



GESTION  
MONDIALE D'ACTIFS

# ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2024

30 JUIN 2024

# Table des matières

FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI	1
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	10
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	21
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	32
FNB indiciel biorévolution CI	43
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	55
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	64
FNB Indice d'actions canadiennes CI	76
FNB de FPI canadiennes CI	91
FNB de répartition de l'actif prudent CI	102
FNB indiciel sécurité numérique CI	113
FNB alpha Marchés émergents CI	124
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	137
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	148
FNB de répartition de l'actif en actions CI	161
FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy	172
FNB indiciel métavers CI Galaxy	183
FNB alpha Innovation mondiale CI	194
FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise	205
FNB Secteur financier mondial CI	213
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	224
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	237
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	256
Fonds de lingots d'or CI	272
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	282
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	292
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	303
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	314
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	323
FNB marché monétaire CI	338
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	347
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	356
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	365
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	381
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	397
FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI	407
FNB d'actions privilégiées CI	421
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	435
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	445
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	457
FNB Indice 1000 É.-U. CI	467
FNB Indice 500 É.-U. CI	488
FNB indiciel momentum amélioré américain CI	508
FNB indiciel valeur améliorée américain CI	508
FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI	508
FNB marché monétaire É.-U. CI	520
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	529
FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI	540
Notes des états financiers	551
Avis juridique	569

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

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

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	34 015	76 520
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	10	21
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	7
	34 025	76 548
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	6	13
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	4	19
	10	32
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>34 015</b>	<b>76 516</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	34 015	76 516	9,86	9,94	3 449 969	7 699 969

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	707	1 130
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	(1 016)	(921)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	404	995
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>95</b>	<b>1 204</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	9	7
Rabais sur frais	10	43
Autres revenus	7	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>26</b>	<b>50</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>121</b>	<b>1 254</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	46	92
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	3	6
<b>Total des charges</b>	<b>50</b>	<b>101</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>71</b>	<b>1 153</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	71	1 153	0,01	0,12	4 738 431	9 490 024

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	76 516	106 853	76 516	106 853
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	71	1 153	71	1 153
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(716)	(1 064)	(716)	(1 064)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(29)	-	(29)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(745)	(1 064)	(745)	(1 064)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	3 441	9 409	3 441	9 409
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(45 268)	(29 676)	(45 268)	(29 676)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(41 827)	(20 267)	(41 827)	(20 267)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(42 501)	(20 178)	(42 501)	(20 178)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	34 015	86 675	34 015	86 675

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	71	1 153
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 016	921
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(404)	(995)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	(215)	451
Achat de placements et de dérivés	1 830	1 069
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(8)	(6)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(8)	1
Amortissement des produits d'intérêts	(706)	(1 129)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 576</b>	<b>1 467</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(744)	(1 064)
Produit de l'émission de parts rachetables	63	187
Montant versé au rachat de parts rachetables	(906)	(580)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 587)</b>	<b>(1 457)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(11)	10
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	21	17
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>10</b>	<b>27</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	1
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>				
1 426 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2024	1 421 132	1 417 930	
1 457 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2025	1 432 290	1 415 563	
1 298 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2025	1 265 473	1 235 797	
1 294 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2026	1 247 449	1 209 813	
1 390 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2026	1 319 824	1 275 519	
1 403 000	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2027	1 315 374	1 265 258	
1 539 883	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 août 2027	1 369 016	1 364 884	
1 554 403	Hydro-Québec, coupon détaché, 15 février 2028	1 354 395	1 351 295	
1 843 182	Hydro-Québec, coupon zéro, 15 août 2028	1 556 728	1 572 732	
1 875 142	Hydro-Québec, coupon zéro, 15 février 2029	1 553 970	1 569 803	
1 443 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2024	1 426 335	1 415 528	
1 463 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2025	1 426 708	1 405 431	
1 293 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2025	1 252 003	1 216 848	
1 319 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2026	1 262 857	1 219 898	
1 405 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2026	1 324 025	1 276 415	
1 410 000	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2027	1 310 700	1 259 399	
1 552 616	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 décembre 2027	1 364 301	1 361 320	
1 587 077	Province de l'Ontario, coupon détaché, 2 juin 2028	1 366 567	1 365 850	
1 863 832	Province de l'Ontario, coupon zéro, 2 décembre 2028	1 557 328	1 573 723	
1 892 215	Province de l'Ontario, coupon zéro, 2 juin 2029	1 550 328	1 567 792	
		27 676 803	27 340 798	80,4
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>				
1 421 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1er juin 2025	1 390 608	1 365 663	
1 263 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1er juin 2026	1 219 311	1 171 328	
1 389 000	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1er juin 2027	1 305 436	1 249 309	
1 537 874	Gouvernement du Canada, coupon détaché, 1er juin 2028	1 349 468	1 338 385	
1 837 912	Gouvernement du Canada, coupon zéro, 1er juin 2029	1 542 840	1 549 594	
		6 807 663	6 674 279	19,6
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>34 484 466</b>	<b>34 015 077</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>34 484 466</b>	<b>34 015 077</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets			(190)	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>34 014 887</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paievements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	7 699 969	10 949 969
Parts rachetables émises	350 000	950 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(4 600 000)	(3 000 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>3 449 969</b>	<b>8 899 969</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,200

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	11 612	-
Garanties (hors trésorerie)	12 193	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	13	10
Charges	(4)	(3)
Revenu tiré des prêts de titres	9	7
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,0</b>

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations provinciales	80,3
Obligations d'état canadiennes	19,7
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

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

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	19,6
AA/Aa/A+	80,4
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

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

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	7 020	12 380	14 615	-	34 015

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

# FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt (suite) au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	6 293	28 640	30 975	10 612	76 520

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 227 000 \$ (608 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	34 015	-	34 015
Total	-	34 015	-	34 015

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	76 520	-	76 520
Total	-	76 520	-	76 520

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	19 443	2 068
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	62	1
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	4
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	19 505	2 073
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	4	-
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	-	-
	4	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	19 501	2 073

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	19 501	2 073	21,67	20,73	900 000	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	131	10
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(5)	(4)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	95	4
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>221</b>	<b>10</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(1)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>221</b>	<b>9</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	6	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Charge d'intérêts	-	1
Retenues d'impôts	10	-
Taxe de vente harmonisée	1	-
<b>Total des charges</b>	<b>21</b>	<b>2</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>200</b>	<b>7</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	200	7	0,73	0,11	273 077	69 231

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 073	-	2 073	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	200	7	200	7
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(30)	-	(30)	-
Profits nets réalisés	(16)	-	(16)	-
Remboursement de capital	(23)	-	(23)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(69)	-	(69)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	18 382	1 989	18 382	1 989
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 085)	(993)	(1 085)	(993)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	17 297	996	17 297	996
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	17 428	1 003	17 428	1 003
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	19 501	1 003	19 501	1 003

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

États financiers (non audités)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	200	7
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	5	4
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(95)	(4)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 300	5
Achat de placements et de dérivés	(1 306)	(1 010)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	4	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>114</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(69)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	16	1 004
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(4)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(53)</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	61	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>62</b>	<b>2</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	125	10
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(1)
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.

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	144 663	FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	6 225 539	6 282 714	
	181 427	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	3 969 328	3 927 894	
	137 702	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	3 442 240	3 595 399	
USD	29 545	iShares Core MSCI EAFE ETF	2 997 520	2 936 039	
USD	11 288	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	825 331	826 640	
	89 099	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	1 871 323	1 874 643	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>19 331 281</b>	<b>19 443 329</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(24 167)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>19 307 114</b>	<b>19 443 329</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		58 044	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>19 501 373</b>	<b>100,0</b>

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



# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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 totales du Canada CI	106 809	6 283	5,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI	126 660	3 595	2,8
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	3 928	2,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	159 407	1 875	1,2
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	2 936	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	826	-

au 31 décembre 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	89 811	356	0,4
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	378	0,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	143 190	208	0,1
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	7 003 863	710	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	300	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	116	-

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	3	-
Paielements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	850 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	(50 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	900 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	6 283
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	3 928
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	3 595

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	177
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	164

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	32,3
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	20,1
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	18,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	15,1
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	9,6
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	4,2
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	34,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	18,2
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	17,2
iShares Core MSCI EAFE ETF	14,5
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	10,0
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	5,6
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 1 944 000 \$ (207 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	3 770	-	3 770	19,3
<b>Total</b>	<b>3 770</b>	<b>-</b>	<b>3 770</b>	<b>19,3</b>

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

# FNB de répartition de l'actif équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	419	-	419	20,2
<b>Total</b>	<b>419</b>	<b>-</b>	<b>419</b>	<b>20,2</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 377 000 \$ (42 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	19 443	-	-	19 443
<b>Total</b>	<b>19 443</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>19 443</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 068	-	-	2 068
<b>Total</b>	<b>2 068</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 068</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	2 200	2 077
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	7	2
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	3
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	2 207	2 082
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
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	-	-
	-	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 207	2 082

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	2 207	2 082	22,07	20,82	100 000	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	28	11
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	5	(12)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	116	3
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>149</b>	<b>2</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(2)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>149</b>	<b>-</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Charge d'intérêts	-	1
Retenues d'impôts	1	-
<b>Total des charges</b>	<b>5</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>144</b>	<b>(1)</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	144	(1)	1,44	(0,02)	100 000	51 282

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



# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 082	-	2 082	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	144	(1)	144	(1)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(12)	(1)	(12)	(1)
Profits nets réalisés	(2)	-	(2)	-
Remboursement de capital	(5)	-	(5)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(19)	(1)	(19)	(1)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 988	-	2 988
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(1 981)	-	(1 981)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	1 007	-	1 007
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	125	1 005	125	1 005
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2 207	1 005	2 207	1 005

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	144	(1)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(5)	12
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(116)	(3)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	653	8
Achat de placements et de dérivés	(657)	(1 009)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	3	-
(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	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>24</b>	<b>(993)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(19)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 006
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(9)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(19)</b>	<b>996</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	5	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7</b>	<b>3</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	30	11
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(1)
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.

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	11 660	FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	496 567	506 394	
	24 612	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	505 608	532 849	
	18 878	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	407 848	492 905	
USD	4 032	iShares Core MSCI EAFE ETF	371 579	400 681	
USD	1 582	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	104 700	115 853	
	7 206	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	154 577	151 614	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>2 040 879</b>	<b>2 200 296</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(2 177)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>2 038 702</b>	<b>2 200 296</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		6 718	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>2 207 014</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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 totales du Canada CI	106 809	506	0,5
FNB Indice 1000 É.-U. CI	126 660	493	0,4
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	533	0,3
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	159 407	151	0,1
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	401	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	116	-

au 31 décembre 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	89 811	437	0,5
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	467	0,3
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	143 190	151	0,1
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	7 003 863	511	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	369	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	142	-

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	2	-
Paiements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	-	150 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	506
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	533
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	493

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	220
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	200

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	24,2
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	22,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	22,3
iShares Core MSCI EAFE ETF	18,2
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	6,9
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	5,2
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	24,6
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	22,4
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	21,0
iShares Core MSCI EAFE ETF	17,7
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	7,2
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	6,8
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 220 000 \$ (208 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	517	-	517	23,4
<b>Total</b>	<b>517</b>	<b>-</b>	<b>517</b>	<b>23,4</b>

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



# FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	515	-	515	24,7
<b>Total</b>	<b>515</b>	<b>-</b>	<b>515</b>	<b>24,7</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 52 000 \$ (52 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 200	-	-	2 200
<b>Total</b>	<b>2 200</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 200</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 077	-	-	2 077
<b>Total</b>	<b>2 077</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 077</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	5 262	2 060
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	15	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	6
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	5 277	2 066
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	2
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
	1	2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 276</b>	<b>2 064</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	5 276	2 064	21,11	20,64	250 000	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	34	6
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	24	(3)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>58</b>	<b>3</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(1)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>58</b>	<b>2</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Retenues d'impôts	2	-
<b>Total des charges</b>	<b>6</b>	<b>-</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>52</b>	<b>2</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	52	2	0,54	0,03	95 604	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 064	-	2 064	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	52	2	52	2
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(17)	(1)	(17)	(1)
Profits nets réalisés	(1)	-	(1)	-
Remboursement de capital	(3)	-	(3)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(21)	(1)	(21)	(1)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	5 255	999	5 255	999
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 074)	-	(2 074)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	3 181	999	3 181	999
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	3 212	1 000	3 212	1 000
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	5 276	1 000	5 276	1 000

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

États financiers (non audités)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	52	2
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(24)	3
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	635	-
Achat de placements et de dérivés	(637)	(1 003)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	6	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>35</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(20)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	6	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(18)</b>	<b>999</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	17	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(2)	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>15</b>	<b>1</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	38	6
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.

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	55 956	FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	2 404 996	2 430 169	
	33 601	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	732 810	727 462	
	25 771	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	637 538	672 881	
USD	5 516	iShares Core MSCI EAFE ETF	557 400	548 153	
USD	2 163	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	157 030	158 400	
	34 471	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	725 273	725 270	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>5 215 047</b>	<b>5 262 335</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(5 680)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>5 209 367</b>	<b>5 262 335</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		13 965	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>5 276 300</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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 totales du Canada CI	106 809	2 430	2,3
FNB Indice 1000 É.-U. CI	126 660	673	0,5
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	159 407	725	0,5
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	728	0,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	548	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	158	-

au 31 décembre 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	89 811	236	0,3
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	143 190	294	0,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	252	0,2
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	7 003 863	1 001	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	200	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	77	-

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	2	-
Paiements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	250 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	250 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	2 430
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	728
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	673

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	119
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	110

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

Fonds	Actif net (%)
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	46,0
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	13,8
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	13,7
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	12,8
iShares Core MSCI EAFE ETF	10,4
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3,0
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

Fonds	Actif net (%)
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	48,6
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	14,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	12,2
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	11,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	9,7
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	3,7
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 526 000 \$ (206 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	710	-	710	13,5
<b>Total</b>	<b>710</b>	<b>-</b>	<b>710</b>	<b>13,5</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	278	-	278	13,5
<b>Total</b>	<b>278</b>	<b>-</b>	<b>278</b>	<b>13,5</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 71 000 \$ (28 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	5 262	-	-	5 262
<b>Total</b>	<b>5 262</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5 262</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 060	-	-	2 060
<b>Total</b>	<b>2 060</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 060</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB indiciel biorévolution CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	5 669	5 156
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	6	9
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	5	131
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	5 681	5 296
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	12	8
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	2	2
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	3	2
	17	12
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 664</b>	<b>5 284</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	5 664	5 284	16,18	17,61	350 000	300 000

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

# FNB indiciel biorévolution CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	36	84
Intérêts aux fins des distributions	-	-
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	(27)	215
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(368)	(81)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(359)</b>	<b>218</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	1
Rabais sur frais	1	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(358)</b>	<b>219</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	10	10
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	6	6
Taxe de vente harmonisée	1	1
<b>Total des charges</b>	<b>20</b>	<b>20</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(378)</b>	<b>199</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	(378)	199	(1,19)	0,66	317 308	300 000

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

# FNB indiciel biorévolution CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	5 284	5 354	5 284	5 354
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(378)	199	(378)	199
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(14)	-	(14)	-
Profits nets réalisés	-	(65)	-	(65)
Remboursement de capital	(1)	(2)	(1)	(2)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(15)	(67)	(15)	(67)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	773	-	773	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	773	-	773	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	380	132	380	132
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	5 664	5 486	5 664	5 486

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

# FNB indiciel biorévolution CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(378)	199
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	27	(215)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	368	81
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 172	1 203
Achat de placements et de dérivés	(1 312)	(1 207)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(120)	63
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(14)	(66)
Produit de l'émission de parts rachetables	131	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	117	(66)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3)	(3)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	9	9
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	6	6
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	30	77
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.



# FNB indiciel biorévolution CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>E.-U.</b>					
USD	4 797	10X Genomics Inc., catégorie A	195 511	127 669	
USD	670	AbbVie Inc.	136 095	157 248	
USD	458	Agilent Technologies Inc.	81 529	81 240	
USD	302	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	73 204	100 418	
USD	166	Amgen Inc.	60 916	70 972	
USD	878	Axsome Therapeutics Inc.	86 230	96 714	
USD	4 804	Beam Therapeutics Inc.	224 450	154 018	
USD	227	Becton, Dickinson and Co.	72 737	72 594	
USD	506	Biogen Inc.	171 717	160 508	
USD	1 188	Bio-Techne Corp.	117 910	116 474	
USD	2 763	Bristol-Myers Squibb Co.	224 219	157 014	
USD	125	Eli Lilly and Co.	68 813	154 860	
USD	1 773	Exact Sciences Corp.	112 866	102 502	
USD	1 143	Gilead Sciences Inc.	107 326	107 308	
USD	169	GRAIL Inc.	4 302	3 554	
USD	2 382	Guardant Health Inc.	105 685	94 132	
USD	1 786	IDEAYA Biosciences Inc.	96 736	85 804	
USD	1 019	Illumina Inc.	215 126	145 542	
USD	969	Incyte Corp.	71 483	80 378	
USD	4 835	Intellia Therapeutics Inc.	258 842	148 065	
USD	7 229	Iovance Biotherapeutics Inc.	89 453	79 332	
USD	303	Johnson & Johnson	65 778	60 599	
USD	2 280	Legend Biotech Corp., CAAE	144 507	138 178	
USD	707	Merck & Co., Inc.	123 883	119 767	
USD	711	Moderna Inc.	114 191	115 532	
USD	743	Natera Inc.	54 641	110 097	
USD	41 702	Pacific Biosciences of California Inc.	174 991	78 176	
USD	3 773	Pfizer Inc.	199 374	144 455	
USD	1 928	PTC Therapeutics Inc.	62 836	80 676	
USD	6 052	Recursion Pharmaceuticals Inc., catégorie A	72 873	62 109	
USD	89	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	94 817	127 998	
EUR	781	Sanofi SA	94 866	103 014	
USD	615	Sarepta Therapeutics Inc.	85 466	132 963	
USD	8 174	Scilex Holding Co.	54 891	21 587	
USD	3 046	TG Therapeutics Inc.	39 272	74 149	
USD	193	Thermo Fisher Scientific Inc.	138 012	146 043	
USD	2 081	Twist Bioscience Corp.	72 040	140 327	
USD	1 565	Ultragenyx Pharmaceutical Inc.	84 969	88 014	
USD	2 566	Veracyte Inc.	71 690	76 087	
USD	277	Vertex Pharmaceuticals Inc.	116 331	177 659	
			4 440 578	4 293 776	75,8
<b>SUISSE</b>					
USD	2 285	CRISPR Therapeutics AG	169 602	168 872	
CHF	179	Lonza Group AG, enregistré	118 818	133 670	
CHF	1 066	Novartis AG, actions nominatives	126 231	156 109	
CHF	186	Roche Holding AG	78 076	70 667	
			492 727	529 318	9,3
<b>R.-U.</b>					
GBP	559	AstraZeneca PLC	95 502	119 472	
USD	1 293	Immunocore Holdings PLC, ADR	77 641	59 961	
			173 143	179 433	3,2

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ALLEMAGNE</b>					
USD	1 380	BioNTech SE, CAAE	219 408	151 746	2,7
<b>PAYS-BAS</b>					
USD	2 328	QIAGEN NV	140 541	130 893	2,3
<b>DANEMARK</b>					
DKK	306	Genmab AS	139 752	105 007	1,9
<b>CORÉE DU SUD</b>					
KRW	142	Samsung Biologics Co., Ltd.	115 782	102 623	1,8
<b>CHINE</b>					
HKD	63 800	Genscript Biotech Corp.	146 461	93 033	1,6
<b>IRLANDE</b>					
USD	570	Jazz Pharmaceuticals PLC	96 812	83 245	1,5
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>5 965 204</b>	<b>5 669 074</b>	<b>100,1</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(5 942)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>5 959 262</b>	<b>5 669 074</b>	<b>100,1</b>
Contrat(s) de change à terme				(7 339)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>5 959 262</b>	<b>5 661 735</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				2 707	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>5 664 442</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 738	CHF	1 141	1,52	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	361 968	CHF	238 593	1,52	(1 351)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	113 292	DKK	569 514	0,20	1 295
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	98 038	EUR	66 099	1,48	1 101
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	136 742	GBP	78 546	1,74	879
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	2 257	GBP	1 297	1,74	13
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	113 612	HKD	649 505	0,17	(222)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	200 769	USD	147 384	1,36	(904)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	4 563 516	USD	3 341 009	1,37	(8 154)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CHF	239 734	CAD	366 034	0,65	(978)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	DKK	566 035	CAD	111 271	5,09	41
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	DKK	3 479	CAD	692	5,03	(8)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	64 032	CAD	93 914	0,68	(9)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	2 067	CAD	3 064	0,67	(32)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	GBP	79 843	CAD	138 201	0,58	(94)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	80 416	CAD	14 024	5,73	70
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	569 090	CAD	99 774	5,70	(34)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	3 488 393	CAD	4 774 342	0,73	(999)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	363 706	CHF	237 522	1,53	925
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	112 600	DKK	572 237	0,20	(52)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	94 973	EUR	64 709	1,47	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	138 998	GBP	80 347	1,73	93
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	99 588	HKD	567 931	0,18	25
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	4 764 285	USD	3 483 477	1,37	1 050
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(7 339)</b>

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

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	5	(5)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	5	(5)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(12)	5	-	(7)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(12)	5	-	(7)

au 31 décembre 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	131	(8)	-	123
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	131	(8)	-	123
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(8)	8	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(8)	8	-	-

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	2	2
Paielements indirects†	1	1

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	300 000	300 000
Parts rachetables émises	50 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	350 000	300 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,400

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	680	90
Garanties (hors trésorerie)	718	95

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	2
Charges	-	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	-	1
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	40,5

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
É.-U.	76,9
Suisse	6,8
Chine	2,6
Allemagne	2,6
Contrat(s) de change à terme	2,3
Pays-Bas	2,1
Danemark	2,0
R.-U.	1,9
Corée du Sud	1,6
Irlande	1,1
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition directe du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	2,5
<b>Total</b>	<b>2,5</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

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

Indice de référence	Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2024 (\$)
Indice Solactive de rendement total net de la génomique, de l'immunologie et de la révolution médicale (couvert en \$ CA)	566 746

Indice de référence	Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 31 décembre 2023 (\$)
Indice Solactive de rendement total net de la génomique, de l'immunologie et de la révolution médicale (couvert en \$ CA)	513 541

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Won coréen	103	-	103	1,8
Dollar américain	4 790	(4 763)	27	0,5
Euro	103	(95)	8	0,1
Franc suisse	362	(363)	(1)	0,0
Dollar de Hong Kong	93	(100)	(7)	(0,1)
Couronne danoise	105	(113)	(8)	(0,1)
Livre sterling	120	(139)	(19)	(0,3)
<b>Total</b>	<b>5 676</b>	<b>(5 573)</b>	<b>103</b>	<b>1,9</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	4 375	(3 998)	377	7,1
Won coréen	85	-	85	1,6
Franc suisse	276	(260)	16	0,3
Euro	81	(76)	5	0,1
Livre sterling	101	(97)	4	0,1
Couronne danoise	107	(106)	1	0,0
Dollar de Hong Kong	137	(149)	(12)	(0,2)
<b>Total</b>	<b>5 162</b>	<b>(4 686)</b>	<b>476</b>	<b>9,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 10 000 \$ (48 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	5 669	-	-	5 669
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(7)	-	(7)
<b>Total</b>	<b>5 669</b>	<b>(7)</b>	<b>-</b>	<b>5 662</b>

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

# FNB indiciel biorévolution CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	5 156	-	-	5 156
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	123	-	123
<b>Total</b>	<b>5 156</b>	<b>123</b>	<b>-</b>	<b>5 279</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.



