9,78	9,98	146	143
Série P	3 710	3 469	12,41	12,34	299 056	281 075
Série PT5	1	1	9,79	9,98	146	143

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

Portefeuille FNB croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	1 414	754
Intérêts aux fins des distributions	121	9
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(12)	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	2 250	138
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(3 129)	(13 745)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	644	(12 844)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	32	84
Profit (perte) de change sur la trésorerie	2	23
Rabais sur frais	257	208
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	291	315
Total des revenus	935	(12 529)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	875	613
Frais d'administration (note 5)	108	76
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	89	102
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	47	43
Taxe de vente harmonisée	89	61
Total des charges	1 209	896
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(274)	(13 425)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(325)	(8 543)	(0,04)	(1,56)	7 676 210
Série AT5	-	(1)	(0,04)	(1,31)	1 273	953
Série E	(2)	(495)	(0,01)	(1,61)	295 066	307 889
Série ET5	-	-	(0,04)	(1,34)	139	130
Série F	20	(3 692)	0,01	(1,52)	3 196 573	2 441 432
Série FT5	-	(6)	(0,03)	(1,31)	4 971	4 771
Série I	9	(51)	0,21	(1,22)	45 516	40 915
Série O	11	(239)	0,06	(1,72)	176 025	138 336
Série OT5	-	-	0,06	(1,27)	144	132
Série P	13	(398)	0,05	(1,51)	292 420	263 103
Série PT5	-	-	0,06	(1,27)	144	132

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

Portefeuille FNB croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	87 752	62 069	12	10	3 725	4 046	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(325)	(8 543)	-	(1)	(2)	(495)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	(1)	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	(1)	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	(2)	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	16 354	15 576	1	1	3	19	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 441)	(2 978)	-	-	(277)	(312)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	8 913	12 598	1	1	(274)	(293)	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 588	4 055	1	-	(278)	(788)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	96 340	66 124	13	10	3 447	3 258	1	1

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	38 421	26 685	48	52	562	52	2 149	2 030
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20	(3 692)	-	(6)	9	(51)	11	(239)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	(1)	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(1)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(1)	(1)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	8 175	11 133	58	-	564	572	60	60
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(5 290)	(1 983)	(2)	-	(97)	(2)	(40)	(574)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	2 885	9 150	56	-	467	570	20	(514)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 905	5 458	55	(7)	476	519	31	(753)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	41 326	32 143	103	45	1 038	571	2 180	1 277

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

Portefeuille FNB croissance Mosaique CI

États financiers (non audité)

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) 30 septembre (en milliers de dollars)

	Série OT5		Série P		Série PT5		Total du Fonds	
	2023	2022	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	3 469	2 751	1	1	136 141	97 698
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	13	(398)	-	-	(274)	(13 425)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(1)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	(2)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(1)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(3)	(1)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	514	1 879	-	-	25 729	29 240
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	(286)	(180)	-	-	(13 433)	(6 029)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	228	1 699	-	-	12 296	23 211
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	241	1 301	-	-	12 019	9 785
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	3 710	4 052	1	1	148 160	107 483

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

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(274)	(13 425)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 250)	(138)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	3 129	13 745
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(5)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	89	102
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	39 809	24 579
Achat de placements et de dérivés	(51 867)	(42 949)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(8)	(13)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(4)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	6	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	1	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	2
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(11 369)	(18 102)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	24 837	29 063
Montant versé au rachat de parts rachetables	(12 421)	(5 767)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	12 413	23 295
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	5
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 044	5 193
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	5 307	3 257
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	6 351	8 455
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	117	9
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 360	698
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	139 952	Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2 825 786	2 859 219	
	842 759	FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	14 952 024	14 166 779	
	401 562	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2 912 372	3 284 777	
	78 500	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	765 582	743 395	
USD	77 131	Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1 913 002	1 927 119	
	205 200	FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 562 342	2 497 284	
	252 529	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	6 420 229	5 868 774	
	235 781	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	4 508 442	4 670 822	
	229 040	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	5 627 507	5 991 686	
	472 377	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	12 170 765	11 620 474	
	723 500	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	14 764 467	14 752 165	
	284 438	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	9 684 079	9 739 157	
	480 106	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	12 929 942	12 362 730	
	254 223	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	9 461 725	10 362 130	
USD	367 862	FNB FTSE Japon Franklin	13 008 806	13 215 704	
	207 100	FNB Horizons Equal Weight Banks Index	3 998 405	3 901 764	
USD	38 812	iShares Core MSCI Europe ETF	2 656 099	2 617 896	
	500 155	iShares S&P/TSX 60 Index ETF	14 757 091	14 854 604	
USD	53 999	FNB JPMorgan Active Value	3 698 515	3 759 621	
USD	95 575	FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	3 601 732	3 376 481	
Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			143 218 912	142 572 581	96,2
Commissions et autres coûts de transaction			(144 662)		
Total du portefeuille de placements avant les dérivés			143 074 250	142 572 581	96,2
Contrat(s) de change à terme				22 975	0,0
Total du portefeuille de placements			143 074 250	142 595 556	96,2
Autres actifs (passifs) nets				5 564 789	3,8
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				148 160 345	100,0

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Contract(s) contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Royale du Canada	A-1+	14 décembre 2023	USD	1 072 241	JPY	155 710 000	0,01	22 975
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								22 975