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

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	184 014	187 706
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	172	67
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription d'actions	-	-
Dividendes à recevoir	732	772
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	184 918	188 545
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	350	813
Frais de gestion à payer	101	99
Frais d'administration à payer	12	13
Dividendes à payer aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat d'actions	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	38	41
	501	966
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	184 417	187 579

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre d'actions rachetables en circulation :	
	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Actions FNB	184 417	187 579	10,38	10,74	17 771 193	17 471 193

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

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

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 291	4 052
Intérêts aux fins des distributions	28	22
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	1 773	1 419
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 955	(3 078)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(6 425)	830
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 622</b>	<b>3 245</b>
Autres revenus		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	11	16
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	6	25
<b>Total des autres revenus</b>	<b>17</b>	<b>41</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 639</b>	<b>3 286</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	615	558
Frais d'administration (note 5)	79	72
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	77	70
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	73	67
<b>Total des charges</b>	<b>845</b>	<b>768</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	<b>794</b>	<b>2 518</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre moyen pondéré d'actions :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Actions FNB	794	2 518	0,04	0,16	17 659 929	15 699 094

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

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

États financiers (non audité)

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

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

	Actions		Total du	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	187 579	168 263	187 579	168 263
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	794	2 518	794	2 518
<b>Dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>				
Revenu net de placement	(4 849)	(4 658)	(4 849)	(4 658)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(2 379)	(2 125)	(2 379)	(2 125)
<b>Total des dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>	(7 228)	(6 783)	(7 228)	(6 783)
<b>Transactions sur actions rachetables</b>				
Produit de l'émission d'actions rachetables	11 829	11 446	11 829	11 446
Réinvestissement des dividendes aux porteurs d'actions rachetables	-	-	-	-
Rachat d'actions rachetables	(8 557)	(5 602)	(8 557)	(5 602)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur actions rachetables</b>	3 272	5 844	3 272	5 844
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	(3 162)	1 579	(3 162)	1 579
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	184 417	169 842	184 417	169 842

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

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

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	794	2 518
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 955)	3 078
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	6 425	(830)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	77	70
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	45 303	25 303
Achat de placements et de dérivés	(43 383)	(23 171)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	40	8
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	(5)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(3)	(20)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>7 300</b>	<b>6 950</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Dividendes versés aux porteurs d'actions rachetables, déduction faite des dividendes réinvestis	(7 228)	(6 782)
Produit de l'émission d'actions rachetables	69	49
Montant versé au rachat d'actions rachetables	(36)	(24)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(7 195)</b>	<b>(6 757)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	105	193
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	67	168
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>172</b>	<b>361</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	28	22
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 331	4 060
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.

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ACTIONS ORDINAIRES</b>				
264 330	Banque de Montréal	31 622 614	30 353 014	
489 889	Banque de Nouvelle-Écosse (La)	33 638 502	30 657 254	
466 634	Banque Canadienne Impériale de Commerce	27 397 174	30 354 542	
283 797	Banque Nationale du Canada	24 818 637	30 794 812	
213 944	Banque Royale du Canada	24 157 171	31 160 943	
408 164	Banque Toronto-Dominion (La)	34 088 412	30 693 933	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>175 722 510</b>	<b>184 014 498</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(127 393)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>		<b>175 595 117</b>	<b>184 014 498</b>	<b>99,8</b>
Position(s) vendeur sur option(s)			(350 249)	(0,2)
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>175 595 117</b>	<b>183 664 249</b>	<b>99,6</b>
Autres actifs (passifs) nets			752 567	0,4
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>			<b>184 416 816</b>	<b>100,0</b>

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

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Date d'expiration	Taille du lot par contrat	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste du contrat (\$)
(660)	Banque de Montréal, (option d'achat) – 117,00 Banque Nationale du Canada, (option d'achat) –	19 juillet 2024	100	117,00	CAD	(68 805)	(54 450)
(709)	109,00	19 juillet 2024	100	109,00	CAD	(52 466)	(92 879)
(534)	Banque Royale du Canada, (option d'achat) – 143,00	19 juillet 2024	100	143,00	CAD	(85 573)	(202 920)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(206 844)</b>	<b>(350 249)</b>

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	77	68
Paiements indirects†	29	24

## Transactions sur actions rachetables (note 4)

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

	Actions FNB	
	2024	2023
<b>Nombre d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	17 471 193	15 521 193
Actions rachetables émises	1 100 000	1 050 000
Actions rachetables émises aux fins du réinvestissement des dividendes	-	-
Actions rachetables rachetées	(800 000)	(500 000)
<b>Nombre d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	17 771 193	16 071 193

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	26 229	-
Garanties (hors trésorerie)	27 596	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	16	23
Charges	(5)	(7)
Revenu tiré des prêts de titres	11	16
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>31,2</b>	<b>30,7</b>

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions ordinaires	100,1
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,4</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,4)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,4)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des options.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements du fonds sous-jacent avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 18 401 000 \$ (18 771 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des options.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	184 014	-	-	184 014
<b>Total</b>	<b>184 014</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>184 014</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(350)	-	-	(350)
<b>Total</b>	<b>(350)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(350)</b>

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



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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	187 706	-	-	187 706
<b>Total</b>	<b>187 706</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>187 706</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(813)	-	-	(813)
<b>Total</b>	<b>(813)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(813)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	46 504	47 849
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 516	2 667
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	111
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	1
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	433	455
Rabais sur frais à recevoir	1	1
	49 454	51 084
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	27	29
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	27	28
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	82
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	7	7
	61	146
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	49 393	50 938

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	49 393	50 938	9,69	9,52	5 097 245	5 347 245

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	1 293	1 495
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	1 006	308
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(35)	593
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2 264</b>	<b>2 396</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(3)	(5)
Rabais sur frais	3	5
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>2 264</b>	<b>2 396</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	162	191
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	15	18
<b>Total des charges</b>	<b>187</b>	<b>215</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 077</b>	<b>2 181</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	2 077	2 181	0,40	0,36	5 150 816	6 081 499

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 938	59 463	50 938	59 463
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 077	2 181	2 077	2 181
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1 108)	(1 249)	(1 108)	(1 249)
Profits nets réalisés	(52)	-	(52)	-
Remboursement de capital	(77)	(213)	(77)	(213)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 237)	(1 462)	(1 237)	(1 462)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	1 467	481	1 467	481
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 852)	(1 462)	(3 852)	(1 462)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(2 385)	(981)	(2 385)	(981)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 545)	(262)	(1 545)	(262)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	49 393	59 201	49 393	59 201

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 077	2 181
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 006)	(308)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	35	(593)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	5
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	6 569	2 358
Achat de placements et de dérivés	(6 435)	(4 228)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	22	(13)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(2)	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 268</b>	<b>(599)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 237)	(1 462)
Produit de l'émission de parts rachetables	120	28
Montant versé au rachat de parts rachetables	(303)	(87)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 420)</b>	<b>(1 521)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(152)	(2 120)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 667	2 682
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>2 516</b>	<b>562</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 314	1 483
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>			
	1 850 000	Advantage Energy Ltd., convertibles, 5 %, 30 juin 2029	1 863 813	1 887 000	
	1 442 000	AG Growth International Inc., convertibles, 5 %, 30 juin 2027	1 481 939	1 846 048	
	1 417 000	AG Growth International Inc., convertibles, 5,2 %, 31 décembre 2027	1 363 242	1 459 510	
USD	648 000	American Hotel Income Properties REIT LP, convertibles, 6 %, 31 décembre 2026	815 504	679 056	
USD	793 000	Argonaut Gold Inc., convertibles, 4,63 %, 30 novembre 2025	1 086 307	1 063 275	
USD	544 000	BSR REIT, convertibles, 5 %, 30 septembre 2025	711 096	718 172	
	1 361 000	Chemtrade Logistics Income Fund, convertibles, 6,25 %, 31 août 2027	1 356 595	1 415 440	
	1 363 000	Chemtrade Logistics Income Fund, convertibles, 7 %, 30 juin 2028	1 360 902	1 369 815	
	928 000	Chemtrade Logistics Income Fund, convertibles, 8,5 %, 30 septembre 2025	1 110 694	1 208 720	
	670 000	Chorus Aviation Inc., convertibles, 6 %, 30 juin 2026	684 369	649 900	
	2 390 000	Cineplex Inc., convertibles, 5,75 %, 30 septembre 2025	2 568 297	2 593 149	
USD	451 861	Cricket Media Inc., coupon détaché, 21 septembre 2025	75 568	77 271	
	1 020 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,25 %, 15 janvier 2029	1 014 117	999 600	
	1 123 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,35 %, 30 juin 2025	1 158 238	1 129 738	
	1 422 000	Exchange Income Corp., convertibles, 5,75 %, 31 mars 2026	1 414 707	1 422 000	
	1 664 000	Extencicare Inc., convertibles, 5 %, 30 avril 2025	1 606 856	1 643 200	
	1 037 610	GASFRAC Energy Services Inc., convertibles	-	-	
	1 837 000	Innergex Renewable Energy Inc., convertibles, 4,65 %, 31 octobre 2026	1 909 522	1 754 335	
	1 914 000	Innergex Renewable Energy Inc., convertibles, 4,75 %, 30 juin 2025	1 941 485	1 886 247	
	726 000	Morguard North American Residential REIT, convertibles, 6 %, 31 mars 2028	713 756	707 923	
	1 266 000	Morguard FPI, convertibles, 5,25 %, 31 décembre 2026	1 152 936	1 202 700	
	1 523 000	Mullen Group Ltd., convertibles, 5,75 %, 30 novembre 2026	1 590 019	1 625 803	
	3 793 000	NFI Group Inc., convertibles, 5 %, 15 janvier 2027	3 600 141	3 527 489	
	712 000	North American Construction Group Ltd., convertibles, 5 %, 31 mars 2026	703 189	826 632	
	973 000	North American Construction Group Ltd., convertibles, 5,5 %, 30 juin 2028	1 010 606	1 118 950	
	1 635 000	FPI NorthWest Healthcare Properties, convertibles, 5,5 %, 31 mars 2025	1 702 407	1 638 270	
	1 383 000	FPI NorthWest Healthcare Properties, convertibles, 6,25 %, 31 août 2027	1 350 417	1 123 688	
	1 897 000	Premium Brands Holdings Corp., convertibles, 4,2 %, 30 septembre 2027	2 088 706	1 783 939	
	2 170 000	Premium Brands Holdings Corp., convertibles, 4,65 %, 30 avril 2025	2 208 044	2 166 745	
	748 000	Quarterhill Inc., convertibles, 6 %, 30 octobre 2026	743 002	667 665	
	458 000	Slate Office REIT, convertibles, 5,5 %, 31 décembre 2026	436 930	54 960	
	1 912 000	StorageVault Canada Inc., convertibles, 5 %, 31 mars 2028	1 852 395	1 754 260	
	650 000	Surge Energy Inc., série DEB, convertibles, 8,5 %, 31 décembre 2028	663 813	662 220	
	963 000	Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd., convertibles, 5,5 %, 30 septembre 2024	959 435	962 904	
	1 000 000	Tidewater Midstream and Infrastructure Ltd., convertibles, 8 %, 30 juin 2029	1 000 000	1 010 200	
	848 000	WELL Health Technologies Corp., convertibles, 5,5 %, 31 décembre 2026	839 751	789 742	
	1 117 000	WildBrain Ltd., convertibles, 5,88 %, 30 septembre 2024	1 116 701	1 077 905	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>47 255 499</b>	<b>46 504 471</b>	<b>94,2</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(39 610)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>47 215 889</b>	<b>46 504 471</b>	<b>94,2</b>
		Contrat(s) de change à terme		(27 005)	(0,1)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>47 215 889</b>	<b>46 477 466</b>	<b>94,1</b>
		Autres actifs (passifs) nets		2 915 764	5,9
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>49 393 230</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	385 498	USD	284 131	1,36	(3 079)
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	USD	38 768	CAD	53 157	0,73	(138)
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	5 881	USD	4 329	1,36	(35)
Banque de Montréal	A-1	17 septembre 2024	CAD	54 852	USD	40 350	1,36	(247)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	17 septembre 2024	CAD	45 152	USD	33 036	1,37	40
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	385 527	USD	284 131	1,36	(3 049)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	382 571	USD	284 131	1,35	(6 006)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	192 502	USD	142 065	1,36	(1 786)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 juillet 2024	CAD	153 860	USD	113 653	1,35	(1 572)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	17 septembre 2024	CAD	54 844	USD	40 350	1,36	(255)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	192 530	USD	142 065	1,36	(1 758)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	279 498	USD	206 361	1,35	(2 721)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 septembre 2024	CAD	45 170	USD	33 035	1,37	59
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 juillet 2024	CAD	382 444	USD	284 131	1,35	(6 132)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 septembre 2024	USD	64 700	CAD	88 676	0,73	(326)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(27 005)</b>

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(27)	-	-	(27)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(27)	-	-	(27)

au 31 décembre 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	111	(19)	-	92
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	111	(19)	-	92
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(29)	19	-	(10)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(29)	19	-	(10)

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



# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	8	5
Paielements indirects†	3	2

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	5 347 245	6 197 245
Parts rachetables émises	150 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(400 000)	(150 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>5 097 245</b>	<b>6 097 245</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	193
Garanties (hors trésorerie)	-	203

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations de sociétés	93,9
Autres actifs (passifs) nets	5,9
Contrat(s) de change à terme	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

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

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
BBB/Baa/B++	7,4
BB/Ba/B+	5,2
B	6,2
Aucune	75,4
<b>Total</b>	<b>94,2</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AA/Aa/A+	0,2
BBB/Baa/B++	13,3
B	4,3
Aucune	76,4
<b>Total</b>	<b>94,2</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	2 734	(2 446)	288	0,6
<b>Total</b>	<b>2 734</b>	<b>(2 446)</b>	<b>288</b>	<b>0,6</b>

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	2 462	(2 281)	181	0,4
<b>Total</b>	<b>2 462</b>	<b>(2 281)</b>	<b>181</b>	<b>0,4</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 29 000 \$ (18 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	10 505	18 114	15 292	2 593	46 504

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	7 810	23 919	15 140	980	47 849

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 280 000 \$ (266 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	46 427	77	46 504
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(27)	-	(27)
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>46 400</b>	<b>77</b>	<b>46 477</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	47 774	75	47 849
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	82	-	82
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>47 856</b>	<b>75</b>	<b>47 931</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB d'obligations convertibles canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Niveau 3 - Rapprochement

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

pour la période close le 30 juin 2024

	Solde au 31 décembre 2023 (en k\$)	Achats (en k\$)	Ventes (en k\$)	Transferts entrants (en k\$)	Transferts (sortants) (en k\$)	Profit (perte) latent(e) (en k\$)	Profit (perte) latent(e)* (en k\$)	Solde au 30 juin 2024 (en k\$)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Obligations	75	-	-	-	-	-	2	77
<b>Total</b>	<b>75</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2</b>	<b>77</b>

\*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 30 juin 2024 s'est établie à 2 429 \$.

pour l'exercice clos le 31 décembre 2023

	Solde au 31 décembre 2022 (en k\$)	Achats (en k\$)	Ventes (en k\$)	Transferts entrants (en k\$)	Transferts (sortants) (en k\$)	Profit (perte) latent(e) (en k\$)	Profit (perte) latent(e)** (en k\$)	Solde au 31 décembre 2023 (en k\$)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Obligations	76	-	-	-	-	-	(1)	75
<b>Total</b>	<b>76</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1)</b>	<b>75</b>

\*\*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 décembre 2023 s'est établie à (1 635 \$).

Les placements classés au niveau 3 sont évalués à la juste valeur selon des hypothèses et des données non observables, qui peuvent comprendre des écarts de taux, des multiples sectoriels et des taux d'actualisation. Selon la direction, le fait de remplacer ces données par d'autres raisonnablement possibles n'aurait pas une incidence importante sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	176 700	154 184
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	261	280
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	446	391
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	177 407	154 855
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	7	6
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	4	70
	11	76
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	177 396	154 779

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	177 396	154 779	21,66	20,66	8 190 000	7 489 999

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 615	2 493
Intérêts aux fins des distributions	7	8
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	1 026	235
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	5 944	4 745
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>9 592</b>	<b>7 481</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	23	21
Profit (perte) de change sur la trésorerie	1	(2)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	65	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>89</b>	<b>19</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>9 681</b>	<b>7 500</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	41	36
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	22
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	2	5
<b>Total des charges</b>	<b>50</b>	<b>64</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>9 631</b>	<b>7 436</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	9 631	7 436	1,26	1,03	7 673 516	7 253 811

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	154 779	134 701	154 779	134 701
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 631	7 436	9 631	7 436
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1 748)	(2 092)	(1 748)	(2 092)
Profits nets réalisés	(519)	-	(519)	-
Remboursement de capital	-	(41)	-	(41)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 267)	(2 133)	(2 267)	(2 133)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	28 059	14 923	28 059	14 923
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(12 806)	(9 036)	(12 806)	(9 036)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	15 253	5 887	15 253	5 887
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	22 617	11 190	22 617	11 190
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	177 396	145 891	177 396	145 891

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



# FNB Indice d'actions canadiennes CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 631	7 436
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 026)	(235)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(5 944)	(4 745)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	22
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 079	5 972
Achat de placements et de dérivés	(4 545)	(6 158)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(55)	(81)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(66)	13
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>2 081</b>	<b>2 224</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 268)	(2 133)
Produit de l'émission de parts rachetables	291	86
Montant versé au rachat de parts rachetables	(123)	(42)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2 100)</b>	<b>(2 089)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(19)	135
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	280	286
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>261</b>	<b>421</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	7	8
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 559	2 412
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.

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
40 904	Banque de Montréal	5 174 252	4 697 006	
68 564	Banque de Nouvelle-Écosse (La)	4 874 400	4 290 736	
19 631	Brookfield Asset Management Ltd., catégorie A	744 678	1 022 382	
86 781	Brookfield Corp., catégorie A	4 674 967	4 937 839	
4 696	Groupe Canaccord Genuity Inc.	43 488	39 728	
52 270	Banque Canadienne Impériale de Commerce	3 408 791	3 400 163	
5 390	Banque Canadienne de l'Ouest	157 556	233 818	
7 581	CI Financial Corp.	132 705	109 167	
4 535	Definity Financial Corp.	163 316	203 985	
21 793	Element Fleet Management Corp.	397 667	542 428	
1 492	EQB Inc.	104 359	139 114	
1 301	Fairfax Financial Holdings Ltd.	1 152 131	2 024 786	
4 544	Corporation Fiera Capital	37 372	35 625	
959	First National Financial Corp.	37 932	34 131	
711	goeasy Ltd.	103 009	140 153	
15 343	Great-West Lifeco Inc.	565 398	612 339	
5 513	iA Société financière inc.	434 049	473 622	
5 018	Société financière IGM Inc.	201 665	189 530	
9 807	Intact Corporation financière	1 908 382	2 236 094	
2 429	Banque Laurentienne du Canada	85 696	64 490	
101 342	Société Financière Manuvie	2 649 036	3 691 889	
18 859	Banque Nationale du Canada	1 876 861	2 046 390	
3 474	Nuvei Corp.	217 939	153 932	
3 523	Onex Corp.	283 697	327 710	
28 996	Power Corporation du Canada	1 081 509	1 102 427	
79 372	Banque Royale du Canada	10 473 055	11 560 530	
1 179	Sprott Inc.	56 783	66 885	
32 882	Financière Sun Life inc.	2 149 282	2 205 725	
14 853	Groupe TMX Limitée	431 584	565 602	
98 933	Banque Toronto-Dominion (La)	8 444 957	7 439 760	
2 629	Trisura Group Ltd.	107 225	108 788	
		52 173 741	54 696 774	30,8
<b>ÉNERGIE</b>				
8 708	Advantage Energy Ltd.	78 207	90 389	
33 437	ARC Resources Ltd.	566 194	816 197	
31 028	Athabasca Oil Corp.	83 260	160 725	
40 052	Baytex Energy Corp.	196 223	189 846	
14 615	Birchcliff Energy Ltd.	113 337	87 836	
24 214	Cameco Corp.	922 591	1 629 844	
117 666	Canadian Natural Resources Ltd.	4 241 512	5 733 864	
8 196	Cardinal Energy Ltd.	52 667	54 913	
74 043	Cenovus Energy Inc.	1 626 716	1 991 017	
13 167	CES Energy Solutions Corp.	76 403	101 386	
7 779	Crew Energy Inc.	38 979	33 372	
48 798	Denison Mines Corp.	91 129	133 706	
119 085	Enbridge Inc.	6 082 621	5 795 866	
6 881	Enerflex Ltd.	55 271	50 782	
8 848	Energy Fuels Inc.	75 030	73 350	
34 878	Fission Uranium Corp.	40 906	41 854	
7 021	Freehold Royalties Ltd.	96 191	95 626	
9 025	Gibson Energy Inc.	205 379	209 831	
12 165	Headwater Exploration Inc.	76 215	88 197	

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ÉNERGIE (suite)</b>				
9 138	Imperial Oil Ltd.	604 928	852 393	
4 538	International Petroleum Corp. de Suède	77 837	82 138	
8 785	Kelt Exploration Ltd.	45 208	55 960	
12 809	Keyera Corp.	401 761	485 333	
3 873	Mattr Corp.	44 002	64 756	
15 176	MEG Energy Corp.	287 180	444 201	
25 586	NexGen Energy Ltd.	178 771	244 091	
1 380	North American Construction Group Ltd.	45 275	36 404	
9 074	NuVista Energy Ltd.	93 660	129 032	
4 044	Obsidian Energy Ltd.	35 318	41 410	
4 282	Paramount Resources Ltd., catégorie A	115 141	133 085	
5 739	Parex Resources Inc.	120 942	125 799	
7 790	Corporation Parkland	264 498	298 747	
4 458	Pason Systems Inc.	58 855	82 161	
32 499	Pembina Pipeline Corp.	1 456 996	1 649 650	
10 600	Peyto Exploration & Development Corp.	129 429	154 548	
13 238	PrairieSky Royalty Ltd.	271 796	344 188	
805	Precision Drilling Corp.	64 436	77 441	
12 526	Secure Energy Services Inc.	88 355	151 690	
73 435	Suncor Énergie Inc.	2 941 712	3 829 635	
5 364	Surge Energy Inc.	43 073	37 709	
28 848	Tamarack Valley Energy Ltd.	112 479	107 604	
58 202	Corporation TC Énergie	3 387 035	3 018 356	
5 180	Topaz Energy Corp.	107 095	124 320	
18 652	Tourmaline Oil Corp.	1 155 539	1 157 356	
11 509	Trican Well Service Ltd.	41 757	55 474	
4 571	Valeura Energy Inc.	19 544	19 655	
34 865	Veren Inc.	306 220	376 194	
8 836	Vermilion Energy Inc.	163 495	133 070	
33 164	Whitecap Resources Inc.	299 873	331 972	
		<b>27 681 041</b>	<b>32 022 973</b>	<b>18,0</b>
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
950	ADENTRA Inc.	39 695	35 407	
3 394	Groupe Aecon Inc.	47 488	57 630	
1 053	AG Growth International Inc.	43 946	55 304	
20 085	Air Canada	412 875	359 521	
9 816	AtkinsRealis Group Inc.	329 855	581 304	
5 514	ATS Corp.	262 998	244 105	
1 924	Badger Infrastructure Solutions Ltd.	64 310	79 250	
13 553	Ballard Power Systems Inc.	135 416	41 879	
2 891	Bird Construction Inc.	46 252	77 537	
4 820	Bombardier Inc., catégorie B	247 803	422 859	
1 197	Boyd Group Services Inc.	277 008	307 593	
17 829	CAE Inc.	545 935	453 035	
32 561	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	5 176 626	5 263 811	
52 231	Canadian Pacific Kansas City Ltd.	5 382 669	5 627 368	
939	Cargojet Inc.	133 020	131 460	
3 902	Doman Building Materials Group Ltd.	25 927	27 002	
2 443	Exchange Income Corp.	114 986	110 473	
7 953	Finning International Inc.	280 708	318 995	
9 274	GFL Environmental Inc.	392 267	494 118	
498	Hammond Power Solutions Inc.	39 984	55 522	
5 512	MDA Space Ltd.	66 713	75 294	