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Portefeuille FNB croissance Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	35	(10)	-	25
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	35	(10)	-	25
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(24)	10	-	(14)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(24)	10	-	(14)

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

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice 1000 É.-U. CI	82 580	14 752	17,9
FNB alpha Marchés émergents CI	89 464	14 167	15,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	205 295	12 363	6,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	209 894	10 362	4,9
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	137 689	3 902	2,8
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	94 116	2 497	2,7
Fonds de lingots d'or CI	81 870	1 927	2,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	270 159	5 992	2,2
Fonds de produits de base généraux CI Auspice	145 257	2 859	2,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	591 221	9 739	1,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	311 501	4 671	1,5
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	540 768	5 869	1,1
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 303 147	11 620	0,9
FNB FTSE Japon Franklin	2 026 210	13 216	0,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	510 009	3 285	0,6
FNB JPMorgan Active Value	791 972	3 760	0,5
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	10 944 450	14 855	0,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2 656 672	3 376	0,1
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	759 485	743	0,1
iShares Core MSCI Europe ETF	5 375 820	2 618	-

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) (%)
FNB alpha Marchés émergents CI	84 716	12 810	15,1
FNB Indice 500 É.-U. CI	125 345	12 482	10,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	173 939	9 240	5,3
Fonds de lingots d'or CI	70 540	3 034	4,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	197 470	7 471	3,8
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	2 842	2,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	7 215	2,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	8 529	1,6
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	5 634	1,4
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	154 435	1 728	1,1
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	6 754	1,1
FNB JPMorgan Active Value	446 855	3 541	0,8
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	10 560	0,7
FNB FTSE Japon Franklin	1 362 079	9 083	0,7
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	3 036	0,6
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	11 015 224	13 531	0,1
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	3 379 362	3 872	0,1
iShares Core MSCI Europe ETF	5 739 072	4 793	0,1
FNB BMO Equal Weight Banks Index	3 801 476	2 498	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	46 790 631	2 045	-

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

Portefeuille FNB croissance Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	88	101
Paielements indirects†	33	28

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	7 166 164	4 876 863	1 201	888	304 177	317 827	137	128
Parts rachetables émises	1 324 511	1 309 573	121	121	285	1 751	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	31	28	-	-	4	4
Parts rachetables rachetées	(598 110)	(253 264)	-	(6)	(22 217)	(27 371)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	7 892 565	5 933 172	1 353	1 031	282 245	292 207	141	132

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 114 828	2 080 156	4 781	4 765	45 537	4 034	174 195	158 143
Parts rachetables émises	651 680	931 699	5 737	5	45 660	46 502	4 864	5 170
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	3	4	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(423 939)	(166 156)	-	-	(7 584)	(169)	(3 233)	(50 637)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	3 342 569	2 845 699	10 521	4 774	83 613	50 367	175 826	112 676

	Série OT5		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	143	130	281 075	214 294	143	130
Parts rachetables émises	-	-	40 871	158 378	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3	4	-	-	3	4
Parts rachetables rachetées	-	-	(22 890)	(15 225)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	146	134	299 056	357 447	146	134

†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.

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	1,550	0,150
Série AT5	1,550	0,150
Série E	1,550	0,150
Série ET5	1,550	0,150
Série F	0,550	0,150
Série FT5	0,550	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	14 690	-
Garanties (hors trésorerie)	15 425	-

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

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

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	46	99
Charges	(14)	(15)
Revenu tiré des prêts de titres	32	84
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	15,2

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2 859
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	14 167
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	3 285
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	743
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1 927
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	2 497
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	5 869
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	4 671
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	5 992
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	11 620
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	14 752
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	9 739
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	12 363
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	10 362

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB de produits de base généraux CI Auspice (couvert en \$ CA) (parts ordinaires)	1 085
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB \$ CA)	8 039
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2 541
FNB secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	3 357
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	2 183
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	1 097
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	5 370
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	4 914
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	5 300
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	9 350
FNB Indice 500 É.-U. CI	9 622
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6 361
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5 641
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6 155

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

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	10,0
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	10,0
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	9,6
FNB FTSE Japon Franklin	8,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	8,3
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	7,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	7,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6,6
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	4,0
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	4,0
Autres actifs (passifs) nets	3,8
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	3,2
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	2,6
FNB JPMorgan Active Value	2,5
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2,3
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2,2
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	1,9
iShares Core MSCI Europe ETF	1,8
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1,7
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,3
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	0,5
Contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

au 31 mars 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	9,9
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	9,4
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	9,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	7,8
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6,8
FNB FTSE Japon Franklin	6,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	6,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	5,5
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	5,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	5,0
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	4,1
Autres actifs (passifs) nets	4,0
iShares Core MSCI Europe ETF	3,5
FNB Xtrackers Harvest CSI 300 China A-Shares	2,8
FNB JPMorgan Active Value	2,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	2,2
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	2,2
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,1
FNB BMO Equal Weight Banks Index	1,8
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	1,5
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI (parts ordinaires non couvertes)	1,3
Contrat(s) de change à terme	0,0
Option(s)	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 14 257 000 \$ (13 070 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	25 022	1 455	26 477	17,9
Yen japonais	-	(1 432)	(1 432)	(1,0)
Total	25 022	23	25 045	16,9

au 31 mars 2023~

Devise	Instruments financiers nettes		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	(en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	26 385	(4 335)	22 050	16,2
Total	26 385	(4 335)	22 050	16,2