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>				
4 655	Mullen Group Ltd.	66 408	61 167	
4 879	NFI Group Inc.	75 492	77 284	
10 169	RB Global Inc.	823 961	1 061 034	
2 884	Quincaillerie Richelieu Ltée	116 295	118 792	
3 378	Métaux Russel Inc.	114 501	125 898	
3 166	Savaria Corp.	41 469	56 956	
6 384	Stantec Inc.	490 782	731 160	
4 033	TELUS International (CDA) Inc.	104 089	31 860	
4 307	TFI International Inc.	646 445	855 542	
7 950	Thomson Reuters Corp.	1 315 612	1 832 350	
4 609	Industries Toromont Limitée	498 677	558 288	
14 404	Waste Connections Inc.	2 688 795	3 457 392	
1 989	Westshore Terminals Investment Corp.	50 169	45 170	
6 960	WSP Global Inc.	1 199 107	1 482 689	
		22 298 283	25 316 049	14,3
<b>MATÉRIAUX</b>				
27 718	Mines Agnico Eagle Limitée	1 926 974	2 480 207	
22 115	Alamos Gold Inc., catégorie A	303 177	474 588	
2 143	Altius Minerals Corp.	42 056	45 411	
50 946	Argonaut Gold Inc.	35 335	21 907	
7 263	Aris Mining Corp.	40 752	37 550	
5 968	Aya Gold & Silver Inc.	57 499	81 045	
71 987	B2Gold Corp.	331 776	264 192	
97 835	Société aurifère Barrick	2 215 832	2 232 594	
32 984	Calibre Mining Corp.	60 577	59 371	
3 151	Canfor Corp.	70 662	45 721	
26 897	Capstone Copper Corp.	167 843	260 901	
4 355	Cascades Inc.	48 701	39 325	
8 105	CCL Industries Inc., catégorie B	532 127	583 074	
12 232	Centerra Gold Inc.	102 887	112 534	
6 475	Chemtrade Logistics Income Fund	53 920	59 829	
10 176	Dundee Precious Metals Inc.	79 457	108 985	
10 950	Eldorado Gold Corp.	135 243	221 299	
11 155	Endeavour Silver Corp.	42 786	53 656	
16 673	Equinox Gold Corp.	105 116	119 045	
5 014	ERO Copper Corp.	107 174	146 610	
4 975	Filo Corp.	93 937	124 773	
15 873	First Majestic Silver Corp.	176 371	128 571	
37 766	First Quantum Minerals Ltd.	937 316	678 655	
10 430	Foran Mining Corp.	45 526	40 886	
16 997	Fortuna Silver Mines Inc.	85 918	113 710	
10 682	Franco-Nevada Corp.	1 941 824	1 732 620	
9 967	Global Atomic Corp.	22 390	20 532	
18 680	Hudbay Minerals Inc.	140 382	231 259	
13 030	i-80 Gold Corp.	21 993	18 763	
27 798	IAMGOLD Corp.	90 425	142 881	
2 861	Interfor Corp.	69 581	47 264	
32 158	Ivanhoe Mines Ltd., catégorie A	376 485	567 589	
12 468	K92 Mining Inc.	88 874	97 873	
9 636	Karora Resources Inc.	40 150	57 430	
68 186	Kinross Gold Corp.	463 572	776 639	
3 587	Labrador Iron Ore Royalty Corp.	122 847	104 382	
6 819	Lithium Americas (Argentina) Corp.	64 702	29 731	

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>MATÉRIAUX (suite)</b>				
6 818	Lithium Americas Corp.	37 299	24 818	
8 991	Lundin Gold Inc.	134 619	181 708	
36 742	Lundin Mining Corp.	367 504	559 580	
5 200	MAG Silver Corp.	98 675	83 096	
4 171	Major Drilling Group International Inc.	36 341	37 873	
3 738	Methanex Corp.	200 848	246 895	
36 161	New Gold Inc.	57 690	97 635	
6 845	NGEx Minerals Ltd.	66 539	55 445	
27 826	Nutrien Ltd.	2 522 453	1 938 081	
39 541	OceanaGold Corp.	97 449	124 158	
11 196	Orla Mining Ltd.	57 809	58 779	
10 333	Redevances aurifères Osisko Ltée	178 853	220 300	
20 695	Osisko Mining Inc.	64 023	59 188	
20 378	Pan American Silver Corp.	502 261	554 077	
13 732	Sandstorm Gold Ltd.	100 087	102 166	
9 497	Silvercorp Metals Inc.	42 824	43 496	
7 893	SilverCrest Metals Inc.	69 392	88 243	
4 162	Skeena Resources Ltd.	27 922	30 550	
11 375	SSR Mining Inc.	203 172	70 298	
1 837	Stelco Holdings Inc.	79 124	68 281	
3 202	Stella-Jones Inc.	175 188	285 843	
25 696	Ressources Teck Limitée, catégorie B	1 176 391	1 684 630	
4 799	Torex Gold Resources Inc.	69 177	101 739	
4 081	Transcontinental Inc., catégorie A	70 857	61 705	
3 502	Triple Flag Precious Metals Corp.	77 628	74 312	
3 616	Victoria Gold Corp.	31 534	3 833	
8 244	Wesdome Gold Mines Ltd.	80 216	90 849	
2 969	West Fraser Timber Co., Ltd.	308 431	311 953	
25 379	Wheaton Precious Metals Corp.	1 427 553	1 820 436	
1 722	Winpak Ltd.	73 259	76 888	
		19 677 305	21 518 257	12,1
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
19 154	Bitfarms Ltd.	45 418	67 614	
32 134	BlackBerry Ltd.	245 717	109 899	
6 588	Celestica Inc.	180 214	516 104	
11 606	CGI inc.	1 416 835	1 584 800	
1 116	Constellation Software Inc.	2 766 961	4 399 138	
1 048	Constellation Software Inc., bons de souscription, 31 mars 2040	-	-	
10 828	Converge Technology Solutions Corp.	67 399	46 560	
4 759	Descartes Systems Group Inc. (The)	476 852	630 805	
867	Docebo Inc.	51 612	45 804	
2 787	Dye & Durham Ltd.	56 687	34 336	
2 417	Enghouse Systems Ltd.	93 449	72 921	
1 564	Kinaxis Inc.	254 489	246 736	
7 552	Lightspeed Commerce Inc.	355 652	141 223	
14 946	Open Text Corp.	757 568	613 982	
64 785	Shopify Inc., catégorie A	6 152 995	5 857 211	
		12 921 848	14 367 133	8,1
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
40 969	Alimentation Couche-Tard Inc.	2 564 370	3 145 191	
8 035	Empire Co., Ltd., catégorie A	298 234	280 983	
3 144	George Weston Limitée	500 509	618 708	
2 323	Jamieson Wellness Inc.	75 530	67 390	

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)</b>				
7 896	Les Compagnies Loblaw limitée	912 263	1 253 095	
4 039	Aliments Maple Leaf Inc.	103 544	92 574	
12 826	Metro inc.	918 065	972 082	
2 663	North West Co., Inc. (The)	96 842	110 355	
2 458	Premium Brands Holdings Corp.	247 934	231 618	
8 656	Primo Water Corp.	181 196	258 814	
13 696	Saputo inc.	441 199	420 741	
		6 339 686	7 451 551	4,2
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRETIONNAIRE</b>				
5 002	Aritzia Inc.	206 452	193 677	
1 860	BRP Inc. du Canada	186 166	163 029	
2 560	Canada Goose Holdings Inc.	74 371	45 287	
2 926	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	474 407	397 175	
15 472	Dollarama Inc.	1 264 430	1 932 607	
9 339	Gildan Activewear Inc.	402 474	484 600	
2 268	Linamar Corp.	152 628	150 800	
14 889	Magna International Inc.	1 240 697	853 735	
3 724	Martinrea International Inc.	45 133	42 826	
1 118	MTY Food Group Inc.	66 981	50 243	
1 909	Park Lawn Corp.	52 059	49 653	
2 071	Pet Valu Holdings Ltd.	69 179	54 488	
15 747	Restaurant Brands International Inc.	1 391 457	1 518 011	
1 915	Sleep Country Canada Holdings Inc.	51 378	49 943	
1 908	Spin Master Corp.	70 712	53 787	
		5 748 524	6 039 861	3,4
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
38 545	Algonquin Power & Utilities Corp.	488 113	309 902	
16 429	AltaGas Ltd.	415 692	507 820	
4 137	ATCO Ltd., catégorie I	172 349	161 219	
5 747	Borex Inc., catégorie A	209 330	192 582	
6 647	Brookfield Infrastructure Corp., catégorie A	363 022	306 094	
6 914	Canadian Utilities Ltd., catégorie A	242 155	204 309	
7 209	Capital Power Corp.	303 201	281 078	
15 923	Emera Inc.	849 558	726 885	
27 149	Fortis Inc.	1 508 871	1 443 512	
17 721	Hydro One Ltd.	633 450	706 182	
8 639	Innergex énergie renouvelable inc.	133 680	88 377	
14 139	Northland Power Inc.	480 775	332 549	
12 617	Superior Plus Corp.	134 147	111 913	
15 370	TransAlta Corp.	179 682	149 089	
		6 114 025	5 521 511	3,1
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
51 162	BCE Inc.	3 081 652	2 266 988	
3 526	Cineplex Inc.	36 418	28 983	
1 688	Cogeco Communications Inc.	123 187	87 084	
439	Cogeco Inc.	25 679	21 160	
8 590	Québecor Inc., catégorie B	257 788	247 994	
20 793	Rogers Communications Inc., catégorie B	1 243 867	1 052 125	
82 836	TELUS Corp.	2 228 857	1 715 533	
		6 997 448	5 419 867	3,1

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>IMMOBILIER</b>				
7 098	FPI Allied Properties	233 369	108 671	
2 534	Altus Group Ltd.	136 011	128 017	
3 820	Artis REIT	35 709	24 371	
2 281	Boardwalk REIT	129 351	160 765	
9 369	FPI d'immeubles résidentiels canadien	468 777	416 452	
15 499	FPI Propriétés de Choix	218 672	199 007	
2 443	Colliers International Group Inc.	353 894	373 217	
5 916	FPI Crombie	93 462	75 429	
4 158	FPI CT	65 012	54 803	
14 757	FPI industriel Dream	191 985	186 971	
303	FPI de bureaux Dream	8 753	5 481	
11 874	FPI First Capital	195 162	174 548	
2 172	FirstService Corp.	432 604	452 210	
3 565	FPI Granite	286 618	241 671	
14 418	FPI H&R	177 443	129 041	
7 750	InterRent REIT	102 875	92 302	
6 510	Killam Apartment REIT	116 390	110 930	
2 176	Minto Apartment REIT	36 854	32 161	
3 522	Nexus Industrial REIT	31 507	23 880	
12 432	FPI NorthWest Healthcare Properties	110 801	57 934	
5 392	Primaris REIT, série A	76 179	71 551	
16 782	FPI RioCan	342 873	282 105	
2 759	Slate Grocery REIT	36 042	30 211	
7 260	SmartCentres REIT	192 774	159 647	
13 189	StorageVault Canada Inc.	80 352	61 461	
		4 153 469	3 652 836	2,1
<b>SOINS DE SANTÉ</b>				
3 051	Aurora Cannabis Inc.	30 376	19 282	
18 032	Bausch Health Cos., Inc.	295 208	172 026	
4 147	Canopy Growth Corp.	138 188	36 659	
13 373	Chartwell, résidences pour retraités	136 403	171 843	
24 760	Curaleaf Holdings Inc.	184 645	129 990	
5 702	dentalcorp Holdings Ltd.	57 174	46 985	
4 074	Sienna Senior Living Inc.	52 917	58 055	
12 478	WELL Health Technologies Corp.	55 689	58 771	
		950 600	693 611	0,4
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>165 055 970</b>	<b>176 700 423</b>	<b>99,6</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(116 949)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>164 939 021</b>	<b>176 700 423</b>	<b>99,6</b>
Autres actifs (passifs) nets			695 947	0,4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>177 396 370</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	6	11
Paievements indirects†	2	4

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	7 489 999	7 039 999
Parts rachetables émises	1 300 000	750 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(599 999)	(450 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>8 190 000</b>	<b>7 339 999</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,050

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	7 635	-
Garanties (hors trésorerie)	8 031	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	34	30
Charges	(11)	(9)
Revenu tiré des prêts de titres	23	21
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>31,6</b>	<b>30,5</b>

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

---

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
CI Financial Corp.	109

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
CI Financial Corp.	122

---

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Services financiers	31,5
Actions - Énergie	17,2
Actions - Produits industriels	13,9
Actions - Matériaux	11,1
Actions - Technologies de l'information	8,6
Actions - Biens de consommation de base	4,1
Actions - Services de communication	3,7
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	3,5
Actions - Services publics	3,3
Actions - Immobilier	2,4
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Actions - Soins de santé	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

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

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net du marché élargi du Canada	17 567 447

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net du marché élargi du Canada	15 347 146

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les actifs du Fonds étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, le Fonds n'avait aucune exposition au risque de change.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

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

# FNB Indice d'actions canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	176 700	-	-	176 700
<b>Total</b>	<b>176 700</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>176 700</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	154 184	-	-	154 184
<b>Total</b>	<b>154 184</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>154 184</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de FPI canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	428 938	487 365
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	12 978	8 187
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	32	2 137
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1 729	2 358
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	443 677	500 047
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	497	19
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	274	315
Frais d'administration à payer	15	17
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	22
Comptes créditeurs et charges à payer	19	35
	805	408
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	442 872	499 639

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	442 872	499 639	15,12	16,07	29 296 068	31 096 068

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

# FNB de FPI canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	9 217	11 113
Intérêts aux fins des distributions	300	460
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	9 339	17 169
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(33 298)	(12 765)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(14 442)</b>	<b>15 977</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	33	37
Profit (perte) de change sur la trésorerie	151	(377)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	8	48
<b>Total des autres revenus</b>	<b>192</b>	<b>(292)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(14 250)</b>	<b>15 685</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 791	2 243
Frais d'administration (note 5)	95	119
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	164	118
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	100	132
Taxe de vente harmonisée	189	240
<b>Total des charges</b>	<b>2 340</b>	<b>2 853</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(16 590)</b>	<b>12 832</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	(16 590)	12 832	(0,54)	0,35	30 554 035	36 236 123

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

# FNB de FPI canadiennes CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	499 639	590 409	499 639	590 409
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(16 590)	12 832	(16 590)	12 832
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(5 935)	(3 611)	(5 935)	(3 611)
Profits nets réalisés	(6 088)	(5 778)	(6 088)	(5 778)
Remboursement de capital	(304)	(5 236)	(304)	(5 236)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(12 327)	(14 625)	(12 327)	(14 625)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	12 592	17 131	12 592	17 131
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(40 442)	(45 982)	(40 442)	(45 982)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(27 850)	(28 851)	(27 850)	(28 851)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(56 767)	(30 644)	(56 767)	(30 644)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	442 872	559 765	442 872	559 765

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

# FNB de FPI canadiennes CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(16 590)	12 832
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(9 339)	(17 169)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	33 298	12 765
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(135)	74
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	164	118
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	50 204	56 741
Achat de placements et de dérivés	(40 276)	(46 950)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	629	66
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(40)	(37)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(16)	(53)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>17 897</b>	<b>18 385</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(12 327)	(14 626)
Produit de l'émission de parts rachetables	354	792
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 268)	(2 164)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(13 241)</b>	<b>(15 998)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	135	(74)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4 656	2 387
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	8 187	16 783
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>12 978</b>	<b>19 096</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	300	460
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	9 746	11 047
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.



# FNB de FPI canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>IMMOBILIER</b>			
	625 765	FPI Allied Properties	24 478 909	9 580 462	
USD	95 189	American Homes 4 Rent, catégorie A	4 670 901	4 839 098	
USD	27 877	American Tower Corp.	7 580 573	7 413 095	
	325 640	Boardwalk REIT	15 861 333	22 951 107	
USD	654 909	BSR REIT	9 132 881	10 715 541	
	512 083	FPI d'immeubles résidentiels canadien	22 404 028	22 762 089	
	1 287 235	FPI Propriétés de Choix	17 304 351	16 528 097	
USD	18 179	Colliers International Group Inc.	2 410 556	2 776 711	
	1 382 189	FPI Crombie	20 054 516	17 622 910	
	1 095 339	FPI CT	15 628 856	14 436 568	
	1 887 552	FPI industriel Dream	18 408 275	23 915 285	
USD	7 026	Equinix Inc.	6 593 751	7 272 378	
	2 673 789	European Residential REIT	11 171 066	6 216 560	
	1 454 471	FPI First Capital	26 196 904	21 380 724	
USD	782 207	Flagship Communities REIT	14 973 023	14 917 170	
	350 279	FPI Granite	23 924 066	23 745 413	
	1 652 241	FPI H&R	22 264 459	14 787 557	
USD	88 881	Healthpeak Properties Inc.	2 371 716	2 383 236	
	1 703 890	InterRent REIT	18 241 042	20 293 330	
	1 331 904	Killam Apartment REIT	20 080 160	22 695 644	
	1 297 745	Minto Apartment REIT	24 227 564	19 180 671	
	818 498	Morguard North American Residential REIT	10 533 188	12 670 349	
	325 775	NexLiving Communities Inc.	1 170 620	553 818	
	118 358	Nexus Industrial REIT	1 196 740	802 467	
	1 314 468	FPI NorthWest Healthcare Properties	11 254 580	6 125 421	
	1 080 408	Primaris REIT, série A	16 520 321	14 337 014	
	219 154	PRO REIT	1 189 503	1 056 322	
USD	29 061	Prologis Inc.	3 440 710	4 465 098	
	1 403 739	FPI RioCan	30 534 932	23 596 853	
USD	13 373	SBA Communications Corp.	4 740 012	3 591 295	
	2 406 440	StorageVault Canada Inc.	7 673 446	11 214 010	
USD	28 379	Sun Communities Inc.	5 328 793	4 672 067	
USD	72 655	Ventas Inc.	4 770 607	5 095 022	
			426 332 382	394 593 382	89,1
		<b>SOINS DE SANTÉ</b>			
	1 966 816	Chartwell, résidences pour retraités	21 169 837	25 273 586	
	636 553	Sienna Senior Living Inc.	10 063 449	9 070 880	
			31 233 286	34 344 466	7,8
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>457 565 668</b>	<b>428 937 848</b>	<b>96,9</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(848 075)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>456 717 593</b>	<b>428 937 848</b>	<b>96,9</b>
		Contrat(s) de change à terme		(465 052)	(0,1)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>456 717 593</b>	<b>428 472 796</b>	<b>96,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		14 399 261	3,2
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>442 872 057</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position		Position			
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	6 483 391	USD	4 778 584	1,36	(51 787)
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	2 376 215	USD	1 736 123	1,37	3 437
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	USD	980 435	CAD	1 332 019	0,74	7 952
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	5 233 714	USD	3 816 121	1,37	18 179
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	3 948 928	USD	2 893 539	1,36	(5 703)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	6 483 893	USD	4 778 584	1,36	(51 285)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	USD	1 695 100	CAD	2 330 196	0,73	(11 982)
Citibank N.A., New York	A-1	13 août 2024	CAD	3 155 976	USD	2 314 831	1,36	(7 729)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	6 434 172	USD	4 778 584	1,35	(101 006)
Goldman Sachs International	A-1	13 août 2024	CAD	3 949 840	USD	2 893 539	1,37	(4 791)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 237 562	USD	2 389 292	1,36	(30 027)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 juillet 2024	CAD	2 587 632	USD	1 911 433	1,35	(26 439)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	2 695 067	USD	1 976 400	1,36	(7 852)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	2 375 512	USD	1 736 123	1,37	2 734
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	3 159 826	USD	2 314 831	1,37	(3 879)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	3 238 023	USD	2 389 292	1,36	(29 566)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	4 700 669	USD	3 470 634	1,35	(45 761)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 septembre 2024	USD	2 507 000	CAD	3 432 038	0,73	(8 639)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 juillet 2024	CAD	6 432 043	USD	4 778 584	1,35	(103 135)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	13 août 2024	CAD	3 155 932	USD	2 314 831	1,36	(7 773)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(465 052)</b>

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	32	(20)	-	12
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>32</b>	<b>(20)</b>	<b>-</b>	<b>12</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(497)	20	-	(477)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(497)</b>	<b>20</b>	<b>-</b>	<b>(477)</b>

au 31 décembre 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	2 137	(19)	-	2 118
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2 137</b>	<b>(19)</b>	<b>-</b>	<b>2 118</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(19)	19	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(19)</b>	<b>19</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	163	113
Paielements indirects†	61	40

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	31 096 068	36 696 068
Parts rachetables émises	800 000	1 000 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(2 600 000)	(2 800 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	29 296 068	34 896 068

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	22 421	-
Garanties (hors trésorerie)	23 567	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	47	55
Charges	(14)	(18)
Revenu tiré des prêts de titres	33	37
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>31,2</b>	<b>33,4</b>

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Immobilier	91,1
Soins de santé	6,5
Autres actifs (passifs) nets	2,0
Contrat(s) de change à terme	0,4
Total	100,0

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 42 894 000 \$ (48 737 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	77 877	(63 019)	14 858	3,4
Total	77 877	(63 019)	14 858	3,4

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	78 561	(66 007)	12 554	2,5
Total	78 561	(66 007)	12 554	2,5

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 1 486 000 \$ (1 255 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

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

# FNB de FPI canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	428 938	-	-	428 938
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(465)	-	(465)
<b>Total</b>	<b>428 938</b>	<b>(465)</b>	<b>-</b>	<b>428 473</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	487 365	-	-	487 365
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 118	-	2 118
<b>Total</b>	<b>487 365</b>	<b>2 118</b>	<b>-</b>	<b>489 483</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	4 097	2 051
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	12	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	8
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	4 109	2 059
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	9
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
	1	9
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	4 108	2 050

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
	Parts ordinaires	4 108	2 050	20,54	20,50	200 000

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



# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	32	5
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	26	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(19)	(5)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>39</b>	<b>-</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(1)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(1)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>39</b>	<b>(1)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Retenues d'impôts	1	-
<b>Total des charges</b>	<b>6</b>	<b>-</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>33</b>	<b>(1)</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	33	(1)	0,28	(0,02)	115 934	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 050	-	2 050	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	33	(1)	33	(1)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(25)	(2)	(25)	(2)
Profits nets réalisés	(1)	-	(1)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(26)	(2)	(26)	(2)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	2 051	1 000	2 051	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	2 051	1 000	2 051	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 058	997	2 058	997
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	4 108	997	4 108	997

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

États financiers (non audités)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	33	(1)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(26)	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	19	5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 339	1
Achat de placements et de dérivés	(1 331)	(1 002)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	8	-
(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	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>45</b>	<b>(997)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(26)	(2)
Produit de l'émission de parts rachetables	2	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(24)</b>	<b>998</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	21	1
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	(9)	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>12</b>	<b>1</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	39	5
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.

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>					
	58 205	FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	2 498 888	2 527 844	
	12 941	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	270 351	280 173	
	10 040	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	232 977	262 144	
USD	2 125	iShares Core MSCI EAFE ETF	203 506	211 172	
USD	843	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	58 278	61 734	
	35 821	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	746 693	753 674	
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>4 010 693</b>	<b>4 096 741</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(3 933)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>4 006 760</b>	<b>4 096 741</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				11 477	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>4 108 218</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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 totales du Canada CI	106 809	2 528	2,4
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	159 407	754	0,5
FNB Indice 1000 É.-U. CI	126 660	262	0,2
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	280	0,2
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	211	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	62	-

au 31 décembre 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) (%)
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	143 190	377	0,3
FNB Indice 1000 É.-U. CI	89 811	121	0,1
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	127	0,1
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	7 003 863	1 285	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	102	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	39	-

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	3	-
Paiements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	100 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	200 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	2 528
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	280
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	262

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	63
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	57

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



# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	61,6
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	18,3
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	6,8
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	6,4
iShares Core MSCI EAFE ETF	5,1
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	1,5
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	62,7
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	18,4
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	6,2
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	5,9
iShares Core MSCI EAFE ETF	5,0
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	1,9
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 410 000 \$ (205 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	276	-	276	6,7
<b>Total</b>	<b>276</b>	<b>-</b>	<b>276</b>	<b>6,7</b>

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

# FNB de répartition de l'actif prudent CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	143	-	143	7,0
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>-</b>	<b>143</b>	<b>7,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 28 000 \$ (14 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	4 097	-	-	4 097
<b>Total</b>	<b>4 097</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4 097</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 051	-	-	2 051
<b>Total</b>	<b>2 051</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 051</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	2 519	14 325
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	4	693
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	377
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	32
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	5
	2 526	15 432
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	5	7
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	1	5
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	2	7
	8	19
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 518</b>	<b>15 413</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
	Parts ordinaires	2 518	15 413	25,18	23,68	100 000

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	14	35
Intérêts aux fins des distributions	3	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	4 268	1 060
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(2 831)	2 088
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 454</b>	<b>3 183</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	36	1
Profit (perte) de change sur la trésorerie	1	-
Rabais sur frais	8	22
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>45</b>	<b>23</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 499</b>	<b>3 206</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	12	24
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	2	5
Autres frais	5	8
<b>Total des charges</b>	<b>23</b>	<b>40</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 476</b>	<b>3 166</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	1 476	3 166	5,91	4,52	249 725	700 000

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	15 413	10 925	15 413	10 925
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 476	3 166	1 476	3 166
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(2)	(24)	(2)	(24)
Profits nets réalisés	(38)	-	(38)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(40)	(24)	(40)	(24)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	3 732	-	3 732	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(18 063)	-	(18 063)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(14 331)	-	(14 331)	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(12 895)	3 142	(12 895)	3 142
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2 518	14 067	2 518	14 067

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 476	3 166
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4 268)	(1 060)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	2 831	(2 088)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 058	3 000
Achat de placements et de dérivés	(1 857)	(3 007)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	31	7
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(4)	1
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>270</b>	<b>21</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(40)	(23)
Produit de l'émission de parts rachetables	218	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 137)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(959)</b>	<b>(23)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(689)	(2)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	693	16
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>4</b>	<b>14</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	43	37
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.