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 505 000 \$ (2 205 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	142 573	-	-	142 573
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	23	-	23
Total	142 573	23	-	142 596

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	130 697	-	-	130 697
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	11	-	11
Option(s)	6	-	-	6
Total	130 703	11	-	130 714

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

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

	30 sept. 2023	31 mars 2023
Actif		
Actifs courants		
Placements	111 308	113 474
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	4 599	4 236
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	29
Swaps, options sur swaps et options	-	6
Montant à recevoir pour la vente de placements	75	558
Montant à recevoir pour la souscription de parts	96	259
Dividendes à recevoir	3	2
Intérêts à recevoir	16	13
Rabais sur frais à recevoir	40	43
Autres comptes débiteurs	-	-
	116 137	118 620
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	20
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	5	3
Frais d'administration à payer	1	1
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	179	194
Montant à payer pour le rachat de parts	147	706
Autres comptes créditeurs	-	-
	332	924
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	115 805	117 696

États de la situation financière (suite)

au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023

(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 :	
	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023	30 sept. 2023	31 mars 2023
	Série A	69 707	70 391	9,86	10,16	7 070 976
Série AT5	495	566	7,77	8,21	63 682	68 883
Série E	5 552	5 456	9,87	10,17	562 664	536 293
Série ET5	1	1	7,80	8,24	131	128
Série F	29 030	29 543	9,90	10,17	2 933 339	2 903 695
Série FT5	479	482	7,81	8,23	61 334	58 612
Série I	928	1 281	9,94	10,18	93 399	125 804
Série O	7 791	7 850	9,92	10,18	785 093	771 305
Série OT5	1	1	7,85	8,25	134	131
Série P	1 820	2 124	9,92	10,17	183 368	208 733
Série PT5	1	1	7,85	8,25	134	131

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	1 166	827
Intérêts aux fins des distributions	555	874
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(10)	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	136	(1 711)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(4 881)	(7 305)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(3 034)	(7 315)
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	20	55
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(2)
Rabais sur frais	255	233
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	275	286
Total des revenus	(2 759)	(7 029)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	437	382
Frais d'administration (note 5)	88	77
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	76	149
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	41	66
Taxe de vente harmonisée	53	61
Total des charges	696	736
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 455)	(7 765)

États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 septembre
(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	(2 169)	(4 701)	(0,31)	(0,75)	7 070 203
Série AT5	(16)	(6)	(0,23)	(0,63)	67 208	9 231
Série E	(171)	(350)	(0,31)	(0,76)	558 242	466 174
Série ET5	-	-	(0,24)	(0,64)	129	120
Série F	(812)	(1 796)	(0,27)	(0,76)	2 951 254	2 320 859
Série FT5	(14)	(34)	(0,23)	(0,62)	59 805	56 779
Série I	(27)	(108)	(0,23)	(0,57)	120 963	190 064
Série O	(198)	(557)	(0,25)	(0,71)	786 085	776 391
Série OT5	-	-	(0,20)	(0,60)	133	122
Série P	(48)	(213)	(0,24)	(0,77)	198 835	277 432
Série PT5	-	-	(0,20)	(0,60)	133	122

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	70 391	64 591	566	83	5 456	4 845	1	1
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 169)	(4 701)	(16)	(6)	(171)	(350)	-	-
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(13)	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(2)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(13)	(2)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	10 944	10 902	-	1	573	483	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	4	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(9 459)	(8 149)	(46)	-	(306)	(335)	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1 485	2 753	(42)	1	267	148	-	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(684)	(1 948)	(71)	(7)	96	(202)	-	-
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	69 707	62 643	495	76	5 552	4 643	1	1

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	29 543	24 561	482	513	1 281	300	7 850	8 211
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(812)	(1 796)	(14)	(34)	(27)	(108)	(198)	(557)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	(12)	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	(14)	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	(12)	(14)	-	-	-	-
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	3 457	5 541	60	-	212	2 499	549	465
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	8	9	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 158)	(4 535)	(45)	(5)	(538)	(248)	(410)	(300)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	299	1 006	23	4	(326)	2 251	139	165
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(513)	(790)	(3)	(44)	(353)	2 143	(59)	(392)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	29 030	23 771	479	469	928	2 443	7 791	7 819

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

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) 30 septembre (en milliers de dollars)

	Série OTS		Série P		Série PTS		Total du Fonds	
	2023	2022	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	2 124	3 377	1	1	117 696	106 484
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(48)	(213)	-	-	(3 455)	(7 765)
Distributions aux porteurs de parts rachetables								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	(25)	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	(16)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	(25)	(16)
Transactions sur parts rachetables								
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	192	312	-	-	15 987	20 203
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	12	9
Rachat de parts rachetables	-	-	(448)	(981)	-	-	(14 410)	(14 553)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	-	(256)	(669)	-	-	1 589	5 659
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	-	-	(304)	(882)	-	-	(1 891)	(2 122)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	1	1	1 820	2 495	1	1	115 805	104 362

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

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

	2023	2022
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 455)	(7 765)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(136)	1 711
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	4 881	7 305
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	76	149
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	19 955	31 813
Achat de placements et de dérivés	(22 129)	(35 010)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(2)	(2)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(2)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	1	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	2	2
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(807)	(1 798)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(13)	(7)
Produit de l'émission de parts rachetables	15 609	16 344
Montant versé au rachat de parts rachetables	(14 427)	(10 337)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	1 169	6 000
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	362	4 202
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	4 236	2 659
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice	4 599	6 862
Informations supplémentaires :		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	553	874
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 123	771
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Intérêts payés sur prêts	-	-
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.