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U.</b>					
USD	375	Akamai Technologies Inc.	53 360	46 223	
USD	423	Alphabet Inc., catégorie A	80 706	105 431	
USD	310	Amazon.com Inc.	70 116	81 974	
USD	346	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	67 962	72 864	
USD	56	Broadcom Inc.	92 996	123 027	
USD	59	CACI International Inc., catégorie A	29 757	34 726	
USD	1 094	Cisco Systems Inc.	71 275	71 121	
USD	803	CloudFlare Inc., catégorie A	102 219	91 012	
USD	268	CrowdStrike Holdings Inc., catégorie A	117 211	140 522	
USD	1 454	Fortinet Inc.	133 479	119 911	
USD	2 706	Gen Digital Inc.	79 567	92 495	
USD	143	ICF International Inc.	28 665	29 050	
USD	451	Leidos Holdings Inc.	75 281	90 026	
USD	3 674	Lumen Technologies Inc.	6 536	5 530	
USD	188	Microsoft Corp.	102 218	114 978	
USD	2 373	Mitek Systems Inc.	40 274	36 303	
USD	177	Motorola Solutions Inc.	77 410	93 501	
USD	1 760	NetScout Systems Inc.	52 187	44 048	
USD	644	NVIDIA Corp.	99 649	108 866	
USD	741	Okta Inc.	84 241	94 916	
USD	1 353	OneSpan Inc.	20 617	23 735	
USD	285	Palo Alto Networks Inc.	139 769	132 206	
USD	295	Parsons Corp.	29 845	33 024	
USD	630	Rapid7 Inc.	42 053	37 267	
USD	2 219	SentinelOne Inc., catégorie A	72 640	63 916	
USD	1 468	SolarWinds Corp.	22 862	24 205	
USD	748	Tenable Holdings Inc.	45 113	44 605	
USD	289	Ziff Davis Inc.	25 680	21 770	
USD	480	Zscaler Inc.	118 517	126 231	
			1 982 205	2 103 483	83,6
<b>ISRAËL</b>					
USD	382	Check Point Software Technologies Ltd.	70 756	86 247	
USD	244	CyberArk Software Ltd.	60 063	91 289	
USD	250	Radware Ltd.	6 959	6 240	
			137 778	183 776	7,3
<b>SINGAPOUR</b>					
SGD	28 554	Singapore Telecommunications Ltd.	68 846	79 283	3,1
<b>CANADA</b>					
USD	15 151	BlackBerry Ltd.	56 276	51 415	
	3 182	WELL Health Technologies Corp.	11 440	14 987	
			67 716	66 402	2,6
<b>JAPON</b>					
JPY	723	Trend Micro Inc.	47 729	40 167	1,6
<b>R.-U.</b>					
GBP	2 111	GB Group PLC	10 073	12 408	
GBP	3 693	Spirent Communications PLC	7 418	11 690	
			17 491	24 098	1,0
<b>CORÉE DU SUD</b>					
KRW	190	AhnLab Inc.	14 114	11 408	0,5

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ITALIE					
EUR	450	Tinexta SPA	12 355	10 651	0,4
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>2 348 234</b>	<b>2 519 268</b>	<b>100,1</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(1 832)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>2 346 402</b>	<b>2 519 268</b>	<b>100,1</b>
Contrat(s) de change à terme				(1 693)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 346 402</b>	<b>2 517 575</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				14	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>2 517 589</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	16 828	EUR	11 346	1,48	189
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	33 654	GBP	19 331	1,74	216
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 508	GBP	867	1,74	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	53 252	JPY	6 075 331	0,01	1 571
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	61 029	SGD	60 184	1,01	264
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	2 631	SGD	2 601	1,01	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	2 183 058	USD	1 598 245	1,37	(3 901)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	11 093	CAD	16 269	0,68	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	253	CAD	376	0,67	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	GBP	20 198	CAD	34 961	0,58	(24)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	5 470 426	CAD	46 630	117,31	(96)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	604 905	CAD	5 300	114,14	(154)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	SGD	62 784	CAD	63 288	0,99	103
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	16 786	CAD	22 866	0,73	103
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	1 581 459	CAD	2 164 443	0,73	(453)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	16 453	EUR	11 210	1,47	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	35 162	GBP	20 325	1,73	24
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	47 952	JPY	5 603 863	0,01	91
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	63 661	SGD	63 113	1,01	(112)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	2 160 192	USD	1 579 456	1,37	475
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(1 693)</b>

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

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



# FNB indiciel sécurité numérique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	3	(3)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>3</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(5)	3	-	(2)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(5)</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>(2)</b>

au 31 décembre 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	377	(7)	-	370
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>377</b>	<b>(7)</b>	<b>-</b>	<b>370</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(7)	7	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(7)</b>	<b>7</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	3	2
Paiements indirects†	1	1

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	650 000	700 000
Parts rachetables émises	150 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(700 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	700 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,400

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	156	-
Garanties (hors trésorerie)	164	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	73	1
Charges	(37)	-
Revenu tiré des prêts de titres	36	1
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>50,8</b>	<b>30,0</b>

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
É.-U.	79,4
Israël	6,2
Autres actifs (passifs) nets	4,7
Canada	2,7
Contrat(s) de change à terme	2,4
Japon	2,3
R.-U.	1,0
France	0,8
Corée du Sud	0,5
Total	100,0

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition directe du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	2,5
Total	2,5

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

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

Indice de référence	Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 30 juin 2024 (\$)
Indice Solactive de rendement total net de la sécurité numérique (couvert en \$ CA)	250 250

Indice de référence	Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au 31 décembre 2023 (\$)
Indice Solactive de rendement total net de la sécurité numérique (couvert en \$ CA)	1 432 117

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

# FNB indiciel sécurité numérique CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	2 340	(2 160)	180	7,1
Dollar de Singapour	80	(64)	16	0,6
Won coréen	11	-	11	0,4
Euro	11	(16)	(5)	(0,2)
Yen japonais	40	(48)	(8)	(0,3)
Livre sterling	25	(35)	(10)	(0,4)
<b>Total</b>	<b>2 507</b>	<b>(2 323)</b>	<b>184</b>	<b>7,2</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	13 561	(12 940)	621	4,0
Won coréen	73	-	73	0,5
Yen japonais	383	(343)	40	0,3
Euro	120	(99)	21	0,1
Livre sterling	159	(142)	17	0,1
Dollar taïwanais	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>14 297</b>	<b>(13 524)</b>	<b>773</b>	<b>5,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 18 000 \$ (77 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	2 519	-	-	2 519
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(2)	-	(2)
<b>Total</b>	<b>2 519</b>	<b>(2)</b>	<b>-</b>	<b>2 517</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	14 325	-	-	14 325
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	370	-	370
<b>Total</b>	<b>14 325</b>	<b>370</b>	<b>-</b>	<b>14 695</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	122 581	92 900
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	160	2 063
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	521
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	343	199
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	67	52
	123 151	95 735
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	13	31
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	86	68
Frais d'administration à payer	17	13
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	150
Montant à payer pour le rachat de parts	975	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	441	-
Comptes créditeurs et charges à payer	67	96
	1 599	358
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>121 552</b>	<b>95 377</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB en						
\$ CA	119 527	94 189	19,52	17,77	6 125 000	5 300 000
Série FNB couverte en						
\$ US	2 025	1 188	19,74*	17,93*	75 000	50 000

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

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 639	1 546
Intérêts aux fins des distributions	8	2
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	2 139	(1 364)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	7 336	3 077
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>11 122</b>	<b>3 261</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	7
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(41)	(73)
Rabais sur frais	363	257
Autres revenus	33	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>356</b>	<b>192</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>11 478</b>	<b>3 453</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	473	349
Frais d'administration (note 5)	94	69
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	193	170
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	166	105
Taxe de vente harmonisée	11	16
Autres frais	37	4
<b>Total des charges</b>	<b>975</b>	<b>714</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>10 503</b>	<b>2 739</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Série FNB en						
\$ CA	10 347	2 718	1,76	0,56	5 876 511	4 830 110
Série FNB couverte en						
\$ US	156	21	2,65	0,42	58 929	50 000

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	94 189	67 097	1 188	1 100	95 377	68 197
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10 347	2 718	156	21	10 503	2 739
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	-	(704)	-	(5)	-	(709)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(384)	-	-	-	(384)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(384)	(704)	-	(5)	(384)	(709)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	28 248	19 583	2 702	-	30 950	19 583
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(12 873)	(4 232)	(2 021)	-	(14 894)	(4 232)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	15 375	15 351	681	-	16 056	15 351
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	25 338	17 365	837	16	26 175	17 381
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	119 527	84 462	2 025	1 116	121 552	85 578

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



# FNB alpha Marchés émergents CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10 503	2 739
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 139)	1 364
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(7 336)	(3 077)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(5)	(2)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	193	170
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	44 231	34 050
Achat de placements et de dérivés	(64 278)	(50 847)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(144)	(214)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	18	10
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	4	2
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	398	10
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(18 555)</b>	<b>(15 795)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(384)	(709)
Produit de l'émission de parts rachetables	30 949	19 583
Montant versé au rachat de parts rachetables	(13 918)	(4 232)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>16 647</b>	<b>14 642</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	5	2
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1 908)	(1 153)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 063	2 113
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>160</b>	<b>962</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	8	2
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 329	1 226
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.

# FNB alpha Marchés émergents CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>CHINE</b>					
HKD	118 409	Alibaba Group Holding Ltd.	1 842 919	1 462 438	
HKD	118 598	ANTA Sports Products Ltd. Sports Products Ltd.	1 655 590	1 558 269	
HKD	52 006	BYD Co., Ltd., catégorie H	2 076 602	2 113 709	
HKD	980 330	China Construction Bank Corp., catégorie H	957 094	990 950	
HKD	1 532 130	China Power International Development Ltd.	960 058	1 087 062	
HKD	259 219	COSCO SHIPPING Holdings Co., Ltd., catégorie H	623 952	620 328	
CNY	167 000	Dongfang Electric Corp., Ltd.	578 642	580 118	
HKD	72 090	ENN Energy Holdings Ltd.	980 531	812 695	
HKD	311 768	Hansoh Pharmaceutical Group Co., Ltd.	979 320	891 365	
CNY	1 885 000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	1 821 571	2 022 972	
USD	24 442	JD.com Inc., CAAE	898 942	864 035	
CNY	7 243	Kweichow Moutai Co., Ltd.	2 390 564	2 001 095	
HKD	60 066	Meituan, catégorie B	1 345 264	1 169 086	
USD	4 690	NetEase Inc., CAAE	593 929	613 256	
USD	7 829	PDDHoldings Inc., CAAE	1 025 039	1 423 956	
HKD	89 959	Ping An Insurance (Group) Co., of China Ltd., catégorie H	611 709	557 894	
HKD	115 843	Tencent Holdings Ltd.	6 727 396	7 557 589	
USD	15 385	Trip.com Group Ltd., CAAE	697 917	989 230	
			26 767 039	27 316 047	22,5
<b>INDE</b>					
INR	12 592	Asian Paints Ltd.	589 011	602 615	
INR	80 160	Axis Bank Ltd.	1 252 862	1 663 930	
INR	74 604	HDFC Bank Ltd.	1 795 008	2 060 884	
INR	41 663	Hindustan Unilever Ltd.	1 728 562	1 690 380	
INR	56 781	ICICI Bank Ltd.	868 432	1 117 482	
INR	62 250	Infosys Ltd.	1 376 588	1 600 074	
INR	69 622	Larsen & Toubro Ltd.	3 004 320	4 053 089	
INR	7 510	Maruti Suzuki India Ltd.	1 202 773	1 482 674	
INR	118 366	REC Ltd.	867 265	1 020 277	
INR	57 782	Reliance Industries Ltd.	2 465 229	2 967 898	
INR	21 070	Shriram Transport Finance Co., Ltd.	642 341	1 006 427	
INR	30 228	Titan Co., Ltd.	1 449 323	1 688 206	
INR	212 019	Zomato Ltd.	631 755	697 622	
			17 873 469	21 651 558	17,8
<b>TAÏWAN</b>					
TWD	81 656	Delta Electronics Inc.	1 236 031	1 334 323	
TWD	181 865	Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	1 234 463	1 641 209	
TWD	26 248	LOTES Co., Ltd.	1 061 294	1 804 201	
TWD	36 677	MediaTek Inc.	1 640 236	2 165 324	
USD	54 705	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	7 464 508	13 007 797	
TWD	79 493	Unimicron Technology Corp.	608 712	603 396	
			13 245 244	20 556 250	16,9
<b>CORÉE DU SUD</b>					
KRW	4 830	Amorepacific Corp.	635 048	803 099	
KRW	7 022	Hyundai Motor Co., Ltd.	1 853 881	2 058 774	
KRW	2 408	Posco Future M Co., Ltd.	784 845	618 647	
KRW	798	Samsung Biologics Co., Ltd.	606 695	576 585	
KRW	83 271	Samsung Electronics Co., Ltd.	5 968 128	6 744 924	
KRW	19 993	SK Hynix Inc.	2 688 759	4 699 318	
			12 537 356	15 501 347	12,7

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BRESIL</b>					
BRL	135 780	Banco do Brasil SA	811 214	884 890	
BRL	517 180	CCR SA	1 820 899	1 469 455	
BRL	167 867	Itau Unibanco Holding S.A., privilégiées	1 543 777	1 328 580	
BRL	97 671	Localiza Rent a Car SA	1 430 640	1 001 765	
BRL	986	Localiza Rent a Car SA, droits, 6 août 2024	-	2 051	
USD	1 321	MercadoLibre Inc.	2 122 974	2 969 942	
USD	37 960	NU Holdings Ltd. des îles Caïmans, catégorie A	606 906	669 393	
USD	70 420	Petróleo Brasileiro SA, CAAE	1 257 783	1 395 939	
USD	71 627	Vale SA, CAAE	1 366 176	1 094 541	
			10 960 369	10 816 556	8,9
<b>MEXIQUE</b>					
MXN	258 737	Fomento Económico Mexicano SAB de CV	3 446 424	3 799 683	
MXN	292 957	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	3 262 291	3 119 051	
MXN	333 712	Wal-Mart de Mexico SAB de CV, Series V	1 702 656	1 559 380	
			8 411 371	8 478 114	7,0
<b>INDONÉSIE</b>					
IDR	1 432 175	PT Bank Central Asia TBK	1 163 927	1 187 537	
IDR	6 097 663	PT Bank Mandiri (Persero) TBK	3 132 928	3 132 992	
			4 296 855	4 320 529	3,6
<b>HONG KONG</b>					
HKD	54 511	ASMPT Ltd.	758 988	1 039 958	
HKD	29 196	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	1 538 067	1 279 719	
HKD	45 451	Techtronic Industries Co., Ltd.	846 957	710 251	
			3 144 012	3 029 928	2,5
<b>CANADA</b>					
	46 980	Ivanhoe Mines Ltd., catégorie A	617 394	829 197	
USD	147 139	Kinross Gold Corp.	1 223 617	1 674 762	
			1 841 011	2 503 959	2,1
<b>THAÏLANDE</b>					
THB	189 518	Bumrungrad Hospital PCL	1 555 636	1 745 071	
THB	99 832	PTT Exploration and Production PCL	575 406	565 690	
			2 131 042	2 310 761	1,9
<b>R.-U.</b>					
GBP	30 540	Shell PLC	1 395 029	1 496 760	1,2
<b>MACAO</b>					
HKD	226 778	Galaxy Entertainment Group Ltd.	1 597 667	1 446 126	1,2
<b>É.-U.</b>					
USD	20 963	Freeport-McMoRan Inc.	1 197 539	1 393 772	1,1
<b>PHILIPPINES</b>					
PHP	371 314	BDO Unibank Inc.	1 295 851	1 111 135	0,9
<b>ITALIE</b>					
HKD	63 396	Prada SpA	615 453	648 602	0,5
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>107 309 307</b>	<b>122 581 444</b>	<b>100,8</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(170 313)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>107 138 994</b>	<b>122 581 444</b>	<b>100,8</b>
		Contrat(s) de change à terme		(12 643)	0,0
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>107 138 994</b>	<b>122 568 801</b>	<b>100,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		(1 017 082)	(0,8)
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>121 551 719</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	18 472	CAD	25 328	0,73	(65)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	1 459 215	CAD	2 008 290	0,73	(12 578)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(12 643)</b>

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

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

au 31 décembre 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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(31)	-	-	(31)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(31)	-	-	(31)

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	193	156
Paielements indirects†	72	55

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	5 300 000	4 150 000	50 000	50 000
Parts rachetables émises	1 500 000	1 150 000	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(675 000)	(250 000)	(75 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>6 125 000</b>	<b>5 050 000</b>	<b>75 000</b>	<b>50 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	10
Charges	-	(3)
Revenu tiré des prêts de titres	1	7
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>29,9</b>	<b>30,0</b>

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

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Chine	19,1
Actions - Inde	16,6
Actions - Taïwan	13,0
Actions - Mexique	11,0
Actions - Corée du Sud	10,8
Actions - Brésil	9,5
Actions - Indonésie	6,6
Actions - Hong Kong	3,1
Autres actifs (passifs) nets	2,6
Actions - Singapour	2,1
Actions - Thaïlande	1,4
Actions - R.-U.	1,1
Actions - É.-U.	1,0
Actions - Philippines	1,0
Actions - Chili	0,6
Actions - Canada	0,5
Contrat(s) de change à terme	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 12 258 000 \$ (9 290 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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



# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	26 233	2 021	28 254	23,2
Dollar de Hong Kong	24 026	-	24 026	19,8
Roupie indienne	21 851	-	21 851	18,0
Won coréen	15 536	-	15 536	12,8
Peso mexicain	8 657	-	8 657	7,1
Dollar taïwanais	7 557	-	7 557	6,2
Réal brésilien	4 737	-	4 737	3,9
Renminbi chinois	4 692	-	4 692	3,9
Roupie indonésienne	4 336	-	4 336	3,6
Baht thaïlandais	2 311	-	2 311	1,9
Livre sterling	1 511	-	1 511	1,2
Peso philippin	1 118	-	1 118	0,9
<b>Total</b>	<b>122 565</b>	<b>2 021</b>	<b>124 586</b>	<b>102,5</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	20 125	1 187	21 312	22,3
Roupie indienne	15 912	-	15 912	16,7
Dollar de Hong Kong	12 109	-	12 109	12,7
Peso mexicain	11 167	-	11 167	11,7
Won coréen	10 354	-	10 354	10,9
Roupie indonésienne	6 151	-	6 151	6,4
Renminbi chinois	5 283	-	5 283	5,5
Dollar taïwanais	4 237	-	4 237	4,4
Réal brésilien	3 498	-	3 498	3,7
Dollar de Singapour	2 145	-	2 145	2,2
Baht thaïlandais	1 311	-	1 311	1,4
Livre sterling	1 091	-	1 091	1,1
Peso philippin	952	-	952	1,0
<b>Total</b>	<b>94 335</b>	<b>1 187</b>	<b>95 522</b>	<b>100,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 12 459 000 \$ (9 552 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB alpha Marchés émergents CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	122 581	-	-	122 581
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(13)	-	(13)
<b>Total</b>	<b>122 581</b>	<b>(13)</b>	<b>-</b>	<b>122 568</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	92 900	-	-	92 900
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(31)	-	(31)
<b>Total</b>	<b>92 900</b>	<b>(31)</b>	<b>-</b>	<b>92 869</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	254 932	364 216
Placements donnés en garantie	57 272	100 887
Trésorerie	1 302	2 774
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	317	2 954
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1 098	2 676
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	97	145
	315 018	473 652
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	7	8
Swaps, options sur swaps et options	1 519	2 748
Frais de gestion à payer	168	263
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	-	18
Comptes créditeurs et charges à payer	86	215
	1 780	3 252
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>313 238</b>	<b>470 400</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires couvertes	150 301	236 155	6,15	6,06	24 427 939	38 977 939
Parts ordinaires couvertes en \$ US	5 392	2 928	11,26*	11,05*	350 000	200 000
Parts ordinaires non couvertes	157 545	231 317	8,03	7,67	19 627 693	30 177 693

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

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

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

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	8 168	17 600
Intérêts aux fins des distributions	77	87
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	5 115	11 073
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	23 626	17 560
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(13 114)	(59 169)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>23 872</b>	<b>(12 849)</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	25	63
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(14)	(78)
Rabais sur frais	570	863
Autres revenus	43	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>624</b>	<b>849</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>24 496</b>	<b>(12 000)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 159	1 704
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	253	472
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	746	1 625
Taxe de vente harmonisée	55	82
<b>Total des charges</b>	<b>2 214</b>	<b>3 884</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>22 282</b>	<b>(15 884)</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	6 361	(7 903)	0,23	(0,15)	27 672 994	53 089 541
Parts ordinaires couvertes en \$ US	382	(82)	1,46	(0,56)	261 264	148 619
Parts ordinaires non couvertes	15 539	(7 899)	0,67	(0,29)	23 099 122	27 666 091

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

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

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	236 155	325 602	2 928	2 261	231 317	208 168	470 400	536 031
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 361	(7 903)	382	(82)	15 539	(7 899)	22 282	(15 884)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>								
Revenu net de placement	(2 738)	(7 864)	(62)	(43)	(2 966)	(3 258)	(5 766)	(11 165)
Profits nets réalisés	(3 423)	(7 536)	(98)	(54)	(4 622)	(7 502)	(8 143)	(15 092)
Remboursement de capital	(98)	-	(24)	-	(69)	-	(191)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(6 259)	(15 400)	(184)	(97)	(7 657)	(10 760)	(14 100)	(26 257)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>								
Produit de l'émission de parts rachetables	21 203	89 744	9 371	3 672	30 789	38 976	61 363	132 392
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(107 159)	(91 007)	(7 105)	(4 375)	(112 443)	(29 100)	(226 707)	(124 482)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(85 956)	(1 263)	2 266	(703)	(81 654)	9 876	(165 344)	7 910
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(85 854)	(24 566)	2 464	(882)	(73 772)	(8 783)	(157 162)	(34 231)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	150 301	301 036	5 392	1 379	157 545	199 385	313 238	501 800

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

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

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	22 282	(15 884)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(23 626)	(17 560)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	13 114	59 169
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(43)	50
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	253	472
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	136 934	141 915
Achat de placements et de dérivés	(137 408)	(143 095)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	1 579	(881)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(94)	(27)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(82)	12
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>12 909</b>	<b>24 171</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(14 101)	(26 256)
Produit de l'émission de parts rachetables	738	1 034
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 061)	(817)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(14 424)</b>	<b>(26 039)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	43	(50)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1 515)	(1 868)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 774	4 413
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 302</b>	<b>2 495</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	77	87
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	9 000	15 094
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.

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U.</b>					
USD	94 768	Chevron Corp.	19 798 014	20 279 440	
USD	133 522	ConocoPhillips Co.	18 600 707	20 893 197	
USD	121 634	EOG Resources Inc.	20 168 567	20 944 943	
USD	132 812	Exxon Mobil Corp.	17 584 032	20 916 551	
USD	100 772	Hess Corp.	19 896 478	20 337 275	
USD	239 212	Occidental Petroleum Corp.	17 004 526	20 626 818	
			113 052 324	123 998 224	39,6
<b>CANADA</b>					
	427 126	Canadian Natural Resources Ltd.	18 309 838	20 813 850	
	791 313	Cenovus Energy Inc.	20 240 779	21 278 407	
	402 493	Suncor Énergie Inc.	16 990 500	20 990 010	
			55 541 117	63 082 267	20,1
<b>R.-U.</b>					
USD	417 337	BP PLC, CAAE	19 809 223	20 610 858	
USD	212 186	Shell PLC, CAAE	18 104 214	20 952 486	
			37 913 437	41 563 344	13,3
<b>ITALIE</b>					
USD	500 182	Eni SPA, CAAE	19 087 009	21 068 796	6,7
<b>NORVÈGE</b>					
USD	537 776	Equinor ASA, CAAE	20 517 670	21 011 719	6,7
<b>BRESIL</b>					
USD	1 055 693	Petróleo Brasileiro SA, CAAE	18 736 581	20 927 049	6,7
<b>FRANCE</b>					
USD	225 309	TotalEnergies SE, CAAE	18 562 424	20 553 042	6,6
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>283 410 562</b>	<b>312 204 441</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(237 176)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>283 173 386</b>	<b>312 204 441</b>	<b>99,7</b>
Contrat(s) de change à terme				309 934	0,1
Position(s) vendeur sur option(s)				(1 518 569)	(0,5)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>283 173 386</b>	<b>310 995 806</b>	<b>99,3</b>
Autres actifs (passifs) nets				2 242 056	0,7
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>313 237 862</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	128 479 498	USD	93 728 912	1,37	311 239
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	149 201	USD	109 347	1,36	(324)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	245 412	USD	179 790	1,36	(439)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	240 362	USD	176 157	1,36	(521)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	2 570 598	USD	1 882 721	1,37	(3 903)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	7 483 499	CAD	10 230 053	0,73	3 151
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	704 628	CAD	961 450	0,73	2 084
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	179 790	CAD	245 412	0,73	439
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	109 347	CAD	149 201	0,73	324
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	243 837	CAD	333 328	0,73	103
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	22 798	CAD	31 128	0,73	47
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	383 072	CAD	523 895	0,73	(69)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	177 693	CAD	243 177	0,73	(193)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	194 273	CAD	265 912	0,73	(256)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	515 789	CAD	707 056	0,73	(1 748)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>309 934</b>

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

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

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

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Date d'expiration	Taille du lot par contrat	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste du contrat (\$)
(1 049)	BP PLC, CAAE, (option d'achat) – 36,00	19 juillet 2024	100	36,00	USD	(86 210)	(101 891)
(1 074)	Canadian Natural Resources Ltd., (option d'achat) – 49,00	19 juillet 2024	100	49,00	CAD	(66 588)	(95 049)
(1 991)	Cenovus Energy Inc., (option d'achat) – 26,00	19 juillet 2024	100	26,00	CAD	(105 523)	(229 961)
(238)	Chevron Corp., (option d'achat) – 160,00	19 juillet 2024	100	160,00	USD	(64 220)	(45 421)
(335)	ConocoPhillips Co., (option d'achat) – 115,00	19 juillet 2024	100	115,00	USD	(54 604)	(91 659)
(305)	EOG Resources Inc., (option d'achat) – 123,50	19 juillet 2024	100	123,50	USD	(95 668)	(168 988)
(1 352)	Equinor ASA, CAAE, (option d'achat) – 28,21	19 juillet 2024	100	28,21	USD	(68 518)	(134 096)
(333)	Exxon Mobil Corp., (option d'achat) – 115,00	19 juillet 2024	100	115,00	USD	(54 734)	(103 640)
(253)	Hess Corp., (option d'achat) – 150,00	19 juillet 2024	100	150,00	USD	(79 759)	(62 301)
(601)	Occidental Petroleum Corp., (option d'achat) – 62,50	19 juillet 2024	100	62,50	USD	(104 546)	(129 085)
(2 655)	Petroleo Brasileiro SA, CAAE, (option d'achat) – 15,00	19 juillet 2024	100	15,00	USD	(47 275)	(65 379)
(533)	Shell PLC, CAAE, (option d'achat) – 72,50	19 juillet 2024	100	72,50	USD	(29 202)	(74 740)
(1 012)	Suncor Énergie Inc., (option d'achat) – 52,00	19 juillet 2024	100	52,00	CAD	(61 732)	(111 826)
(566)	TotalEnergies SE, CAAE, (option d'achat) – 67,50	19 juillet 2024	100	67,50	USD	(79 851)	(104 533)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(998 430)</b>	<b>(1 518 569)</b>



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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	317	(7)	-	310
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>317</b>	<b>(7)</b>	<b>-</b>	<b>310</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(7)	7	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(7)</b>	<b>7</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	2 954	(8)	-	2 946
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2 954</b>	<b>(8)</b>	<b>-</b>	<b>2 946</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(8)	8	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(8)</b>	<b>8</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	253	457
Paielements indirects†	95	161

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	38 977 939	52 427 939	200 000	150 000	30 177 693	26 327 693
Parts rachetables émises	3 400 000	14 750 000	600 000	250 000	3 750 000	5 050 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(17 950 000)	(14 800 000)	(450 000)	(300 000)	(14 300 000)	(3 800 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>24 427 939</b>	<b>52 377 939</b>	<b>350 000</b>	<b>100 000</b>	<b>19 627 693</b>	<b>27 577 693</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	29 740	-
Garanties (hors trésorerie)	31 321	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	41	116
Charges	(16)	(53)
Revenu tiré des prêts de titres	25	63
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>39,1</b>	<b>45,6</b>

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
É.-U.	45,6
Canada	13,4
R.-U.	13,2
Brésil	6,9
Italie	6,8
Norvège	6,6
France	6,4
Autres actifs (passifs) nets	1,1
Contrat(s) de change à terme	0,6
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,6</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,6)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,6)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

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

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 31 220 000 \$ (46 510 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	250 330	(118 766)	131 564	42,0
<b>Total</b>	<b>250 330</b>	<b>(118 766)</b>	<b>131 564</b>	<b>42,0</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	405 754	(195 702)	210 052	44,7
<b>Total</b>	<b>405 754</b>	<b>(195 702)</b>	<b>210 052</b>	<b>44,7</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 13 156 000 \$ (21 005 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	312 204	-	-	312 204
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	310	-	310
<b>Total</b>	<b>312 204</b>	<b>310</b>	<b>-</b>	<b>312 514</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(1 519)	-	-	(1 519)
<b>Total</b>	<b>(1 519)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(1 519)</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	465 103	-	-	465 103
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 946	-	2 946
<b>Total</b>	<b>465 103</b>	<b>2 946</b>	<b>-</b>	<b>468 049</b>

Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(2 748)	-	-	(2 748)
<b>Total</b>	<b>(2 748)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(2 748)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	768 335	738 945
Placements donnés en garantie	-	17 088
Trésorerie	9 507	1 015
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	1 599	607
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2 664	9 266
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	277
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	4 334	3 984
Rabais sur frais à recevoir	234	224
	786 673	771 406
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	286	1 026
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	366	365
Frais d'administration à payer	20	20
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	202
Comptes créditeurs et charges à payer	242	238
	914	1 851
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>785 759</b>	<b>769 555</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	759 658	732 711	9,88	10,09	76 904 600	72 641 600
Parts ordinaires couvertes en \$ US	26 101	36 844	10,04*	10,22*	1 900 700	2 720 700

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

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	14 211	10 030
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	(11 522)	1 008
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(4 296)	4 997
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>(1 607)</b>	<b>16 035</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	79	54
Profit (perte) de change sur la trésorerie	136	(2 051)
Rabais sur frais	1 340	1 201
Autres revenus	-	25
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1 555</b>	<b>(771)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>(52)</b>	<b>15 264</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2 159	2 006
Frais d'administration (note 5)	117	109
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	4
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	72	84
<b>Total des charges</b>	<b>2 355</b>	<b>2 204</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(2 407)</b>	<b>13 060</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	(3 399)	13 488	(0,04)	0,19	76 415 671	70 179 572
Parts ordinaires couvertes en \$ US	992	(428)	0,40	(0,20)	2 503 997	2 117 967

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023		
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	732 711	684 826	36 844	20 419	769 555	705 245
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(3 399)	13 488	992	(428)	(2 407)	13 060
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(11 534)	(7 920)	(353)	(287)	(11 887)	(8 207)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(11 534)	(7 920)	(353)	(287)	(11 887)	(8 207)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	126 453	128 936	30 473	23 930	156 926	152 866
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(84 573)	(87 895)	(41 855)	(7 091)	(126 428)	(94 986)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	41 880	41 041	(11 382)	16 839	30 498	57 880
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	26 947	46 609	(10 743)	16 124	16 204	62 733
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	759 658	731 435	26 101	36 543	785 759	767 978

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



# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(2 407)	13 060
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	11 522	(1 008)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	4 296	(4 997)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(28)	22
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	4
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 380 384	819 659
Achat de placements et de dérivés	(1 402 371)	(862 232)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	12
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	(992)	1
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(350)	(555)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	8
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(6)	(28)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(9 945)</b>	<b>(36 054)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(11 888)	(8 207)
Produit de l'émission de parts rachetables	156 927	153 457
Montant versé au rachat de parts rachetables	(126 630)	(94 985)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>18 409</b>	<b>50 265</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	28	(22)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8 464	14 211
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 015	324
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>9 507</b>	<b>14 513</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	13 861	9 475
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES</b>					
USD	10 970 000	Obligation du Trésor américain, 3 %, 15 août 2052	11 989 130	11 367 308	
USD	5 310 000	Obligation du Trésor américain, 3,63 %, 15 février 2053	6 939 528	6 220 947	
USD	3 985 000	Obligation du Trésor américain, 3,75 %, 31 décembre 2028	5 326 355	5 316 346	
USD	2 064 600	Obligation du Trésor américain, 4 %, 31 janvier 2029	2 768 862	2 783 212	
USD	500 000	Obligation du Trésor américain, 4,13 %, 31 mars 2029	676 720	677 572	
USD	7 950 000	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 15 février 2054	10 237 927	10 423 965	
USD	24 900 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 30 novembre 2030	34 049 714	34 133 638	
USD	49 985 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 15 mai 2034	68 919 125	68 558 277	
USD	24 970 000	Obligation du Trésor américain, 4,50 %, 31 mai 2029	34 416 036	34 419 079	
USD	45 060 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 30 avril 2029	62 125 202	62 400 439	
USD	28 750 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 31 mai 2031	40 164 419	40 019 738	
USD	2 300 000	Obligation du Trésor américain, 4,75 %, 15 novembre 2043	3 258 798	3 203 054	
USD	15 160 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 30 avril 2026	20 767 773	20 772 854	
USD	3 230 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 31 mai 2026	4 410 749	4 427 950	
USD	340 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 31 octobre 2028	470 271	474 140	
USD	1 870 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 31 octobre 2030	2 608 547	2 633 602	
USD	7 042 828	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,25 %, 15 avril 2028	9 461 354	9 310 074	
USD	15 411 707	Obligation du Trésor américain, indexée à l'inflation, 1,75 %, 15 janvier 2034	20 491 670	20 517 328	
USD	1 666 911	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 avril 2029	2 280 479	2 284 831	
			341 362 659	339 944 354	43,2
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>					
	1 670 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série 101, 1,6 %, 15 décembre 2031	1 419 383	1 434 517	
	5 600 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 4,25 %, 15 mars 2034	5 716 424	5 752 212	
	5 815 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er juin 2031	5 047 556	5 110 355	
	27 125 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er décembre 2031	23 580 566	23 609 664	
	27 905 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1er décembre 2053	19 519 198	19 366 075	
	3 165 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er septembre 2027	3 090 924	3 082 544	
	3 000 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er décembre 2055	2 458 393	2 628 879	
	75 235 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1er juin 2034	71 064 148	72 101 342	
	12 180 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er septembre 2028	11 833 852	12 044 389	
	122 135 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er décembre 2033	120 084 566	119 664 484	
	45 445 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1er mars 2028	45 336 413	45 312 423	
	4 945 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mai 2026	4 932 225	4 945 327	
	13 200 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mars 2029	13 427 445	13 474 016	
			327 511 093	328 526 227	41,8
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>					
	4 070 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	4 023 236	4 035 524	
	18 105 000	Province de l'Ontario, 4,15 %, 2 juin 2034	17 935 570	18 048 599	
	25 295 000	Province de l'Ontario, 4,15 %, 2 décembre 2054	24 602 402	24 566 173	
	3 070 000	Province de l'Ontario, 5,6 %, 2 juin 2035	3 470 635	3 429 517	
			50 031 843	50 079 813	6,4
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>					
USD	80 000	American Tower Corp., 1,45 %, 15 septembre 2026	89 690	100 459	
	375 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	376 726	373 869	
	1 480 000	AT&T Inc., 4 %, 25 novembre 2025	1 446 990	1 460 445	
	825 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), 2,16 %, 3 février 2025	849 288	811 697	
	1 455 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	1 395 956	1 436 502	
	450 000	Bell Canada, 5,15 %, 24 août 2034	448 407	450 981	
USD	535 000	Boeing Co. (The), 4,88 %, 1er mai 2025	717 528	724 267	
	950 000	BP Capital Markets PLC, 3,47 %, 15 mai 2025	930 839	938 888	
USD	128 000	BP Capital Markets PLC, convertibles, taux variable, 22 juin 2025	166 167	172 105	
	630 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janvier 2027	628 565	595 622	

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES (suite)</b>					
	955 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	987 480	951 141	
	1 935 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	1 898 090	1 928 971	
	475 000	FPI Propriétés de Choix, série Q, 2,46 %, 30 novembre 2026	475 000	451 493	
USD	15 000	Citigroup Inc., 4 %, 5 août 2024	19 945	20 479	
	830 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	811 494	819 306	
	2 525 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	2 502 753	2 534 869	
	825 000	Enbridge Gas Inc., 5,7 %, 6 octobre 2033	883 154	885 096	
USD	1 005 000	Freeport-McMoRan Inc., 4,13 %, 1er mars 2028	1 280 050	1 319 187	
	1 500 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 31 octobre 2025	1 449 240	1 490 741	
USD	435 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 4 février 2032	505 476	485 079	
	240 000	Loblaw Cos., Ltd., 5,12 %, 4 mars 2054	238 903	238 620	
	1 690 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	1 756 183	1 670 247	
	1 915 000	McDonald's Corp., 4,86 %, 21 mai 2031	1 915 000	1 940 364	
	775 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	774 813	748 682	
	745 000	Pembina Pipeline Corp., 5,67 %, 12 janvier 2054	744 464	751 729	
	1 150 000	Pembina Pipeline Corp., 5,72 %, 22 juin 2026	1 150 616	1 149 704	
	1 230 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 2,7 %, 30 septembre 2024	1 215 990	1 222 193	
	875 000	FPI RioCan, 6,49 %, 29 septembre 2026	878 972	876 329	
USD	1 800 000	Rogers Communications Inc., 2,95 %, 15 mars 2025	2 297 989	2 414 919	
	925 000	Rogers Communications Inc., 3,1 %, 15 avril 2025	884 614	911 158	
	520 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	559 408	506 222	
	1 145 000	Banque Royale du Canada, 3,37 %, 24 mars 2025	1 093 200	1 124 900	
	545 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2080	545 000	531 686	
	1 245 000	Saputo Inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	1 198 537	1 234 452	
	2 430 000	Groupe SNC-Lavalin Inc., série 6, 3,8 %, 19 août 2024	2 405 189	2 423 667	
	400 000	Suncor Énergie Inc., 5,6 %, 17 novembre 2025	399 464	403 575	
	1 150 000	Sysco Canada Inc., 3,65 %, 25 avril 2025	1 129 484	1 137 837	
	2 005 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	2 018 652	1 958 627	
USD	270 000	T-Mobile USA Inc., 4,95 %, 15 mars 2028	363 689	367 190	
	680 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	707 560	668 820	
	2 100 000	TWDC Enterprises 18 Corp., 2,76 %, 7 octobre 2024	2 065 680	2 088 330	
USD	830 000	Verizon Communications Inc., 3,15 %, 22 mars 2030	1 011 751	1 025 170	
	1 200 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	1 199 695	913 019	
	1 170 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	1 201 684	1 122 729	
			45 619 375	45 381 366	5,8
<b>PLACEMENT(S) À COURT TERME</b>					
	4 415 000	Gouvernement du Canada, 3,516 %, 4 juillet 2024	4 403 124	4 403 124	0,6
		<b>Total des placement(s) à court terme</b>	<b>4 403 124</b>	<b>4 403 124</b>	<b>0,6</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>768 928 094</b>	<b>768 334 884</b>	<b>97,8</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-	
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>768 928 094</b>	<b>768 334 884</b>	<b>97,8</b>
		Contrat(s) de change à terme		2 377 977	0,3
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>768 928 094</b>	<b>770 712 861</b>	<b>98,1</b>
		Autres actifs (passifs) nets		15 046 204	1,9
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>785 759 065</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	374 745 800	USD	272 088 260	1,38	2 621 026
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	11 498 060	USD	8 383 017	1,37	32 927
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	1 000 000	USD	727 876	1,37	4 511
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	552 809	USD	402 198	1,37	2 738
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	838 461	USD	611 601	1,37	1 997
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	100 000	USD	72 791	1,37	446
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	264 574	USD	193 750	1,37	(410)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	305 259	CAD	419 270	0,73	(1 779)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	611 601	CAD	838 461	0,73	(1 997)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	402 198	CAD	552 809	0,73	(2 738)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	3 836 626	CAD	5 250 000	0,73	(2 793)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	2 921 657	CAD	4 000 000	0,73	(4 160)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	8 383 017	CAD	11 498 060	0,73	(32 927)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	27 712 212	CAD	38 139 802	0,73	(238 864)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>2 377 977</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	2 664	(286)	-	2 378
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2 664</b>	<b>(286)</b>	<b>-</b>	<b>2 378</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(286)	286	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(286)</b>	<b>286</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	9 266	(1 026)	-	8 240
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>9 266</b>	<b>(1 026)</b>	<b>-</b>	<b>8 240</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 026)	1 026	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1 026)</b>	<b>1 026</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	72 641 600	69 299 300	2 720 700	1 515 000
Parts rachetables émises	12 803 000	12 779 600	2 240 000	1 744 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(8 540 000)	(8 742 700)	(3 060 000)	(520 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>76 904 600</b>	<b>73 336 200</b>	<b>1 900 700</b>	<b>2 739 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	123 657	-
Garanties (hors trésorerie)	129 939	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	113	77
Charges	(34)	(23)
Revenu tiré des prêts de titres	79	54
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,0</b>

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations - Obligations d'état étrangères	44,6
Obligations - Obligations de sociétés canadiennes	43,5
Obligations - Obligations de sociétés	10,1
Contrat(s) de change à terme	1,1
Autres actifs (passifs) nets	0,7
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

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

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	86,0
AA/Aa/A+	6,4
A	1,3
BBB/Baa/B++	4,0
BB/Ba/B+	0,4
<b>Total</b>	<b>98,1</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	89,4
AA/Aa/A+	0,1
A	2,8
BBB/Baa/B++	6,5
BB/Ba/B+	0,6
<b>Total</b>	<b>99,4</b>

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

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



# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	356 003	(325 923)	30 080	3,8
<b>Total</b>	<b>356 003</b>	<b>(325 923)</b>	<b>30 080</b>	<b>3,8</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	368 483	(324 445)	44 038	5,7
<b>Total</b>	<b>368 483</b>	<b>(324 445)</b>	<b>44 038</b>	<b>5,7</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 3 008 000 \$ (4 404 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2024

Exposition aux taux d'intérêt	Moins de 1 an	1 - 3 ans	3 - 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
	27 470	42 712	197 301	500 852	768 335

au 31 décembre 2023

Exposition aux taux d'intérêt	Moins de 1 an	1 - 3 ans	3 - 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
	35 354	59 939	212 972	447 768	756 033

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 13 950 000 \$ (13 179 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Obligations	-	763 932	-	763 932
Placement(s) à court terme	-	4 403	-	4 403
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	2 378	-	2 378
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>770 713</b>	<b>-</b>	<b>770 713</b>

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

# FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	756 033	-	756 033
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	8 240	-	8 240
<b>Total</b>	-	<b>764 273</b>	-	<b>764 273</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	5 807	2 113
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	17	10
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	5 824	2 123
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
	1	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 823</b>	<b>2 123</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	5 823	2 123	23,29	21,23	250 000	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	58	9
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	14	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	166	17
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>238</b>	<b>26</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(2)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>238</b>	<b>24</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Retenues d'impôts	5	-
<b>Total des charges</b>	<b>9</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>229</b>	<b>23</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	229	23	1,76	0,44	129 945	52 564

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 123	-	2 123	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	229	23	229	23
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(16)	-	(16)	-
Profits nets réalisés	(12)	-	(12)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(28)	-	(28)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	3 499	1 998	3 499	1 998
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	3 499	1 998	3 499	1 998
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	3 700	2 021	3 700	2 021
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	5 823	2 021	5 823	2 021

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

États financiers (non audités)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	229	23
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(14)	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(166)	(17)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	220	2
Achat de placements et de dérivés	(237)	(1 005)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>34</b>	<b>(997)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(28)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	1	1 004
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(27)</b>	<b>1 004</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	7	7
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	10	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>17</b>	<b>7</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	53	9
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.

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	92 822	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	1 961 832	2 009 595	
	70 926	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	1 656 481	1 851 878	
USD	15 193	iShares Core MSCI EAFE ETF	1 474 804	1 509 807	
USD	5 954	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	419 063	436 022	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>5 512 180</b>	<b>5 807 302</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>5 504 049</b>	<b>5 807 302</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		15 979	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>5 823 281</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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	126 660	1 852	1,5
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	2 009	1,1
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	1 510	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	436	-

au 31 décembre 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	89 811	650	0,7
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	698	0,5
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	552	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	213	-

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



# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	1	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	150 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	250 000	100 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	2 009
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	1 852

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	656
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	609

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

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	34,5
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	31,8
iShares Core MSCI EAFE ETF	25,9
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	7,5
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	32,9
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	30,6
iShares Core MSCI EAFE ETF	26,0
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	10,0
Autres actifs (passifs) nets	0,5
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 581 000 \$ (211 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	1 949	-	1 949	33,5
<b>Total</b>	<b>1 949</b>	<b>-</b>	<b>1 949</b>	<b>33,5</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	775	-	775	36,5
<b>Total</b>	<b>775</b>	<b>-</b>	<b>775</b>	<b>36,5</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 195 000 \$ (78 000 \$ au 31 décembre 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.

# FNB de répartition de l'actif en actions CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	5 807	-	-	5 807
<b>Total</b>	<b>5 807</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5 807</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 113	-	-	2 113
<b>Total</b>	<b>2 113</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 113</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	3 897	908
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2	-
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	4	16
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	5	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	3 908	924
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	7	-
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	5	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	2	2
	15	2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>3 893</b>	<b>922</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	3 893	922	25,95	18,44	150 000	50 000

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2	1
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	629	(55)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	606	359
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 237</b>	<b>305</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	5	3
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(1)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>5</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 242</b>	<b>307</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	5	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	1	-
<b>Total des charges</b>	<b>11</b>	<b>3</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 231</b>	<b>304</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	1 231	304	13,58	6,06	90 659	50 000

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	922	387	922	387
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 231	304	1 231	304
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	(1)	-	(1)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	(1)	-	(1)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	1 740	-	1 740	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 740	-	1 740	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 971	303	2 971	303
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	3 893	690	3 893	690

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



# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 231	304
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(629)	55
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(606)	(359)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	1
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 075	326
Achat de placements et de dérivés	(1 219)	(336)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	1
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(142)	(8)
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)	(1)
Produit de l'émission de parts rachetables	145	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	144	(1)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	2	(9)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	-	9
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2	-
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2	1
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.