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Inventaire du portefeuille au 30 septembre 2023 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE			
	712 784	FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	7 121 321	6 821 343	
	334 800	Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	6 306 628	6 294 240	
	143 060	Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2 886 453	2 922 716	
	178 850	FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	3 249 779	3 006 468	
	76 585	FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	526 665	626 465	
	3 138 109	FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	33 003 127	29 717 891	
	980 116	Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	9 542 416	9 252 295	
	827 150	FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	16 596 437	16 179 053	
USD	78 453	Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1 983 857	1 960 149	
	49 182	FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1 247 287	1 142 990	
	44 650	FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	830 034	884 517	
	51 024	FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1 239 921	1 334 788	
	88 105	Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	2 321 726	2 167 383	
	152 200	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	3 106 961	3 103 358	
	248 627	FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	4 665 122	3 913 389	
	54 490	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 843 699	1 865 738	
	90 493	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2 481 937	2 330 195	
	53 356	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 957 352	2 174 791	
	39 400	FNB Horizons Equal Weight Banks Index	760 711	742 296	
USD	23 649	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	3 390 258	2 848 834	
USD	34 061	iShares Core MSCI EAFE ETF	2 963 785	2 977 047	
	95 629	iShares S&P/TSX 60 Index ETF	2 747 579	2 840 181	
USD	11 208	FNB JPMorgan Active Value	773 726	780 345	
USD	201 295	SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	6 258 032	5 421 699	
	-		117 804 813	111 308 171	96,2
		Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	117 804 813	111 308 171	96,2
		Commissions et autres coûts de transaction	(193 939)		
		Total du portefeuille de placements	117 610 874	111 308 171	96,2
		Autres actifs (passifs) nets		4 497 131	3,8
		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		115 805 302	100,0

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 septembre 2023

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

au 31 mars 2023

	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Montants admissibles à la compensation		Exposition nette (en milliers de dollars)
		Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	29	(9)	-	20
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	29	(9)	-	20
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(20)	9	-	(11)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(20)	9	-	(11)

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

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

au 30 septembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	24 200	3 913	16,2
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	104 367	16 179	15,5
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	75 742	6 821	9,0
FNB alpha Marchés émergents CI	759 485	29 718	3,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI	81 870	3 103	3,8
Fonds de lingots d'or CI	82 580	1 960	2,4
Fonds de produits de base généraux CI Auspice	81 870	3 007	3,4
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	89 464	1 960	2,0
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	145 257	2 923	2,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	205 295	2 330	1,1
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	565 472	6 294	1,1
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	209 894	2 175	1,0
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	1 067 307	9 252	0,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	137 689	742	0,5
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	270 159	1 335	0,5
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	591 221	1 866	0,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	311 501	885	0,3
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	2 469 857	5 422	0,2
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	540 768	1 143	0,2
FNB JPMorgan Active Value	1 303 147	2 167	0,2
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	510 009	627	0,1
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	791 972	780	0,1
iShares Core MSCI EAFE ETF	10 944 450	2 840	-
	52 401 489	2 849	-
	129 654 185	2 977	-

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) (%)
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	87 477	15 179	17,4
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI (couvert en \$ CA)	26 437	4 268	16,1
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	94 898	10 115	10,7
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	729 060	29 336	4,0
FNB alpha Marchés émergents CI	84 716	3 027	3,6
FNB Indice 500 É.-U. CI	125 345	2 552	2,0
FNB de produits de base généraux CI Auspice	116 717	2 250	1,9
Fonds de lingots d'or CI	70 540	1 096	1,6
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI	598 480	6 499	1,1
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	173 939	1 702	1,0
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	197 470	1 760	0,9
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI	1 349 977	11 140	0,8
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	312 144	1 380	0,4
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	403 188	1 130	0,3
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	529 530	1 713	0,3
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	621 573	1 352	0,2
FNB JPMorgan Active Value	446 855	701	0,2
FNB SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond	2 299 191	5 275	0,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro	1 557 336	2 256	0,1
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	514 367	583	0,1
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	11 015 224	2 693	-
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	46 790 631	4 262	-
FNB BMO Equal Weight Banks Index	3 801 476	456	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	130 106 853	2 748	-

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

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

	2023	2022
Commissions de courtage	75	147
Paielements indirects†	28	42

Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série A		Série AT5		Série E		Série ET5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	6 926 907	6 096 324	68 883	9 153	536 293	456 810	128	119
Parts rachetables émises	1 082 193	1 075 683	-	94	56 661	47 385	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	468	78	-	-	3	3
Parts rachetables rachetées	(938 124)	(801 389)	(5 669)	-	(30 290)	(32 467)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	7 070 976	6 370 618	63 682	9 325	562 664	471 728	131	122

	Série F		Série FT5		Série I		Série O	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 903 695	2 314 976	58 612	56 623	125 804	28 313	771 305	773 687
Parts rachetables émises	341 764	542 896	7 248	-	20 809	242 786	54 403	45 463
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	1 056	1 053	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(312 120)	(450 801)	(5 582)	(561)	(53 214)	(24 694)	(40 615)	(29 570)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	2 933 339	2 407 071	61 334	57 115	93 399	246 405	785 093	789 580

	Série OT5		Série P		Série PT5	
	2023	2022	2023	2022	2023	2022
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice	131	120	208 733	318 216	131	120
Parts rachetables émises	-	-	18 817	30 443	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	3	3	-	-	3	3
Parts rachetables rachetées	-	-	(44 182)	(96 678)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice	134	123	183 368	251 981	134	123

†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.

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 septembre 2023 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série A	0,950	0,150
Série AT5	0,950	0,150
Série E	0,950	0,150
Série ET5	0,950	0,150
Série F	0,450	0,150
Série FT5	0,450	0,150
Série I	Payés directement par les investisseurs	Payés directement par les investisseurs
Série O	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série OT5	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série P	Payés directement par les investisseurs	0,150
Série PT5	Payés directement par les investisseurs	0,150

Prêts de titres (note 6)

au 30 septembre (en milliers de dollars)

	2023	2022
Titres prêtés	5 350	1 856
Garanties (hors trésorerie)	5 618	1 893

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

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

	2023	2022
Revenu brut tiré des prêts de titres	28	65
Charges	(8)	(10)
Revenu tiré des prêts de titres	20	55
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	30,0	15,4

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	6 821
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB \$ CA)	6 294
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2 923
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	3 007
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	627
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	29 718
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	9 252
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	16 179
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1 960
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1 143
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	885
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1 335
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	2 167
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	3 103
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	3 913
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 866
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2 330
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2 175

Placements dans des parties liées (note 9)

aux 30 septembre (en milliers de dollars)

Placements	2022
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	6 492
FNB de produits de base généraux CI Auspice (couvert en \$ CA) (parts ordinaires)	638
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB \$ CA)	1 814
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	562
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	27 661
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	3 911
FNB secteur financier mondial CI (parts ordinaires)	745
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1 441
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI (parts ordinaires)	241
FNB d'obligations de qualité supérieure CI (parts ordinaires)	12 761
Fonds alternatif de rendement amélioré CI Marret (série FNB en \$ CA)	5 120
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1 178
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1 052
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1 266
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (Série FNB \$ CA)	2 038
FNB Indice 500 É.-U. CI	2 454
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	3 667
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 374
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 322
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1 386

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

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

au 30 septembre 2023

Fonds	Actif net (%)
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires couvertes)	25,4
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	14,0
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	8,0
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	5,9
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	5,4
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	4,7
Autres actifs (passifs) nets	3,9
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	3,4
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	2,7
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	2,6
iShares Core MSCI EAFE ETF	2,6
Fonds de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	2,5
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	2,5
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	2,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	2,0
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	1,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,9
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	1,7
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,6
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1,2
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1,0
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	0,8
FNB JPMorgan Active Value	0,7
FNB Horizons Equal Weight Banks Index	0,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,5
Total	100,0

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Risque de concentration (suite)

au 31 mars 2023

	Actif net (%)
Fonds	
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI (parts ordinaires)	24,9
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI (série de FNB en \$ CA)	12,9
Fonds amélioré d'obligations à courte durée CI (série FNB en \$ CA)	9,5
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI (parts ordinaires)	8,6
Fonds alternatif de titres de crédit de qualité supérieure CI (série FNB en \$ CA)	5,5
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond ETF	4,5
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI (parts ordinaires)	3,6
iShares 20+ Year Treasury Bond ETF	3,6
Autres actifs (passifs) nets	3,6
FNB alpha Marchés émergents CI (série FNB en \$ CA)	2,6
iShares Core MSCI EAFE ETF	2,3
iShares S&P/TSX 60 Index ETF	2,3
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	2,2
Fonds alternatif de croissance mondiale CI Munro (série FNB en \$ CA)	1,9
FNB de produits de base généraux CI Auspice (parts ordinaires couvertes)	1,9
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,5
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (parts non couvertes)	1,4
FNB Indice Morningstar International Valeur CI (parts ordinaires non couvertes)	1,2
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI (parts ordinaires)	1,1
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI (parts ordinaires)	1,0
Fonds de lingots d'or CI (série FNB en \$ US)	0,9
FNB JPMorgan Active Value	0,6
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI (parts ordinaires non couvertes)	0,5
FNB BMO Equal Weight Banks Index	0,4
Contrat(s) de change à terme	0,0
Option(s)	0,0
Total	100,0

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

Portefeuille FNB à revenu Mosaique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

Autre risque de prix

Au 30 septembre 2023 et au 31 mars 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 septembre 2023, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 11 131 000 \$ (11 347 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

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

au 30 septembre 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	14 118	-	14 118	12,2
Total	14 118	-	14 118	12,2

au 31 mars 2023-

Devise	Instruments financiers		Exposition nette (en M\$)	Actif net (%)
	nette (en M\$)	Dérivés (en M\$)		
Dollar américain	14 101	(1 643)	12 458	10,6
Total	14 101	(1 643)	12 458	10,6

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

Au 30 septembre 2023, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 mars 2023) 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 1 412 000 \$ (1 246 000 \$ au 31 mars 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Veuillez consulter la note 10 pour une analyse des autres risques liés aux instruments financiers.