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U.</b>					
USD	169	Advanced Micro Devices Inc.	33 217	37 511	
USD	154	Alphabet Inc., catégorie A	30 719	38 384	
USD	30 580	Applied Blockchain Inc.	164 942	248 972	
USD	47 898	Bit Digital Inc.	173 925	208 421	
USD	434	Block Inc.	42 490	38 298	
USD	26 781	Cipher Mining Inc.	127 082	152 080	
USD	7 439	CleanSpark Inc.	125 431	162 358	
USD	540	Coinbase Global Inc., catégorie A	129 550	164 208	
USD	13 567	Core Scientific Inc.	54 584	172 649	
USD	12 030	Galaxy Digital Holdings Ltd.	123 121	192 239	
USD	61	Goldman Sachs Group Inc. (The)	31 987	37 755	
USD	42 024	Hive Digital Technologies Ltd.	166 070	177 111	
USD	11 610	Hut 8 Corp.	137 464	238 139	
USD	140	JPMorgan Chase & Co.	32 680	38 747	
USD	6 682	Marathon Digital Holdings Inc.	131 554	181 495	
USD	189	Micron Technology Inc.	26 139	34 016	
USD	61	Microsoft Corp.	32 415	37 307	
USD	90	MicroStrategy Inc., catégorie A	115 222	169 639	
USD	209	NVIDIA Corp.	19 163	35 331	
USD	439	Paypal Holdings Inc.	39 131	34 859	
USD	12 171	Riot Blockchain Inc.	139 245	152 219	
USD	1 160	Robinhood Markets Inc., catégorie A	23 498	36 047	
USD	3 977	SoFi Technologies Inc.	37 610	35 971	
USD	32 834	TeraWulf Inc.	85 874	199 931	
USD	148	Tesla Inc.	35 672	40 074	
USD	100	Visa Inc., catégorie A	36 175	35 915	
USD	446	Western Alliance Bancorp	31 925	38 338	
			<b>2 126 885</b>	<b>2 938 014</b>	<b>75,5</b>
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	5 717	Northern Data AG	195 387	199 543	5,1
<b>ÎLES CAÏMANS</b>					
USD	129 743	Canaan Inc., CAEE	206 067	177 498	4,6
<b>CANADA</b>					
USD	47 557	Bitfarms Ltd. of Canada	108 825	167 242	4,3
<b>AUSTRALIE</b>					
USD	9 754	Iris Energy Ltd.	60 703	150 686	3,9
<b>CHINE</b>					
HKD	84 155	Meitu Inc.	41 403	38 938	
HKD	556	Tencent Holdings Ltd.	29 480	36 289	
			<b>70 883</b>	<b>75 227</b>	<b>1,9</b>
<b>JAPON</b>					
JPY	5 287	Rakuten Group Inc.	35 795	37 324	
JPY	1 073	SBI Holdings Inc.	33 980	37 121	
			<b>69 775</b>	<b>74 445</b>	<b>1,9</b>
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	495	Aker ASA, catégorie A	38 562	39 123	1,0
<b>CORÉE DU SUD</b>					
USD	19	Samsung Electronics Co., Ltd., CIAE	35 903	38 478	1,0

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TAÏWAN</b>					
USD	156	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	26 630	37 102	0,9
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>2 939 620</b>	<b>3 897 358</b>	<b>100,1</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(7 351)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>2 932 269</b>	<b>3 897 358</b>	<b>100,1</b>
Contrat(s) de change à terme				(2 828)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>2 932 269</b>	<b>3 894 530</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				(1 531)	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>3 892 999</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	134 603	EUR	90 752	1,48	1 512
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	77 604	HKD	443 650	0,17	(152)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	55 025	JPY	6 277 676	0,01	1 624
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	3 006	JPY	343 099	0,01	88
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	378 448	USD	277 817	1,36	(1 703)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	2 317 609	USD	1 696 752	1,37	(4 141)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	85 078	CAD	124 781	0,68	(11)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	5 674	CAD	8 412	0,67	(90)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	26 284	CAD	4 584	5,73	23
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	417 366	CAD	73 173	5,70	(24)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	6 620 775	CAD	56 436	117,31	(117)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	1 974 569	CAD	2 702 467	0,73	(566)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	126 191	EUR	85 978	1,47	7
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	73 020	HKD	416 418	0,18	19
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	58 031	JPY	6 781 808	0,01	110
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	2 696 057	USD	1 971 262	1,37	593
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(2 828)</b>

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

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	4	(4)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>4</b>	<b>(4)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(7)	4	-	(3)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(7)</b>	<b>4</b>	<b>-</b>	<b>(3)</b>

au 31 décembre 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	16	-	-	16
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>16</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>16</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	4	1
Paielements indirects†	2	1

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	50 000
Parts rachetables émises	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	150 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	1 096	-
Garanties (hors trésorerie)	1 156	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	7	4
Charges	(2)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	5	3
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,5</b>

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - É.-U.	83,8
Actions - Canada	8,9
Actions - Japon	2,6
Contrat(s) de change à terme	1,7
Actions - Chine	1,5
Actions - Corée du Sud	0,9
Actions - Taïwan	0,8
Autres actifs (passifs) nets	(0,2)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,7
<b>Total</b>	<b>1,7</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

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

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy des actions mondiales axées sur les cryptomonnaies (couvert en \$ CA)	389 727

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy des actions mondiales axées sur les cryptomonnaies (couvert en \$ CA)	90 805

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

# FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	3 317	(2 695)	622	16,0
Euro	200	(126)	74	1,9
Couronne norvégienne	39	-	39	1,0
Yen japonais	76	(58)	18	0,5
Dollar de Hong Kong	75	(73)	2	0,1
<b>Total</b>	<b>3 707</b>	<b>(2 952)</b>	<b>755</b>	<b>19,5</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	803	(548)	255	27,7
Yen japonais	24	(12)	12	1,3
Dollar de Hong Kong	14	(12)	2	0,2
<b>Total</b>	<b>841</b>	<b>(572)</b>	<b>269</b>	<b>29,2</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 76 000 \$ (27 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	3 897	-	-	3 897
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(3)	-	(3)
<b>Total</b>	<b>3 897</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>3 894</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	908	-	-	908
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	16	-	16
<b>Total</b>	<b>908</b>	<b>16</b>	<b>-</b>	<b>924</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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



# FNB indiciel métavers CI Galaxy

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	1 290	1 140
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2	2
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2	30
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1	1
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	1 295	1 173
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2	1
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	2	2
	5	3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 290	1 170

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	1 290	1 170	25,81	23,39	50 000	50 000

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	7	5
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	119	53
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2	175
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>128</b>	<b>233</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>128</b>	<b>233</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	3	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	1	1
<b>Total des charges</b>	<b>5</b>	<b>4</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>123</b>	<b>229</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	123	229	2,46	4,58	50 000	50 000

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 170	823	1 170	823
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	123	229	123	229
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1)	(1)	(1)	(1)
Profits nets réalisés	(2)	-	(2)	-
Remboursement de capital	-	(1)	-	(1)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(3)	(2)	(3)	(2)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	120	227	120	227
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 290	1 050	1 290	1 050

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	123	229
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(119)	(53)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2)	(175)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	299	204
Achat de placements et de dérivés	(300)	(205)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	1
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>2</b>	<b>1</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2)	(2)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2)</b>	<b>(2)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	-	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>2</b>	<b>-</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6	4
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.

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	96	Alphabet Inc., catégorie A	15 041	23 928	
USD	947	AT&T Inc.	22 075	24 763	
USD	1 080	Bilibili Inc., CAAE	23 303	22 818	
USD	123	Electronic Arts Inc.	19 953	23 450	
HKD	2 551	Kuaishou Technology	24 167	20 634	
USD	14 066	Lumen Technologies Inc.	34 514	21 172	
USD	530	Match Group Inc.	33 819	22 032	
USD	33	Meta Platforms Inc., catégorie A	8 173	22 768	
USD	181	NetEase Inc., CAAE	21 412	23 672	
JPY	943	Nexon Co., Ltd.	23 729	23 864	
USD	471	ROBLOX Corp., catégorie A	20 803	23 982	
USD	224	Sea Ltd., CAAE	16 705	21 891	
USD	807	SK Telecom Co., Ltd., CAAE	22 498	23 112	
USD	1 072	Snap Inc., catégorie A	20 194	24 365	
USD	106	Take-Two Interactive Software Inc.	17 496	22 553	
HKD	344	Tencent Holdings Ltd.	18 508	22 452	
USD	1 127	Tencent Music Entertainment, CAAE	7 642	21 667	
USD	96	T-Mobile US Inc.	16 968	23 143	
EUR	712	Ubisoft Entertainment SA	28 663	21 343	
EUR	539	Universal Music Group NV	16 035	21 959	
USD	421	Verizon Communications Inc.	23 731	23 757	
USD	167	Walt Disney Co. (The)	22 369	22 689	
USD	528	Warner Music Group Corp., catégorie A	20 786	22 144	
			478 584	524 158	40,6
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	36	Adobe Inc.	21 403	27 366	
USD	105	Advanced Micro Devices Inc.	14 877	23 306	
USD	189	Akamai Technologies Inc.	25 528	23 296	
USD	78	Apple Inc.	16 931	22 480	
USD	75	Autodesk Inc.	20 406	25 395	
USD	228	CloudFlare Inc., catégorie A	21 328	25 842	
USD	2 302	Fastly Inc., catégorie A	35 508	23 215	
USD	104	Globant SA	27 743	25 368	
USD	550	Intel Corp.	27 410	23 308	
USD	99	International Business Machines Corp.	18 146	23 429	
HKD	12 038	Lenovo Group Ltd.	15 304	23 250	
USD	230	Marvell Technology Inc.	15 277	21 999	
USD	38	Microsoft Corp.	16 188	23 240	
USD	4 512	Nokia OYJ, CAAE	25 032	23 338	
USD	129	NVIDIA Corp.	3 812	21 807	
USD	120	Oracle Corp.	20 387	23 185	
USD	96	PTC Inc.	14 964	23 864	
USD	77	QUALCOMM Inc.	13 820	20 986	
USD	157	Skyworks Solutions Inc.	22 641	22 897	
USD	19	Super Micro Computer Inc.	7 304	21 302	
USD	97	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	11 776	23 070	
USD	998	Unity Software Inc.	40 997	22 205	
			436 782	514 148	39,9

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	268	Block Inc.	26 995	23 650	
USD	68	Coinbase Global Inc., catégorie A	5 587	20 678	
	1 507	Galaxy Digital Holdings Ltd.	20 118	24 082	
USD	38	Mastercard Inc., catégorie A	19 038	22 939	
USD	62	Visa Inc., catégorie A	18 366	22 267	
			90 104	113 616	8,8
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	221	Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	24 344	21 773	
USD	91	Amazon.com Inc.	14 908	24 063	
USD	429	DraftKings Inc., catégorie A	9 426	22 407	
JPY	198	Sony Group Corp.	22 304	22 974	
			70 982	91 217	7,1
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	22	Equinix Inc.	21 859	22 776	
USD	1 561	eXp World Holdings Inc.	26 570	24 105	
			48 429	46 881	3,6
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>1 124 881</b>	<b>1 290 020</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(798)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>1 124 083</b>	<b>1 290 020</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme				(162)	0,0
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>1 124 083</b>	<b>1 289 858</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				511	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>1 290 369</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	48 434	EUR	32 655	1,48	544
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 130	EUR	763	1,48	12
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	5 038	HKD	28 887	0,17	(25)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	80 200	HKD	458 493	0,17	(157)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	43 696	JPY	4 985 125	0,01	1 290
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 007	JPY	114 885	0,01	30
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 042 873	USD	763 501	1,37	(1 864)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	33 418	CAD	49 012	0,68	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	487 380	CAD	85 448	5,70	(28)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	5 100 010	CAD	43 473	117,31	(90)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	1 641	CAD	2 235	0,73	10
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	761 860	CAD	1 042 710	0,73	(218)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	49 564	EUR	33 770	1,47	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	85 238	HKD	486 093	0,18	22
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	44 702	JPY	5 224 119	0,01	85
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	1 040 638	USD	760 878	1,37	228
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(162)</b>

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

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

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

au 31 décembre 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	30	(1)	-	29
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>30</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>29</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1)	1	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(1)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	50 000
Parts rachetables émises	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	50 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	134	-
Garanties (hors trésorerie)	142	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Technologies de l'information	40,0
Actions - Services de communication	39,6
Actions - Services financiers	7,5
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	7,0
Actions - Immobilier	3,4
Contrat(s) de change à terme	2,5
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>^*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	2,6
<b>Total</b>	<b>2,6</b>

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

<sup>\*</sup>Veillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

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

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy des mondes numériques immersifs (couvert en \$ CA)	128 964

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Alerian Galaxy des mondes numériques immersifs (couvert en \$ CA)	114 010

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

# FNB indiciel métavers CI Galaxy

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	1 110	(1 040)	70	5,4
Yen japonais	47	(45)	2	0,2
Euro	44	(50)	(6)	(0,5)
Dollar de Hong Kong	67	(85)	(18)	(1,4)
<b>Total</b>	<b>1 268</b>	<b>(1 220)</b>	<b>48</b>	<b>3,7</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	1 006	(953)	53	4,5
Dollar de Hong Kong	60	(57)	3	0,3
Euro	39	(37)	2	0,2
Yen japonais	37	(38)	(1)	(0,1)
<b>Total</b>	<b>1 142</b>	<b>(1 085)</b>	<b>57</b>	<b>4,9</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 5 000 \$ (6 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

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

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	1 290	-	-	1 290
<b>Total</b>	<b>1 290</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1 290</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	1 140	-	-	1 140
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	29	-	29
<b>Total</b>	<b>1 140</b>	<b>29</b>	<b>-</b>	<b>1 169</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	6 678	3 786
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	167	43
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1	1
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	6 846	3 830
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	5	16
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	5	2
Frais d'administration à payer	1	1
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	9
	11	28
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>6 835</b>	<b>3 802</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB en						
\$ CA	5 997	3 187	23,99	18,22	250 000	175 000
Série FNB couverte en						
\$ US	838	615	24,52*	18,58*	25 000	25 000

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

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	13	7
Intérêts aux fins des distributions	3	1
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	210	(52)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 318	851
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>1 544</b>	<b>807</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	1	-
Autres revenus	9	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>10</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>1 554</b>	<b>808</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	22	10
Frais d'administration (note 5)	4	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	2	1
Taxe de vente harmonisée	2	2
Autres frais	4	5
<b>Total des charges</b>	<b>36</b>	<b>23</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>1 518</b>	<b>785</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Série FNB en						
\$ CA	1 295	424	5,77	4,24	224 451	100 000
Série FNB couverte en						
\$ US	223	361	8,93	5,89	25 000	61 326

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série FNB en \$ CA			Série FNB couverte en \$ US			Total du Fonds
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	3 187	1 222	615	1 256	3 802	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 295	424	223	361	1 518	785	
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>							
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	
Remboursement de capital	(1)	-	-	-	(1)	-	
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1)	-	-	-	(1)	-	
<b>Transactions sur parts rachetables</b>							
Produit de l'émission de parts rachetables	1 516	-	-	-	1 516	-	
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	
Rachat de parts rachetables	-	-	-	(508)	-	(508)	
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 516	-	-	(508)	1 516	(508)	
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 810	424	223	(147)	3 033	277	
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	5 997	1 646	838	1 109	6 835	2 755	

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 518	785
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(210)	52
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 318)	(851)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 300	904
Achat de placements et de dérivés	(1 299)	(784)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(9)	1
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	(15)	110
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	140	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(74)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	139	(74)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	124	36
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	43	81
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	167	117
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	3	1
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10	6
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.

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		É.-U.			
USD	269	Adobe Inc.	174 096	204 442	
USD	498	Advanced Micro Devices Inc.	85 204	110 512	
USD	1 330	Alphabet Inc., catégorie C	237 453	333 734	
USD	1 381	Amazon.com Inc.	261 183	365 103	
USD	596	Analog Devices Inc.	150 419	186 114	
USD	1 228	Apple Inc.	281 530	353 834	
USD	675	Applied Materials Inc.	154 269	217 921	
USD	294	Arista Networks Inc.	70 969	140 965	
USD	142	Broadcom Inc.	207 760	311 895	
USD	281	CrowdStrike Holdings Inc., catégorie A	121 320	147 307	
USD	173	Danaher Corp.	54 212	59 133	
USD	243	Eli Lilly and Co.	191 728	300 981	
	16 767	Galaxy Digital Holdings Ltd.	244 317	267 937	
USD	2 048	Intel Corp.	120 967	86 771	
USD	233	Intuitive Surgical Inc.	99 853	141 798	
USD	140	Lam Research Corp.	111 572	203 947	
USD	2 641	Marvell Technology Inc.	213 552	252 550	
USD	456	Meta Platforms Inc., catégorie A	209 158	314 548	
USD	378	Micron Technology Inc.	68 798	68 017	
USD	681	Microsoft Corp.	327 164	416 397	
USD	4 020	NVIDIA Corp.	245 623	679 416	
USD	392	Salesforce Inc.	119 015	137 876	
USD	345	ServiceNow Inc.	301 378	371 290	
USD	110	Thermo Fisher Scientific Inc.	76 344	83 218	
USD	1 085	Trade Desk Inc. (The)	102 910	144 975	
			4 230 794	5 900 681	86,3
		<b>TAÏWAN</b>			
USD	1 173	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	162 291	278 917	4,1
		<b>CANADA</b>			
USD	1 653	Shopify Inc., catégorie A	168 575	149 365	2,2
		<b>PAYS-BAS</b>			
EUR	85	ASML Holding NV	79 373	120 076	1,8
		<b>ISRAËL</b>			
USD	299	CyberArk Software Ltd.	99 914	111 842	1,6
		<b>JAPON</b>			
JPY	100	Keyence Corp.	75 205	59 989	0,9
		<b>FRANCE</b>			
EUR	1 099	Dassault Systemes SE	78 357	56 839	0,8
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>4 894 509</b>	<b>6 677 709</b>	<b>97,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(1 310)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>4 893 199</b>	<b>6 677 709</b>	<b>97,7</b>
		Contrat(s) de change à terme		(5 295)	(0,1)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>4 893 199</b>	<b>6 672 414</b>	<b>97,6</b>
		Autres actifs (passifs) nets		163 066	2,4
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>6 835 480</b>	<b>100,0</b>

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



# FNB alpha Innovation mondiale CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	11 056	USD	8 087	1,37	(4)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	19 012	USD	13 923	1,37	(29)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	11 933	CAD	16 311	0,73	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	8 896	CAD	12 181	0,73	(15)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	10 757	CAD	14 772	0,73	(59)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	11 035	CAD	15 159	0,73	(68)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	595 098	CAD	819 022	0,73	(5 129)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(5 295)</b>

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

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

au 31 décembre 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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(16)	-	-	(16)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(16)	-	-	(16)

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	1	1
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	175 000	100 000	25 000	75 000
Parts rachetables émises	75 000	-	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	-	(25 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>250 000</b>	<b>100 000</b>	<b>25 000</b>	<b>50 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - É.-U.	80,2
Actions - Japon	4,3
Actions - Canada	4,1
Actions - Pays-Bas	4,0
Actions - Taïwan	3,1
Actions - Jersey	2,0
Actions - France	1,9
Autres actifs (passifs) nets	0,8
Contrat(s) de change à terme	(0,4)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 668 000 \$ (379 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	6 196	842	7 038	103,0
Euro	179	-	179	2,6
Yen japonais	61	-	61	0,9
<b>Total</b>	<b>6 436</b>	<b>842</b>	<b>7 278</b>	<b>106,5</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	3 404	614	4 018	105,7
Yen japonais	164	-	164	4,3
Euro	151	-	151	4,0
<b>Total</b>	<b>3 719</b>	<b>614</b>	<b>4 333</b>	<b>114,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 728 000 \$ (433 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB alpha Innovation mondiale CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	6 678	-	-	6 678
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(5)	-	(5)
<b>Total</b>	<b>6 678</b>	<b>(5)</b>	<b>-</b>	<b>6 673</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	3 786	-	-	3 786
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(16)	-	(16)
<b>Total</b>	<b>3 786</b>	<b>(16)</b>	<b>-</b>	<b>3 770</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

États financiers (non audité)

## État de la situation financière

au 30 juin

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

	30 juin 2024
<b>Actif</b>	
<b>Actifs courants</b>	
Placements	557 466
Placements donnés en garantie	-
Trésorerie	1 132
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-
Swaps, options sur swaps et options	87
Montant à recevoir pour la vente de placements	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-
Dividendes à recevoir	45
Intérêts à recevoir	-
Rabais sur frais à recevoir	-
	558 730
<b>Passif</b>	
<b>Passifs courants</b>	
Placements vendus à découvert	-
Découvert bancaire	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-
Swaps, options sur swaps et options	-
Frais de gestion à payer	83
Frais d'administration à payer	108
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-
Comptes créditeurs et charges à payer	25
	216
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>558 514</b>

## État de la situation financière (suite)

au 30 juin

(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) : 30 juin 2024	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 30 juin 2024	Nombre de parts rachetables en circulation : 30 juin 2024
Série FNB en \$ CA	558 514	22,98	24 300 000

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

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

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

	2024
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	339
Intérêts aux fins des distributions	26
Distributions de revenu provenant des placements	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 100)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	46 092
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>45 357</b>
<b>Autres revenus</b>	
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	57
Rabais sur frais	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>57</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>45 414</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	349
Frais d'administration (note 5)	108
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9
Retenues d'impôts	53
Taxe de vente harmonisée	30
<b>Total des charges</b>	<b>549</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	(222)
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>45 087</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie : 2024	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2024	Nombre moyen pondéré de parts : 2024
Série FNB en			
\$ CA	45 087	2,35	19 150 909

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



# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Série FNB en \$ CA	Total du Fonds
	2024	2024
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	45 087	45 087
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	-	-
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	520 075	520 075
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(6 648)	(6 648)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	513 427	513 427
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	558 514	558 514
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	558 514	558 514

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

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	45 087
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 100
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(46 092)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	6 043
Achat de placements et de dérivés	(20 955)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(45)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	83
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	108
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	25
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(14 635)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-
Produit de l'émission de parts rachetables	15 828
Montant versé au rachat de parts rachetables	(59)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>15 769</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(2)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 134
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>1 132</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	26
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	241
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.

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
É.-U.					
USD	14 584	Adobe Inc.	9 668 339	11 083 935	
USD	97 201	Advanced Micro Devices Inc.	20 973 226	21 570 009	
USD	205 982	Alphabet Inc., catégorie C	49 056 609	51 686 595	
USD	173 017	Amazon.com Inc.	44 055 579	45 741 484	
USD	179 273	Apple Inc.	46 498 483	51 655 488	
USD	17 501	Applied Materials Inc.	5 108 624	5 650 129	
USD	13 127	Arista Networks Inc.	5 422 941	6 294 058	
USD	16 637	Broadcom Inc.	32 005 964	36 542 261	
USD	19 929	CloudFlare Inc., catégorie A	2 003 417	2 258 266	
USD	15 557	Coherent Corp.	1 230 542	1 542 148	
USD	23 329	CrowdStrike Holdings Inc., catégorie A	10 462 810	12 229 601	
USD	55 895	Datadog Inc., catégorie A	8 894 387	9 917 026	
USD	6 808	Dell Technologies Inc., catégorie C	1 313 754	1 284 450	
USD	36 705	Gitlab Inc., catégorie A	2 632 595	2 496 653	
USD	31 593	HP Inc.	1 368 306	1 513 592	
USD	58 323	Intel Corp.	2 442 407	2 471 058	
USD	2 434	Intuit Inc.	2 091 791	2 188 400	
USD	4 864	KLA Corp.	4 935 810	5 486 451	
USD	3 890	Lam Research Corp.	4 990 637	5 666 828	
USD	107 408	Marvell Technology Inc.	10 299 445	10 271 073	
USD	71 929	Meta Platforms Inc., catégorie A	46 743 512	49 616 493	
USD	63 185	Micron Technology Inc.	10 746 419	11 369 485	
USD	80 192	Microsoft Corp.	45 823 366	49 033 394	
USD	9 239	MongoDB Inc.	4 302 854	3 159 348	
USD	5 837	Netflix Inc.	4 960 348	5 389 124	
USD	413 110	NVIDIA Corp.	55 013 308	69 819 266	
USD	15 070	Oracle Corp.	2 486 878	2 911 051	
USD	78 735	Palantir Technologies Inc.	2 340 672	2 728 381	
USD	43 744	Pinterest Inc., catégorie A	2 522 667	2 637 324	
USD	9 721	QUALCOMM Inc.	2 526 342	2 648 858	
USD	19 441	Salesforce Inc.	7 098 539	6 837 898	
USD	15 069	ServiceNow Inc.	14 822 157	16 217 316	
USD	10 697	Snowflake Inc., catégorie A	2 249 934	1 976 911	
USD	6 808	Super Micro Computer Inc.	7 917 492	7 631 168	
USD	19 442	Tesla Inc.	4 689 640	5 263 138	
USD	39 857	Trade Desk Inc. (The)	4 941 821	5 325 591	
USD	38 399	Vertiv Holdings Co.	5 150 914	4 547 674	
USD	10 696	Vistra Corp.	1 339 746	1 258 117	
			491 132 275	535 920 042	95,9
<b>TAÏWAN</b>					
USD	52 005	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd., CAAE	10 668 091	12 365 789	2,2
<b>PAYS-BAS</b>					
USD	3 890	ASML Holding NV	4 978 003	5 442 677	1,0
<b>CHINE</b>					
USD	31 591	Baidu Inc., CAAE	4 600 114	3 737 498	0,7
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>511 378 483</b>	<b>557 466 006</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(85 814)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>511 292 669</b>	<b>557 466 006</b>	<b>99,8</b>
Position(s) acheteur sur option(s)				86 885	0,0
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>511 292 669</b>	<b>557 552 891</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				961 553	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>558 514 444</b>	<b>100,0</b>

## Position(s) acheteur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
290	Fiducie FNB SPDR S&P 500, (option de vente) – 495,00	100	20 septembre 2024	495,00	USD	167 834	86 885
<b>Valeur totale de la (des) position(s) acheteur sur option(s)</b>						<b>167 834</b>	<b>86 885</b>

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

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Commissions de courtage	9
Paielements indirects†	3

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Série FNB en \$ CA
	2024
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	-
Parts rachetables émises	24 600 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	(300 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	<b>24 300 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Série FNB en \$ CA	0,550

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

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

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-

# FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des options.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 55 747 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de change

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	557 491	87	557 578	99,8
<b>Total</b>	<b>557 491</b>	<b>87</b>	<b>557 578</b>	<b>99,8</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 55 758 000 \$. En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des options.

## Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	557 466	-	-	557 466
Option(s)	87	-	-	87
<b>Total</b>	<b>557 553</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>557 553</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024.

# FNB Secteur financier mondial CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	411 735	451 367
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	28 581	18
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	491	1 978
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	22 477	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	24	243
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	308	327
	463 616	453 933
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	458	32
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	316	323
Frais d'administration à payer	33	35
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	11 232	-
Montant à payer pour le rachat de parts	38 357	-
Comptes créditeurs et charges à payer	302	398
	50 698	788
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>412 918</b>	<b>453 145</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	412 918	453 145	25,81	23,29	16 000 113	19 460 113

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

# FNB Secteur financier mondial CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	7 836	12 807
Intérêts aux fins des distributions	33	127
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	26 202	(34 737)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	20 124	29 285
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>54 195</b>	<b>7 482</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	12	34
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(36)	(274)
Rabais sur frais	1 861	2 732
Autres revenus	55	19
<b>Total des autres revenus</b>	<b>1 892</b>	<b>2 511</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>56 087</b>	<b>9 993</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 917	2 780
Frais d'administration (note 5)	202	294
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	225	858
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	670	862
Taxe de vente harmonisée	13	33
Autres frais	11	16
<b>Total des charges</b>	<b>3 039</b>	<b>4 844</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>53 048</b>	<b>5 149</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	53 048	5 149	2,93	0,17	18 112 750	30 216 301

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



# FNB Secteur financier mondial CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	453 145	799 959	453 145	799 959
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	53 048	5 149	53 048	5 149
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(6 883)	(7 401)	(6 883)	(7 401)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(143)	(4 306)	(143)	(4 306)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(7 026)	(11 707)	(7 026)	(11 707)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	1 182	8 217	1 182	8 217
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(87 431)	(307 704)	(87 431)	(307 704)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(86 249)	(299 487)	(86 249)	(299 487)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(40 227)	(306 045)	(40 227)	(306 045)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	412 918	493 914	412 918	493 914

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

# FNB Secteur financier mondial CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	53 048	5 149
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(26 202)	34 737
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(20 124)	(29 285)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(11)	(8)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	225	858
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	135 349	483 694
Achat de placements et de dérivés	(58 947)	(195 884)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	218	291
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(7)	(239)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(1)	(25)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(77)	(37)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>83 471</b>	<b>299 251</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(7 027)	(11 708)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 182	8 217
Montant versé au rachat de parts rachetables	(49 074)	(307 704)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(54 919)</b>	<b>(311 195)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	11	8
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	28 552	(11 944)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	18	10 137
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>28 581</b>	<b>(1 799)</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	33	127
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	7 385	12 235
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.

# FNB Secteur financier mondial CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U.</b>					
USD	14 080	American Express Co.	2 630 360	4 460 149	
USD	39 468	Apollo Global Management Inc.	5 978 147	6 375 095	
USD	34 313	Arthur J. Gallagher & Co.	8 823 995	12 172 504	
USD	317 611	Bank of America Corp.	13 099 736	17 280 372	
USD	32 476	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	12 407 562	18 073 633	
USD	11 372	BlackRock Inc.	9 762 839	12 248 703	
USD	89 639	Citigroup Inc.	5 546 478	7 782 140	
USD	16 415	CME Group Inc.	4 503 552	4 414 956	
USD	12 145	Discover Financial Services	2 058 349	2 173 404	
USD	51 426	East West Bancorp Inc.	4 553 110	5 151 975	
USD	167 263	Equitable Holdings Inc.	5 881 525	9 349 755	
USD	15 039	Goldman Sachs Group Inc. (The)	7 963 898	9 306 079	
USD	49 652	Intercontinental Exchange Inc.	8 061 236	9 298 447	
USD	107 625	JPMorgan Chase & Co.	16 910 608	29 780 030	
USD	42 655	KKR & Co., Inc.	3 627 296	6 141 193	
USD	27 074	Marsh & McLennan Cos., Inc.	5 938 889	7 804 771	
USD	35 165	Mastercard Inc., catégorie A	16 097 827	21 223 095	
USD	15 892	Moody's Corp.	6 049 977	9 151 460	
USD	44 753	Progressive Corp. (The)	7 515 190	12 716 908	
USD	14 629	S&P Global Inc.	6 604 706	8 925 889	
USD	55 018	Visa Inc., catégorie A	16 205 217	19 755 428	
USD	225 808	Wells Fargo & Co.	12 519 590	18 346 559	
			182 740 087	251 932 545	61,0
<b>R.-U.</b>					
GBP	803 202	HSBC Holdings PLC	8 509 743	9 499 501	
GBP	4 347 876	Lloyds Banking Group PLC	4 131 176	4 115 905	
GBP	75 428	London Stock Exchange Group PLC	10 862 062	12 261 507	
GBP	209 337	Prudential PLC	4 437 593	2 600 733	
			27 940 574	28 477 646	6,9
<b>CANADA</b>					
	31 491	Banque de Montréal	4 112 299	3 616 112	
	230 590	Société Financière Manuvie	7 830 739	8 400 394	
	59 519	Banque Royale du Canada	7 477 988	8 668 942	
	38 024	Banque Toronto-Dominion (La)	3 160 789	2 859 405	
			22 581 815	23 544 853	5,7
<b>SUISSE</b>					
USD	20 973	Chubb Ltd.	5 363 431	7 318 784	
CHF	291 405	UBS Group AG, enregistrées	6 114 140	11 736 287	
			11 477 571	19 055 071	4,6
<b>ITALIE</b>					
EUR	2 019 611	Intesa Sanpaolo SPA	7 246 070	10 270 545	
EUR	171 121	UniCredit SPA	7 830 440	8 675 876	
			15 076 510	18 946 421	4,6
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	1 073	Adyen NV	2 347 151	1 750 024	
EUR	65 339	ASR Nederland NV	3 675 853	4 260 899	
EUR	330 102	ING Groep NV	6 201 414	7 719 810	
			12 224 418	13 730 733	3,3
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	148 597	BAWAG Group AG	11 017 262	12 866 745	3,1

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

# FNB Secteur financier mondial CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BERMUDES</b>					
GBP	1 436 448	Conduit Holdings Ltd.	11 151 663	12 271 574	3,0
<b>GUERNESEY</b>					
USD	522 044	Burford Capital Ltd.	7 027 274	9 320 079	2,3
<b>JAPON</b>					
JPY	616 151	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	8 328 399	9 058 475	2,2
<b>FRANCE</b>					
EUR	90 052	BNP Paribas SA	7 848 589	7 854 172	1,9
<b>HONG KONG</b>					
HKD	503 705	AIA Group Ltd.	7 211 435	4 676 876	1,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>324 625 597</b>	<b>411 735 190</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(580 512)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>324 045 085</b>	<b>411 735 190</b>	<b>99,7</b>
Contrat(s) de change à terme				32 706	0,0
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>324 045 085</b>	<b>411 767 896</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				1 150 305	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>412 918 201</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	5 516 474	USD	4 065 918	1,36	(44 064)
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	1 682 824	USD	1 229 514	1,37	2 433
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	691 185	USD	508 748	1,36	(4 126)
Banque de Montréal	A-1	17 septembre 2024	CAD	6 446 753	USD	4 742 324	1,36	(29 061)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	3 706 492	USD	2 702 559	1,37	12 876
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	2 796 613	USD	2 049 191	1,36	(4 038)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	17 septembre 2024	CAD	5 306 553	USD	3 882 621	1,37	4 694
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 septembre 2024	CAD	3 219 440	CHF	2 075 000	1,55	35 688
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 septembre 2024	CAD	12 810 806	EUR	8 579 000	1,49	217 339
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 septembre 2024	CAD	9 250 301	GBP	5 294 000	1,75	106 854
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	19 septembre 2024	CAD	1 445 943	HKD	8 240 100	0,18	1 896
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	19 septembre 2024	HKD	1 383 400	CAD	242 553	5,70	(117)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	5 516 901	USD	4 065 918	1,36	(43 637)
Citibank N.A., New York	A-1	13 août 2024	CAD	2 235 047	USD	1 639 353	1,36	(5 473)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	5 474 595	USD	4 065 918	1,35	(85 943)
Goldman Sachs International	A-1	13 août 2024	CAD	2 797 258	USD	2 049 191	1,37	(3 393)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	2 754 720	USD	2 032 959	1,36	(25 549)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 juillet 2024	CAD	2 201 719	USD	1 626 367	1,35	(22 496)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	1 682 326	USD	1 229 514	1,37	1 936
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	2 237 774	USD	1 639 353	1,37	(2 747)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	17 septembre 2024	CAD	6 445 838	USD	4 742 324	1,36	(29 976)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	18 septembre 2024	CAD	1 887 218	GBP	1 083 500	1,74	15 868
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	2 755 113	USD	2 032 959	1,36	(25 157)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	3 999 623	USD	2 953 033	1,35	(38 937)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 septembre 2024	CAD	5 308 824	USD	3 882 621	1,37	6 966
Banque Royale du Canada	A-1+	18 septembre 2024	CAD	2 095 966	EUR	1 421 500	1,47	9 288
Banque Royale du Canada	A-1+	18 septembre 2024	CAD	2 295 075	JPY	258 477 500	0,01	74 840
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 juillet 2024	CAD	5 472 784	USD	4 065 918	1,35	(87 753)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	13 août 2024	CAD	2 235 016	USD	1 639 353	1,36	(5 505)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>32 706</b>

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

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

# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	491	(88)	-	403
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>491</b>	<b>(88)</b>	<b>-</b>	<b>403</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(458)	88	-	(370)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(458)</b>	<b>88</b>	<b>-</b>	<b>(370)</b>

au 31 décembre 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	1 978	(32)	-	1 946
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 978</b>	<b>(32)</b>	<b>-</b>	<b>1 946</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(32)	32	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(32)</b>	<b>32</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	225	838
Paielements indirects†	84	296

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	19 460 113	37 330 113
Parts rachetables émises	50 000	350 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(3 510 000)	(14 450 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	16 000 113	23 230 113

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	3 576	-
Garanties (hors trésorerie)	3 767	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	18	48
Charges	(6)	(14)
Revenu tiré des prêts de titres	12	34
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,1</b>

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

# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
E.-U.	60,6
Canada	8,3
R.-U.	5,7
Suisse	4,9
Autriche	3,3
Italie	3,0
Guernesey	2,9
Pays-Bas	2,8
Bermudes	2,8
France	2,2
Hong Kong	1,9
Inde	1,2
Contrat(s) de change à terme	0,4
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 41 174 000 \$ (45 137 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	268 596	(77 693)	190 903	46,2
Euro	53 405	(14 680)	38 725	9,4
Livre sterling	40 749	(11 015)	29 734	7,2
Franc suisse	11 736	(3 184)	8 552	2,1
Yen japonais	9 058	(2 220)	6 838	1,7
Dollar de Hong Kong	4 677	(1 202)	3 475	0,8
Couronne danoise	9	-	9	0,0
<b>Total</b>	<b>388 230</b>	<b>(109 994)</b>	<b>278 236</b>	<b>67,4</b>

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



# FNB Secteur financier mondial CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	295 284	(53 097)	242 187	53,4
Euro	51 439	(12 573)	38 866	8,6
Livre sterling	38 598	(8 936)	29 662	6,5
Franc suisse	14 457	(3 290)	11 167	2,5
Dollar de Hong Kong	8 695	(2 165)	6 530	1,4
Roupie indienne	5 726	(1 192)	4 534	1,0
Couronne danoise	27	-	27	0,0
Couronne suédoise	3	-	3	0,0
<b>Total</b>	<b>414 229</b>	<b>(81 253)</b>	<b>332 976</b>	<b>73,4</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 27 824 000 \$ (33 298 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	411 735	-	-	411 735
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	33	-	33
<b>Total</b>	<b>411 735</b>	<b>33</b>	<b>-</b>	<b>411 768</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	451 367	-	-	451 367
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 946	-	1 946
<b>Total</b>	<b>451 367</b>	<b>1 946</b>	<b>-</b>	<b>453 313</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	257 550	135 268
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	172	204
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	634	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	154	85
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	258 510	135 557
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	74	40
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	332	-
Montant à payer pour le rachat de parts	347	-
Comptes créditeurs et charges à payer	10	40
	763	80
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>257 747</b>	<b>135 477</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires non couvertes	257 747	135 477	23,01	20,68	11 200 000	6 550 000

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

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

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	2 732	1 229
Intérêts aux fins des distributions	-	-
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	2 666	6
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	18 986	(441)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>24 384</b>	<b>794</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	2
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(11)	53
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	67	19
<b>Total des autres revenus</b>	<b>60</b>	<b>74</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>24 444</b>	<b>868</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	421	191
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	76	95
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charge d'intérêts	5	1
Retenues d'impôts	529	231
Taxe de vente harmonisée	21	18
<b>Total des charges</b>	<b>1 053</b>	<b>537</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>23 391</b>	<b>331</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires non couvertes	23 391	331	2,16	0,06	10 828 297	5 325 967

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

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

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	135 477	14 570	135 477	14 570
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23 391	331	23 391	331
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1 649)	(648)	(1 649)	(648)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	(17)	-	(17)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 649)	(665)	(1 649)	(665)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	150 827	177 561	150 827	177 561
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(50 299)	(3 099)	(50 299)	(3 099)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	100 528	174 462	100 528	174 462
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	122 270	174 128	122 270	174 128
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	257 747	188 698	257 747	188 698

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

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

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23 391	331
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 666)	(6)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(18 986)	441
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	76	95
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	17 746	7 004
Achat de placements et de dérivés	(46 183)	(57 332)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(69)	(112)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	34	50
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(30)	13
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(26 688)</b>	<b>(49 515)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 649)	(665)
Produit de l'émission de parts rachetables	42 225	51 156
Montant versé au rachat de parts rachetables	(13 921)	(882)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>26 655</b>	<b>49 609</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(33)	94
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	204	56
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>172</b>	<b>149</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 134	885
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(5)	(1)
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.

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		É.-U.			
USD	41 143	Abbott Laboratories	6 027 905	5 849 927	
USD	41 952	AbbVie Inc.	9 171 806	9 846 108	
USD	2 124	Acadia Healthcare Co., Inc.	223 095	196 297	
USD	7 010	Agilent Technologies Inc.	1 276 531	1 243 428	
USD	1 702	Align Technology Inc.	733 230	562 274	
USD	2 948	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	726 481	980 237	
USD	12 661	Amgen Inc.	4 666 155	5 413 095	
USD	2 421	Apellis Pharmaceuticals Inc.	217 805	127 078	
USD	11 992	Baxter International Inc.	664 512	548 890	
USD	6 891	Becton, Dickinson and Co.	2 262 105	2 203 722	
USD	3 420	Biogen Inc.	1 179 740	1 084 861	
USD	4 405	BioMarin Pharmaceutical Inc.	541 777	496 251	
USD	472	Bio-Rad Laboratories Inc., catégorie A	253 767	176 391	
USD	3 705	Bio-Techne Corp.	370 800	363 247	
USD	34 676	Boston Scientific Corp.	2 681 433	3 654 040	
USD	48 357	Bristol-Myers Squibb Co.	3 786 811	2 748 011	
USD	2 142	Bruker Corp.	218 141	187 027	
USD	5 781	Cardinal Health Inc.	713 736	777 754	
USD	4 272	Catalent Inc.	340 569	328 698	
USD	4 000	Cencora Inc.	1 064 083	1 233 157	
USD	12 670	Centene Corp.	1 220 137	1 149 443	
USD	351	Chemed Corp.	264 950	260 596	
USD	6 992	Cigna Corp.	2 807 607	3 162 730	
USD	4 699	Cooper Cos. Inc. (The)	587 853	561 328	
USD	30 445	CVS Health Corp.	3 120 263	2 460 405	
USD	2 433	Cytokinetics Inc.	250 641	180 376	
USD	15 668	Danaher Corp.	4 911 258	5 356 610	
USD	1 297	DaVita Inc.	252 886	245 927	
USD	4 915	Dentsply Sirona Inc.	244 297	167 531	
USD	9 180	DexCom Inc.	1 451 754	1 424 218	
USD	14 297	Edwards Lifesciences Corp.	1 598 937	1 807 062	
USD	11 652	Elanco Animal Health Inc.	193 096	230 072	
USD	5 619	Elevance Health Inc.	3 664 407	4 166 231	
USD	20 100	Eli Lilly and Co.	14 653 518	24 901 421	
USD	2 347	Encompass Health Corp.	209 013	275 516	
USD	4 262	Exact Sciences Corp.	382 416	246 398	
USD	6 460	Exelixis Inc.	175 308	198 624	
USD	8 662	GE HealthCare Technologies Inc.	899 586	923 558	
USD	29 619	Gilead Sciences Inc.	3 114 774	2 780 706	
USD	3 199	Globus Medical Inc., catégorie A	233 285	299 805	
USD	624	GRAIL Inc.	15 883	13 124	
USD	2 987	Halozyme Therapeutics Inc.	153 510	214 009	
USD	4 664	HCA Healthcare Inc.	1 783 802	2 050 404	
USD	3 089	Henry Schein Inc.	321 617	270 940	
USD	5 541	Hologic Inc.	573 548	562 966	
USD	2 865	Humana Inc.	1 664 596	1 464 829	
USD	1 955	IDEXX Laboratories Inc.	1 373 460	1 303 321	
USD	3 755	Illumina Inc.	919 373	536 321	
USD	4 430	Incyte Corp.	389 869	367 466	
USD	693	Inspire Medical Systems Inc.	209 292	126 907	
USD	1 645	Insulet Corp.	532 170	454 239	
USD	2 116	Intra-Cellular Therapies Inc.	184 204	198 308	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		É.-U. (suite)			
USD	8 280	Intuitive Surgical Inc.	3 629 561	5 040 123	
USD	3 389	Ionis Pharmaceuticals Inc.	198 858	221 016	
USD	4 232	IQVIA Holdings Inc.	1 234 360	1 224 419	
USD	57 243	Johnson & Johnson	12 208 304	11 448 487	
USD	2 014	Labcorp Holdings Inc.	625 544	560 844	
USD	4 270	Legend Biotech Corp., CAAE	312 030	258 780	
USD	1 059	Masimo Corp.	220 444	182 497	
USD	3 120	McKesson Corp.	1 820 860	2 493 414	
USD	60 306	Merck & Co., Inc.	9 512 288	10 215 940	
USD	501	Mettler-Toledo International Inc.	899 662	958 109	
USD	7 878	Moderna Inc.	1 343 772	1 280 109	
USD	1 371	Molina Healthcare Inc.	611 255	557 737	
USD	2 596	Natera Inc.	245 260	384 672	
USD	2 310	Neurocrine Biosciences Inc.	374 972	435 160	
USD	4 114	Option Care Health Inc.	176 215	155 934	
USD	870	Penumbra Inc.	309 234	214 248	
USD	134 223	Pfizer Inc.	6 083 008	5 138 920	
USD	2 648	Quest Diagnostics Inc.	477 711	495 970	
USD	2 459	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	2 900 439	3 536 477	
USD	1 238	Repligen Corp.	314 632	213 548	
USD	3 449	ResMed Inc.	933 165	903 395	
USD	2 928	Revvity Inc.	464 968	420 125	
USD	10 536	Roivant Sciences Ltd.	141 826	152 387	
EUR	26 292	Sanofi SA	3 544 052	3 467 905	
USD	2 080	Sarepta Therapeutics Inc.	360 908	449 695	
USD	7 520	Stryker Corp.	3 143 823	3 501 170	
USD	1 115	Teleflex Inc.	371 359	320 903	
USD	2 389	Tenet Healthcare Corp.	245 054	434 873	
USD	9 160	Thermo Fisher Scientific Inc.	6 857 912	6 931 349	
USD	1 099	United Therapeutics Corp.	331 011	479 041	
USD	22 052	UnitedHealth Group Inc.	14 883 719	15 366 845	
USD	1 223	Universal Health Services Inc., catégorie B	240 873	309 479	
USD	6 117	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3 040 143	3 923 279	
USD	28 440	Viatis Inc.	433 854	413 676	
USD	2 201	Viking Therapeutics Inc.	228 628	159 652	
USD	16 934	Walgreens Boots Alliance Inc.	642 823	280 261	
USD	1 397	Waters Corp.	595 744	554 589	
USD	1 755	West Pharmaceutical Services Inc.	871 173	791 015	
USD	4 961	Zimmer Biomet Holdings Inc.	839 528	736 743	
USD	10 983	Zoetis Inc.	2 698 955	2 605 356	
			169 845 719	183 600 026	71,2
		SUISSE			
CHF	11 690	Alcon Inc.	1 177 265	1 427 999	
EUR	6 248	DSM-Firmenich AG	853 993	967 599	
CHF	1 763	Lonza Group AG, enregistré	1 320 297	1 316 538	
CHF	45 198	Novartis AG, actions nominatives	5 935 692	6 618 959	
CHF	16 703	Roche Holding AG	6 381 106	6 345 938	
CHF	682	Roche Holding AG-BR	277 681	284 347	
CHF	9 378	Sandoz Group AG	436 542	464 685	
CHF	1 171	Sonova Holding AG, actions nominatives	481 630	495 002	
CHF	2 533	Straumann Holding AG	517 682	429 300	
CHF	303	Tecan Group AG	165 857	138 788	
			17 547 745	18 489 155	7,2

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>DANEMARK</b>					
USD	1 351	Ascendis Pharma AS, CAAE	217 045	252 118	
DKK	3 086	Coloplast AS, catégorie B	510 905	507 708	
DKK	1 540	Genmab AS	680 528	528 465	
DKK	75 458	Novo Nordisk AS, catégorie B	9 962 756	14 922 131	
			11 371 234	16 210 422	6,3
<b>R.-U.</b>					
GBP	35 623	AstraZeneca PLC	6 379 227	7 613 546	
GBP	97 326	GSK PLC	2 553 132	2 574 880	
GBP	120 895	Haleon PLC	660 654	674 608	
USD	8 926	Royalty Pharma PLC, catégorie A	383 827	322 080	
GBP	20 768	Smith & Nephew PLC	400 725	352 262	
			10 377 565	11 537 376	4,5
<b>JAPON</b>					
JPY	42 472	Astellas Pharma Inc.	733 462	574 446	
JPY	15 205	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	651 032	739 312	
JPY	45 567	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	1 967 824	2 141 179	
JPY	6 723	Eisai Co., Ltd.	465 646	376 990	
JPY	21 807	Fujifilm Holdings Corp.	642 429	697 853	
JPY	8 238	Hoya Corp.	1 313 374	1 310 776	
JPY	8 447	MatsukiyoCocokara & Co.	200 182	165 983	
JPY	29 813	Olympus Corp.	639 366	657 720	
JPY	9 629	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	243 776	179 913	
JPY	10 527	Otsuka Holdings Co., Ltd.	504 010	606 237	
JPY	6 518	Shimadzu Corp.	251 363	223 167	
JPY	6 975	Shionogi & Co.	441 942	372 431	
JPY	11 324	Sysmex Corp.	305 414	249 584	
JPY	36 312	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1 496 738	1 288 676	
JPY	34 150	Terumo Corp.	738 894	770 685	
			10 595 452	10 354 952	4,0
<b>IRLANDE</b>					
USD	1 444	Jazz Pharmaceuticals PLC	258 505	210 888	
USD	31 629	Medtronic PLC	3 620 372	3 406 533	
USD	2 339	STERIS PLC	662 622	702 653	
			4 541 499	4 320 074	1,7
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	1 555	Cochlear Ltd.	387 957	471 999	
AUD	11 408	CSL Ltd.	2 979 985	3 077 632	
AUD	4 306	Ramsay Health Care Ltd.	223 882	186 757	
AUD	10 699	Sonic Healthcare Ltd.	316 025	257 143	
			3 907 849	3 993 531	1,6
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	23 363	Bayer AG, actions nominatives	1 446 309	903 846	
EUR	2 212	BioNTech SE, CAAE	340 191	244 108	
EUR	4 733	Fresenius Medical Care AG & Co., KGaA	269 722	248 213	
EUR	9 783	Fresenius SE & Co., KGaA	375 521	399 996	
EUR	3 073	Merck KGaA	727 335	697 403	
EUR	585	Sartorius AG, privilégiées	312 117	187 884	
EUR	6 406	Siemens Healthineers AG	490 936	505 429	
			3 962 131	3 186 879	1,2