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 septembre 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	111 308	-	-	111 308
Total	111 308	-	-	111 308

Positions acheteur à la juste valeur au 31 mars 2023

	Niveau 1 (en M\$)	Niveau 2 (en M\$)	Niveau 3 (en M\$)	Total (en M\$)
Fonds négocié(s) en bourse	113 474	-	-	113 474
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	9	-	9
Option(s)	6	-	-	6
Total	113 480	9	-	113 489

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

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

Notes des états financiers (non audité)

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). La Compagnie Trust CIBC Mellon est dépositaire (« le dépositaire ») des Fonds. La 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, 2^e étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 22 novembre 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	1 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 marché monétaire É.-U. CI							
(auparavant Fonds marché monétaire É.-U. CI)	30 janv. 1995	-	-	-	-	-	1 mai 2017
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	1 févr. 1977	-	-	-	27 juill. 2011	4 août 2015	17 nov. 2000
	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	-	-	-	-
Fonds de placements canadiens CI	-	-	31 oct. 1996	-	-	29 août 2003	27 juill. 2011

*Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

	Date de création :						
	Série FT5	Série FH	Série I	Série IH	Série ITS	Série Prestige	Série O
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	-	-	1 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 marché monétaire É.-U. CI	-	-	4 juill. 2016	-	-	-	-
(auparavant Fonds marché monétaire É.-U. CI)	-	-	4 juill. 2016	-	-	-	-
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	-	-	31 oct. 1996	-	-	29 août 2003	27 juill. 2011
	Série P	Série PH	Série PP	Série W	Série WH	Série X	Série Y
Fonds américain de petites sociétés CI	1 mai 2017	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-	-
Fonds de bitcoins CI	5 avril 2021	-	-	5 avril 2021 [^]	-	-	-
Fonds de placements canadiens CI	1 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	1 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	1 mai 2017	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-	-
Fonds de valeur internationale CI	1 mai 2017	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-	-
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	1 mai 2017	9 mars 2020	-	27 juill. 2017 [^]	9 mars 2020 [^]	-	-
Fonds marché monétaire CI	1 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

	Date de création :						
	Série A	Série AT5	Série AT6	Série AT8	Série D	Série E	Série ET5
Fonds canadien de dividendes CI	1 févr. 2005	-	-	-	31 août 2004*	7 janv. 2014	-
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	-	-	-	-	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	-	-	-	-	-	1 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	-	1 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	-	1 mai 2017	22 nov. 2019	-	27 juill. 2017 [^]
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	-	30 juill. 2013	23 juill. 2021	1 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	-	1 mai 2017	-	-	27 sept. 2019 [^]
Fonds américain de dividendes CI	-	31 juill. 2013	-	1 mai 2017	-	-	27 sept. 2019 [^]
Fonds enregistré de dividendes américains CI	-	24 déc. 2014	-	1 mai 2017	-	-	-
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	-	27 mars 2015	-	1 mai 2017	-	-	-

*Ces séries ne sont plus disponibles aux nouveaux achats.

**Le 31 décembre 2017, les parts de série C ont été redesignées comme parts de série I.

[^]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 (non audité) (suite)

	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	1 févr. 2005	7 juill. 2008*	1 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	1 mai 2017				
Fonds chefs de file mondiaux CI	7 juin 2006	4 août 2015	1 mai 2017				
Fonds d'actions internationales CI	30 sept. 2008	4 août 2015	1 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	-	-	-	-	1 juin 2017	1 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	1 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 (non audité) (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	-	1 nov. 2001	-	29 août 2003	27 juill. 2011	-
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	30 nov. 2000	-	1 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	1 oct. 2001	31 août 2021	-	30 juill. 2013	-
Fonds de revenu à taux variable CI	1 juin 2017	-	1 juin 2017	-	-	1 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	1 mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds équilibré canadien CI	1 mai 2017	-	8 avril 2022	14 août 2009*	-	-	8 avril 2022
Fonds d'obligations canadiennes CI	1 mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	14 avril 2022*
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	1 mai 2017	-	-	-	-	-	3 nov. 2017
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds de rendement diversifié CI	1 mai 2017	-	22 nov. 2019	-	27 sept. 2019 [^]	-	22 nov. 2019
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	1 mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017 [^]	29 août 2003*	-
Fonds des marchés émergents CI	1 mai 2017	31 août 2021	-	-	-	-	-
Fonds de revenu à taux variable CI	7 juin 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds d'obligations mondiales CI	1 mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	1 mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds mondial de dividendes CI	1 mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	1 mai 2017	-	8 avril 2022	-	6 juin 2022 [^]	-	8 avril 2022
Fonds de ressources mondiales CI	1 mai 2017	-	-	-	-	-	-
Fonds de revenu élevé CI	1 mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	1 mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds d'actions privilégiées CI	1 mai 2017	-	-	-	27 sept. 2019 [^]	-	-
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	1 mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	1 mai 2017	-	-	-	27 juill. 2017 [^]	-	-
Fonds d'obligations à court terme CI	1 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 (non audité) (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	1 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	1 mai 2017	1 mai 2017	1 mai 2017	-
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1 mai 2017	-	1 mai 2017	-
Série Portefeuilles équilibrée prudente CI	30 juill. 2013	-	-	1 mai 2017	-	-	-
Série Portefeuilles prudente CI	30 juill. 2013	-	-	1 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

	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	1 mai 2017	-	1 mai 2017	-
Série Portefeuilles de revenu CI	30 juill. 2013	-	-	1 mai 2017	-	-	-
Série Portefeuilles croissance maximale CI	30 juill. 2013	4 août 2015	4 août 2015	1 mai 2017	-	1 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Date de création :

	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 14 avril 2023, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
Catégorie mandat privé d'actions de revenu mondiales CI	Mandat privé d'actions concentrées 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 (VNI) 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 14 avril 2023, 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
Catégorie mandat privé d'actions de revenu mondiales CI	Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI	1 328 222	97 458 554

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

Fonds clôturé	Fonds prorogé
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

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net	
		acquis (\$)	Parts émises
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

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

Les états de la situation financière sont au 30 septembre et au 31 mars 2023, 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 périodes closes les 30 septembre 2023 et 2022, sauf dans le cas des Fonds lancés au cours de l'un ou l'autre de ces périodes; pour ceux-ci, les données fournies couvrent la période allant de la date de création aux 30 septembre 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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.

Au 30 septembre 2023, au 31 mars 2023 et au 30 septembre 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 la période.

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 ».

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées séparément dans les états du résultat global.

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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 la période 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 30 septembre, le gestionnaire détenait des placements dans les Fonds suivants :

Fonds	2023 (en \$)	2022 (en \$)
Fonds américain de petites sociétés CI	4 747	4 552
Fonds de bitcoins CI	1 922	1 413
Fonds de placements canadiens CI	1 409	1 269
Fonds d'obligations de marchés émergents CI	883	822
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	176 007	s.o.
Fonds Ethereum CI	1 226	1 007
Fonds d'obligations mondiales neutre en devises CI	159 938	s.o.
Fonds chefs de file mondiaux pour le climat CI	65 665	62 355
Fonds d'obligations vertes mondiales CI	190 085	165 026
Fonds d'économie mondiale de la longévité CI	1 315	1 091
Fonds d'actions mondiales sélectionnées CI	1 657 558	1 435 695
Fonds d'infrastructures durables mondiales CI	181 906	155 086
Fonds de valeur mondiale CI	4 130	3 524
Fonds Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	156 034	s.o.
Fonds de revenu CI	1 056	1 004
Fonds de valeur internationale CI	4 003	3 237
Fonds d'obligations de qualité supérieure CI	61 014	64 311
Fonds marché monétaire CI	1 055	1 009
Fonds Indice MSCI Monde Incidence ESG CI	5 496	5 336
Fonds d'actions mondiales axées sur la croissance CI Munro	64 163	59 448
Fonds Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	198 531	s.o.
Fonds de revenu américain en dollars US CI	5 397	5 161
Fonds marché monétaire É.-U. CI	1 457	1 412
Fonds d'actions américaines sélectionnées CI	3 178	2 682
Fonds de lancement Sélect CI	24 437	23 500
Fonds de répartition de l'actif canadien CI	2 203	2 069
Fonds d'obligations canadiennes de base améliorées CI	1 700	1 745
Fonds canadien de dividendes CI	1 671	1 504
Fonds d'actions canadiennes CI	6 263	5 067
Fonds d'occasions de dividendes mondiaux CI	1 495	1 334
Fonds mondial d'actions et de revenu CI	6 228	6 001

Fonds (suite)	2023 (en \$)	2022 (en \$)
Fonds d'actions mondiales CI	6 485	5 746
Fonds de petites sociétés mondiales CI	3 835	3 360
Fonds d'actions canadiennes petite/moyenne capitalisation pur CI	1 424	1 413
Fonds américain de dividendes CI	3 011	2 704
Fonds enregistré de dividendes américains CI	4 442	3 994
Fonds de dividendes américains en dollars US CI	5 755	5 198
Fonds équilibré mondial CI	1 265	1 140
Fonds d'occasions Asie CI	2 395	2 248
Fonds de croissance et de revenu canadien CI	1 270	1 171
Fonds d'obligations de sociétés CI	1 131	1 076
Fonds de rendement diversifié CI	2 603	2 441
Fonds de croissance et de revenu de dividendes CI	1 616	1 469
Fonds des marchés émergents CI	46 054	43 023
Fonds de revenu à taux variable CI	5 008	4 572
Fonds d'obligations mondiales CI	846	836
Fonds d'obligations mondiales de base améliorées CI	2 889	2 889
Fonds mondial de croissance et de revenu CI	1 035	955
Fonds de ressources mondiales CI	5 382	4 454
Fonds de revenu élevé CI	-	1 317
Fonds d'obligations à rendement élevé CI	2 479	2 249
Fonds d'actions privilégiées CI	2 679	2 735
Fonds d'actions canadiennes sélect CI	2 661	1 477
Fonds d'actions mondiales Sélect CI	1 522	1 346
Fonds d'obligations à court terme CI	2 048	1 994
Fonds américain Synergy CI	4 419	3 718
Série Portefeuilles équilibrée CI	9 823	9 051
Série Portefeuilles croissance équilibrée CI	11 668	10 546
Série Portefeuilles prudente CI	1 061	1 018
Série Portefeuilles croissance CI	11 870	10 584
Série Portefeuilles croissance maximale CI	14 365	12 460
Portefeuille FNB équilibré Mosaïque CI	7 293	7 930
Portefeuille FNB équilibré de croissance Mosaïque CI	10 466	9 518
Portefeuille FNB équilibré à revenu Mosaïque CI	7 909	8 567
Portefeuille FNB équilibré ESG Mosaïque CI	439 433	423 676
Portefeuille FNB équilibré de croissance ESG Mosaïque CI	450 321	418 124
Portefeuille FNB équilibré à revenu ESG Mosaïque CI	441 074	426 845
Portefeuille FNB croissance Mosaïque CI	11 208	11 246
Portefeuille FNB à revenu Mosaïque CI	7 291	8 088
Mandat privé canadien de dividendes CI	1 761	1 597
Mandat privé d'actions canadiennes CI	1 567	1 433
Mandat privé de revenu fixe canadien CI	1 813	1 833
Mandat privé de répartition de l'actif mondial CI	2 432	2 247
Mandat privé d'actions concentrées mondiales CI	2 945	5 147
Mandat privé d'obligations d'État améliorées mondiales CI	903	913
Mandat privé alpha d'actions mondiales CI	1 419	1 255

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	2023 (en \$)	2022 (en \$)
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	2 602	2 338
Mandat privé d'infrastructures mondiales CI	690	1 772
Mandat privé d'actif réel mondial CI	-	1 039
Mandat privé d'immobilier mondial CI	1 633	1 685
Mandat privé de petites sociétés mondiales CI	2 921	3 860
Mandat privé d'obligations sans restriction mondiales CI	1 216	1 146
Mandat privé alpha d'actions internationales CI	1 573	2 422
Mandat privé croissance d'actions internationales CI	1 275	5 081
Mandat privé d'obligations de qualité supérieure CI	912	912
Mandat privé d'actions américaines CI	1 433	1 698

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 la période close le 30 septembre 2023, le gestionnaire des Fonds a absorbé un total de 297 000 \$ (786 000 \$ au 30 septembre 2022), 3 431 000 \$ (1 073 000 \$ au 30 septembre 2022) et 11 000 \$ US (20 000 \$ US au 30 septembre 2022) en frais de gestion en raison de la baisse des rendements générés par les Fonds suivants : 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 la période, 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 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 distribués aux porteurs de parts de manière à ce que chaque Fonds n'ait aucun impôt à payer. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. L'impôt sur le montant net des gains en capital réalisés qui ne sont ni payés ni payables peut, en général, être recouvré en vertu des dispositions de remboursement contenues dans la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et dans les lois provinciales de l'impôt sur le revenu, lorsque

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 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 ».

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 la période close le 30 septembre 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 la période close le 30 septembre 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 périodes closes les 30 septembre 2023 et 2022, les Fonds ont effectué des opérations entre fonds liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans un ou des fonds liés à la fin de chaque période.

Opérations entre fonds

Ces opérations entre fonds surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète un titre d'un émetteur auprès d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le CEI passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours des périodes closes les 30 septembre 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 offert en dollars canadiens

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 CDOR à des taux de référence alternatifs peut avoir une incidence sur un Fonds qui détient des placements indexés au CDOR. Les risques de marché découlent du fait que les nouveaux taux de référence sont susceptibles de différer des taux CDOR, ce qui peut se répercuter sur la volatilité ou la liquidité des marchés pour les instruments actuellement indexés sur 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 CDOR découlant des titres en portefeuille.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 la période close le 30 septembre 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 0 millions \$ (0 % de la valeur liquidative) (4,4 millions \$, ou 0,5 % de la valeur liquidative au 31 mars 2023) et la juste valeur globale la plus élevée de l'effet de levier utilisé durant la période s'élevait à 0 millions \$ (0 % de la valeur liquidative) (7,8 millions \$, ou 0,8 % de la valeur liquidative au 31 mars 2023).

Durant la période close le 30 septembre 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 millions \$ (0 % de la valeur liquidative) (0 million \$, ou 0 % de la valeur liquidative au 31 mars 2023) et la juste valeur globale la plus élevée de l'effet de levier utilisé durant la période s'élevait à 0 million \$ (0 % de la valeur liquidative) (0,2 million \$, ou 0,4 % de la valeur liquidative au 31 mars 2023).

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 30 septembre 2023, la note de crédit du dépositaire était de AA (AA au 31 mars 2023).

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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque qu'un Fonds ne puisse pas respecter ses engagements à temps ou à un prix raisonnable. Les Fonds sont exposés à des rachats en trésorerie quotidiens de parts rachetables. 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 liquidité. 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 le flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des conditions du marché.

Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt). La valeur de chaque placement est influencée par les perspectives de l'émetteur et par les conditions économiques et politiques générales, de même que par les tendances du secteur et du marché. Les titres présentent tous un risque de perte de capital. 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 périodes 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.

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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 DEISES

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

11. LÉGENDE DES DEISES (suite)

ILS	Shekel israélien
THB	Baht thaï
INR	Roupie indienne
TWD	Nouveau dollar de Taïwan
JPY	Yen japonais
USD	Dollar américain
KRW	Won sud-coréen
ZAR	Rand sud-africain

Avis juridique

Certains noms, mots, phrases, graphismes ou conceptions graphiques figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Gestion mondiale d'actifs CI.

Fonds CI, Financière CI, 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.