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



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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FRANCE</b>					
EUR	6 817	EssilorLuxottica SA	1 764 554	2 011 463	
EUR	660	Sartorius Stedim Biotech	254 495	148 380	
			2 019 049	2 159 843	0,8
<b>PAYS-BAS</b>					
USD	1 395	argenx SE, CAAE	719 120	820 881	
EUR	18 762	Koninklijke Philips N.V.	504 836	649 079	
USD	5 405	QIAGEN NV	331 915	303 899	
			1 555 871	1 773 859	0,7
<b>ISRAËL</b>					
ILS	26 503	Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	394 006	596 658	0,2
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	2 857	UCB SA	362 791	581 135	0,2
<b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>					
NZD	13 043	Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	273 393	327 129	0,1
<b>CHINE</b>					
HKD	198 462	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	236 517	216 351	0,1
<b>SUÈDE</b>					
SEK	5 525	Swedish Orphan Biovitrum AB	196 320	202 456	0,1
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>237 187 141</b>	<b>257 549 846</b>	<b>99,9</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(337 798)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>236 849 343</b>	<b>257 549 846</b>	<b>99,9</b>
		Autres actifs (passifs) nets		196 764	0,1
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>257 746 610</b>	<b>100,0</b>

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	76	87
Paielements indirects†	28	31

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	2024	Parts ordinaires non couvertes	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	6 550 000		700 000
Parts rachetables émises	6 900 000		8 700 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-		-
Parts rachetables rachetées	(2 250 000)		(150 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>11 200 000</b>		<b>9 250 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires non couvertes	0,350

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	2 321	353
Garanties (hors trésorerie)	2 446	371

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	6	3
Charges	(2)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	4	2
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,0</b>

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - É.-U.	75,7
Actions - Danemark	5,0
Actions - Suisse	4,7
Actions - R.-U.	4,3
Actions - Japon	4,1
Actions - Irlande	1,9
Actions - Allemagne	1,5
Actions - France	0,9
Actions - Pays-Bas	0,7
Actions - Australie	0,4
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Actions - Israël	0,2
Actions - Belgique	0,1
Actions - Nouvelle-Zélande	0,1
Actions - Chine	0,1
Actions - Finlande	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

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

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive Developed Markets Healthcare 150	25 660 041

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive Developed Markets Healthcare 150	13 501 195

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	186 277	-	186 277	72,3
Franc suisse	17 524	-	17 524	6,8
Couronne danoise	15 959	-	15 959	6,2
Livre sterling	11 242	-	11 242	4,4
Euro	11 014	-	11 014	4,3
Yen japonais	10 370	-	10 370	4,0
Dollar australien	3 995	-	3 995	1,5
Shekel israélien	598	-	598	0,2
Dollar néo-zélandais	335	-	335	0,1
Dollar de Hong Kong	218	-	218	0,1
Couronne suédoise	204	-	204	0,1
<b>Total</b>	<b>257 736</b>	<b>-</b>	<b>257 736</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	98 674	-	98 674	72,8
Franc suisse	9 584	-	9 584	7,1
Couronne danoise	6 659	-	6 659	4,9
Euro	6 355	-	6 355	4,7
Livre sterling	5 717	-	5 717	4,2
Yen japonais	5 636	-	5 636	4,2
Dollar australien	2 266	-	2 266	1,7
Shekel israélien	219	-	219	0,2
Dollar néo-zélandais	153	-	153	0,1
Dollar de Hong Kong	143	-	143	0,1
Couronne suédoise	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>135 407</b>	<b>-</b>	<b>135 407</b>	<b>100,0</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 25 774 000 \$ (13 541 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	257 550	-	-	257 550
<b>Total</b>	<b>257 550</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>257 550</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	135 268	-	-	135 268
<b>Total</b>	<b>135 268</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>135 268</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	160 606	116 115
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 796	2 880
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	81	1 722
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	780	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	17	9
Intérêts à recevoir	1 607	1 127
Rabais sur frais à recevoir	51	40
	165 938	121 893
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	383	251
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	68	50
Frais d'administration à payer	20	15
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	740	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	39	27
	1 250	343
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>164 688</b>	<b>121 550</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB en						
\$ CA	159 832	115 233	20,73	20,63	7 710 000	5 585 000
Série FNB couverte en						
\$ US	4 856	6 317	20,88*	20,73*	170 000	230 000

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

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	391	270
Intérêts aux fins des distributions	3 002	1 748
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	810	295
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(404)	(593)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 799</b>	<b>1 720</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	44	(109)
Rabais sur frais	255	176
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>299</b>	<b>67</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>4 098</b>	<b>1 787</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	359	227
Frais d'administration (note 5)	107	67
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	6
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	-	17
Taxe de vente harmonisée	14	7
<b>Total des charges</b>	<b>495</b>	<b>325</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>3 603</b>	<b>1 462</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Série FNB en						
\$ CA	3 373	1 461	0,50	0,34	6 745 027	4 283 558
Série FNB couverte en						
\$ US	230	1	1,14	-	203 434	145 387

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



# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

États financiers (non audité)

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

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	115 233	87 084	6 317	4 506	121 550
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 373	1 461	230	1	3 603	1 462
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(2 416)	(1 035)	(97)	(15)	(2 513)	(1 050)
Profits nets réalisés	-	(565)	-	(56)	-	(621)
Remboursement de capital	(34)	-	-	-	(34)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 450)	(1 600)	(97)	(71)	(2 547)	(1 671)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	68 926	34 688	20 314	10 055	89 240	44 743
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(25 250)	(24 144)	(21 908)	(7 668)	(47 158)	(31 812)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	43 676	10 544	(1 594)	2 387	42 082	12 931
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	44 599	10 405	(1 461)	2 317	43 138	12 722
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	159 832	97 489	4 856	6 823	164 688	104 312

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 603	1 462
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(810)	(295)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	404	593
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(17)	24
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	6
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	136 160	59 720
Achat de placements et de dérivés	(178 525)	(75 803)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(8)	(3)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(480)	(223)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	18	8
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	5	2
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	(9)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(39 636)</b>	<b>(14 518)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 546)	(1 671)
Produit de l'émission de parts rachetables	89 239	44 771
Montant versé au rachat de parts rachetables	(47 158)	(31 812)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>39 535</b>	<b>11 288</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	17	(24)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(101)	(3 230)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	2 880	4 703
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>2 796</b>	<b>1 449</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 521	1 516
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	383	259
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.

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>ACTIONS</b>			
		<b>CANADA</b>			
	16 800	Banque de Montréal, privilégiées, série 29, taux variable, perpétuelles	414 120	417 984	
	12 000	Banque de Montréal, privilégiées, série 31, taux variable, perpétuelles	288 960	292 320	
	7 775	BCE Inc., privilégiées, catégorie A, série 19, taux variable, perpétuelles	119 773	120 513	
	6 325	BCE Inc., privilégiées, série AA, taux variable, perpétuelles	105 510	105 817	
	5 175	BCE Inc., privilégiées, série AB, taux flottant, perpétuelles	95 657	89 165	
	5 500	BCE Inc., privilégiées, série AC, taux variable, perpétuelles	96 104	94 875	
	21 850	BCE Inc., privilégiées, série AD, taux flottant, perpétuelles	398 379	371 887	
	3 100	BCE Inc., privilégiées, série AG, taux variable, perpétuelles	41 651	48 019	
	12 975	Brookfield Corp., privilégiées, série 2, taux flottant, perpétuelles	157 184	146 228	
	13 100	Brookfield Corp., privilégiées, série 13, taux flottant, perpétuelles	152 979	146 589	
	7 525	Brookfield Corp., privilégiées, série 32, taux variable, perpétuelles	153 293	168 109	
	16 600	Brookfield Renewable Partners LP, privilégiées, série 13, taux variable, perpétuelles	331 188	340 134	
	8 650	Brookfield Renewable Power, 5 %, privilégiées, série 6, perpétuelles	152 662	154 835	
	23 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, catégorie A, série « 41 », taux variable, perpétuelles	537 897	555 449	
	15 825	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, série 39, taux variable, perpétuelles	361 690	394 676	
	8 350	Canadian Utilities Ltd., 4,75 %, privilégiées, série HH, perpétuelles	150 425	157 231	
	4 700	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	105 471	112 753	
	18 100	Element Fleet Management Corp., privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	448 606	452 319	
USD	11 275	Enbridge Inc., privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	346 059	327 005	
	8 600	Enbridge Inc., privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	145 054	151 274	
	6 000	Enbridge Inc., privilégiées, série 13, taux variable, perpétuelles	100 680	104 280	
	11 525	Enbridge Inc., privilégiées, série D, taux variable, perpétuelles	206 685	201 572	
	9 150	Enbridge Inc., privilégiées, série F, taux variable, perpétuelles	156 365	164 700	
USD	7 750	Enbridge Inc., privilégiées, taux variable, perpétuelles	208 420	233 253	
	5 200	Great-West Lifeco Inc. 4,5 %, actions privilégiées, série Y, perpétuelles	89 332	92 612	
	8 600	Great-West Lifeco Inc., privilégiées, série N, taux variable, perpétuelles	123 860	127 280	
	3 900	Intact Corporation financière, 5,3 %, privilégiées, série 6, perpétuelles	76 579	85 215	
	6 800	Intact Corporation financière, 5,4 %, privilégiées, série 9, perpétuelles	146 464	152 830	
	4 750	Société Financière Manuvie, 4,65 %, privilégiées, série 2, perpétuelles	87 090	93 908	
	8 800	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 3, taux variable, perpétuelles	124 763	140 976	
	4 750	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 9, taux variable, perpétuelles	98 624	114 190	
	6 300	Corporation Financière Power, 5,8 %, privilégiées, série O, perpétuelles	139 364	139 797	
	6 900	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BD, taux variable, perpétuelles	163 047	167 118	
	15 700	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BF, taux variable, perpétuelles	361 571	368 636	
	8 775	Financière Sun Life Inc., 4,45 %, privilégiées, série 4, perpétuelles	159 423	168 480	
	5 000	Financière Sun Life Inc., privilégiées, catégorie A, série 10R, taux variable, perpétuelles	89 545	100 700	
	13 550	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	151 946	180 622	
	10 750	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	199 725	209 088	
	22 550	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	506 039	553 602	
	8 125	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	169 155	204 425	
	20 400	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	464 324	489 599	
	19 100	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	446 024	464 130	
	6 725	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 18, taux variable, perpétuelles	150 015	165 502	
	29 850	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 24, taux variable, perpétuelles	724 758	753 712	
			9 746 460	10 123 409	6,1
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	550 000	Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI (série FNB \$ CA)	5 323 965	5 549 500	3,4

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>ACTIONS (suite)</b>			
		É.-U.			
	16 350	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série N, taux variable, perpétuelles	157 559	184 265	
	15 075	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série P, taux variable, perpétuelles	145 788	171 855	
	22 350	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	238 466	269 541	
	9 500	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série AA, taux variable, perpétuelles	99 699	127 395	
	13 850	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série CC, taux variable, perpétuelles	192 814	211 213	
	13 225	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série EE, taux variable, perpétuelles	155 340	169 412	
USD	13 975	Citigroup Capital XIII, privilégiées, taux variable	520 759	559 598	
		<b>Total des actions</b>	<b>1 510 425</b>	<b>1 693 279</b>	<b>1,0</b>
		<b>OBLIGATIONS</b>			
		É.-U.			
USD	523 000	Air Lease Corp., 3,13 %, 1er décembre 2030	627 728	625 948	
USD	799 000	Air Lease Corp., 5,20 %, 15 juillet 2031	1 078 038	1 069 717	
	703 000	Air Lease Corp., 5,4 %, 1er juin 2028	701 930	715 253	
USD	452 426	American Airlines, fiducie de transfert de prêts, 2021-1, catégorie A, 2,88 %, 11 juillet 2034	502 446	532 573	
USD	216 250	American Airlines, fiducie de transfert de prêts, 2021-1, catégorie B, 3,95 %, 11 janvier 2032	256 356	273 849	
USD	449 000	Amgen Inc., 5,25 %, 2 mars 2030	607 491	619 327	
USD	249 000	Amgen Inc., 5,6 %, 2 mars 2043	334 459	337 180	
USD	1 417 000	Apache Corp., 4,25 %, 15 janvier 2044	1 323 998	1 443 478	
USD	946 000	Apple Inc., 1,2 %, 8 février 2028	1 101 896	1 145 282	
USD	996 000	AT&T Inc., 2,55 %, 1er décembre 2033	1 064 412	1 086 253	
USD	865 000	AT&T Inc., 3,65 %, 1er juin 2051	842 078	840 971	
EUR	420 000	AT&T Inc., 3,95 %, 30 avril 2031	640 006	624 871	
USD	526 000	AT&T Inc., 4,3 %, 15 février 2030	686 253	690 102	
USD	229 000	AutoZone Inc., 6,55 %, 1er novembre 2033	333 763	337 285	
USD	400 000	Bank of America Corp., série TT, convertibles, taux variable, 27 avril 2027	544 852	551 498	
USD	543 000	Bank of America Corp., taux variable, 22 juillet 2028	726 236	737 201	
USD	821 000	Bank of America Corp., taux variable, 29 avril 2031	916 143	972 201	
USD	1 068 000	Bank of America Corp., taux variable, 25 avril 2034	1 412 229	1 448 374	
USD	360 000	Boeing Co. (The), 6,26 %, 1er mai 2027	493 149	496 159	
USD	360 000	Boeing Co. (The), 6,39 %, 1er mai 2031	497 747	502 209	
USD	300 000	Boeing Co. (The), 6,53 %, 1er mai 2034	413 292	421 203	
USD	723 000	Broadcom Inc., 3,47 %, 15 avril 2034	847 219	845 479	
USD	542 000	Cargill Inc., 1,7 %, 2 février 2031	583 225	606 970	
USD	420 000	Citigroup Inc., série P, convertibles, taux variable, 15 mai 2025	565 551	571 901	
USD	435 000	Citigroup Inc., série BB, convertibles, taux variable, 15 mai 2029	594 206	611 099	
USD	585 000	Citigroup Inc., taux variable, 24 mai 2028	767 733	787 732	
USD	600 000	Citigroup Inc., taux variable, 13 février 2035	798 311	815 321	
USD	583 000	Daimler Trucks Finance North America LLC, 5,13 %, 25 septembre 2029	797 517	792 430	
USD	537 000	Darden Restaurants Inc., 6,3 %, 10 octobre 2033	747 304	759 582	
USD	728 000	Energy Transfer LP, 3,75 %, 15 mai 2030	899 822	917 164	
USD	838 000	Energy Transfer LP, 5,3 %, 1er avril 2044	967 387	1 039 221	
USD	785 000	Estée Lauder Cos., Inc. (The), 1,95 %, 15 mars 2031	870 281	885 931	
USD	446 000	Estée Lauder Cos., Inc. (The), 4,65 %, 15 mai 2033	593 043	590 297	
USD	685 000	Exelon Corp., 4,1 %, 15 mars 2052	729 880	723 200	
USD	283 000	Florida Gas Transmission Co., LLC, 2,55 %, 1er juillet 2030	317 479	336 249	
USD	234 000	Ford Motor Co., 4,75 %, 15 janvier 2043	239 635	260 103	
USD	763 000	Ford Motor Credit Co., LLC, 3,63 %, 17 juin 2031	854 998	901 901	

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>OBLIGATIONS (suite)</b>			
		<b>É.-U. (suite)</b>			
USD	292 000	Ford Motor Credit Co., LLC, 6,8 %, 12 mai 2028	395 447	411 913	
USD	298 000	General Motors Financial Co., Inc., série C, convertibles, taux variable, 30 septembre 2030	347 488	384 173	
USD	426 000	HCA Inc., 3,63 %, 15 mars 2032	489 657	514 455	
USD	905 000	Home Depot Inc. (The), 1,88 %, 15 septembre 2031	988 149	1 010 097	
USD	921 000	Home Depot Inc. (The), 2,75 %, 15 septembre 2051	817 863	790 886	
USD	379 000	Hyundai Capital America, 2 %, 15 juin 2028	434 384	458 020	
USD	593 000	Hyundai Capital America, 5,7 %, 26 juin 2030	798 484	822 920	
USD	361 000	Ingersoll Rand Inc., 5,31 %, 15 juin 2031	495 401	497 058	
USD	560 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 15 octobre 2030	642 468	678 479	
USD	600 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 25 juillet 2033	781 887	798 873	
USD	258 000	JPMorgan Chase & Co., taux variable, 22 avril 2035	355 653	363 016	
USD	680 000	Marathon Oil Corp., 5,2 %, 1er juin 2045	801 666	861 237	
USD	550 000	Morgan Stanley, taux variable, 1er novembre 2029	769 735	786 013	
USD	473 000	Morgan Stanley, taux variable, 1er avril 2031	564 277	594 419	
USD	664 000	Netflix Inc., 4,88 %, 15 juin 2030	887 490	894 926	
USD	435 000	NextEra Energy Capital Holdings Inc., 2,25 %, 1er juin 2030	496 187	508 033	
USD	550 000	Ovintiv Inc., 6,25 %, 15 juillet 2033	753 002	777 553	
USD	270 000	Ovintiv Inc., 7,1 %, 15 juillet 2053	400 304	407 642	
USD	270 000	Pacific Gas and Electric Co., 5,8 %, 15 mai 2034	365 317	367 904	
USD	350 000	Pacific Gas and Electric Co., 6,75 %, 15 janvier 2053	509 255	500 842	
USD	332 000	Sempra Energy, convertibles, taux variable, 15 octobre 2025	415 094	446 671	
USD	21 000	Sensata Technologies Inc., 6,63 %, 15 juillet 2032	29 008	28 954	
USD	682 000	Stellantis Finance US Inc., 1,71 %, 29 janvier 2027	805 867	850 548	
USD	606 000	Sysco Corp., 2,45 %, 14 décembre 2031	663 909	686 157	
USD	537 000	Sysco Corp., 6,6 %, 1er avril 2050	807 351	822 507	
USD	300 000	Tempur Sealy International Inc., 3,88 %, 15 octobre 2031	321 442	344 379	
USD	524 000	T-Mobile USA Inc., 2,7 %, 15 mars 2032	592 827	601 048	
USD	707 000	T-Mobile USA Inc., 3,3 %, 15 février 2051	663 504	657 317	
USD	237 000	T-Mobile USA Inc., 3,6 %, 15 novembre 2060	217 712	220 143	
USD	739 000	T-Mobile USA Inc., 3,88 %, 15 avril 2030	914 418	945 939	
USD	584 567	United Airlines, Pass Through Trust, 2020-1, catégorie A, 5,88 %, 15 octobre 2027	786 121	802 856	
USD	79 632	United Airlines, Pass Through Trust, 2020-1, catégorie B, 4,88 %, 15 janvier 2026	104 013	107 396	
USD	2 101 300	Obligation du Trésor américain, 4 %, 31 janvier 2031	2 803 725	2 819 941	
USD	4 109 100	Obligation du Trésor américain, 4 %, 15 février 2034	5 430 337	5 469 938	
USD	559 800	Obligation du Trésor américain, 4,25 %, 28 février 2029	759 143	762 992	
USD	4 481 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 15 mai 2034	6 106 149	6 146 036	
USD	705 700	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 mai 2027	963 152	964 415	
USD	344 500	Obligation du Trésor américain, 4,5 %, 15 février 2044	464 946	464 518	
USD	551 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 15 juin 2027	758 527	756 122	
USD	1 892 200	Obligation du Trésor américain, 4,75 %, 15 novembre 2053	2 686 144	2 693 383	
USD	1 140 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 30 avril 2026	1 564 146	1 562 075	
USD	100 000	USB Realty Corp., convertibles, taux variable, 15 janvier 2027	100 953	105 359	
USD	707 000	Verizon Communications Inc., 3,4 %, 22 mars 2041	719 514	742 779	
USD	420 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 30 avril 2026	531 108	558 045	
USD	645 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 22 avril 2028	889 132	890 474	
USD	923 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 25 juillet 2029	1 229 551	1 275 055	
USD	913 000	Wells Fargo & Co., taux variable, 25 juillet 2034	1 212 298	1 251 198	
USD	200 000	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp., 5,25 %, 15 mai 2027	252 381	267 072	
			71 164 679	72 587 290	44,1

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>OBLIGATIONS (suite)</b>			
		<b>CANADA</b>			
	250 000	Air Canada, 4,63 %, 15 août 2029	225 000	242 344	
USD	162 160	Air Canada, Pass Through Trust Certificates, 2015-1, catégorie A, 3,6 %, 15 mars 2027	199 563	210 815	
	950 000	Banque de Montréal, 4,54 %, 18 décembre 2028	942 543	948 265	
	559 000	Banque de Montréal, convertibles, taux variable, 26 novembre 2027	566 005	571 573	
	585 000	Banque de Montréal, convertibles, taux variable, 26 avril 2028	586 023	592 803	
USD	305 000	Banque de Montréal, convertible, taux variable, 26 mai 2084	414 914	427 371	
	740 000	Banque de Montréal, taux variable, 3 juillet 2034	740 000	737 780	
USD	710 000	Banque de Montréal, taux variable, 10 janvier 2037	740 908	796 394	
	800 000	Banque de Montréal, taux variable, 26 novembre 2080	743 274	776 346	
	209 000	Banque de Montréal, taux variable, 26 mai 2082	194 013	203 249	
USD	450 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), convertible, taux variable, 27 janvier 2084	600 863	637 267	
	500 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), taux variable, 27 juillet 2082	485 915	503 604	
	311 000	Brookfield Finance II Inc., 5,43 %, 14 décembre 2032	311 277	316 305	
	400 000	Canadian Credit Card Trust II, série B, 1,87 %, 24 novembre 2024	378 074	395 390	
	573 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, convertibles, taux variable, 28 octobre 2080	532 469	556 916	
	425 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, convertibles, taux variable, 28 janvier 2082	359 493	373 793	
	776 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 28 septembre 2027	784 012	789 719	
	596 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 20 janvier 2033	596 288	603 018	
	265 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 16 janvier 2034	264 989	268 123	
	550 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 28 juillet 2084	550 000	550 097	
USD	606 000	Canadian Natural Resources Ltd., 2,95 %, 15 juillet 2030	723 791	728 181	
	632 000	Banque Canadienne de l'Ouest, série 1, taux variable, 30 avril 2081	570 499	626 455	
	640 000	Banque Canadienne de l'Ouest, taux variable, 29 janvier 2034	640 942	658 185	
	430 000	Capital Power Corp., taux variable, 9 septembre 2082	433 225	441 074	
	450 000	CARDS II Trust, 6,46 %, 15 janvier 2026	450 000	459 429	
	250 000	CARDS II Trust, série B, 2,81 %, 15 janvier 2025	237 108	245 691	
	200 000	CARDS II Trust, série B, 5,03 %, 15 mai 2025	193 889	198 761	
	250 000	CARDS II Trust, série C, 3,61 %, 15 janvier 2025	235 635	238 651	
	350 000	CARDS II Trust, série C, 6,08 %, 15 mai 2025	344 533	350 362	
USD	561 000	CCL Industries Inc., 3,05 %, 1er juin 2030	629 771	680 461	
USD	570 000	Cenovus Energy Inc., 2,65 %, 15 janvier 2032	621 374	647 212	
USD	420 000	Cenovus Energy Inc., 5,4 %, 15 juin 2047	514 468	531 662	
	569 000	FPI Propriétés de Choix, série L, 4,18 %, 8 mars 2028	542 171	559 211	
	215 000	Pipeline Coastal Gaslink LP, série H, 5,61 %, 30 juin 2044	214 991	225 229	
USD	190 000	Constellation Software Inc., 5,16 %, 16 février 2029	255 788	260 068	
USD	255 000	Constellation Software Inc., 5,46 %, 16 février 2034	343 294	349 796	
	470 000	Constellation Software Inc., série 1, 13,3 %, 31 mars 2040	626 120	598 075	
	194 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série B, 5,87 %, 17 juin 2029	194 000	196 425	
	218 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série B, 6,11 %, 17 juin 2028	218 000	218 579	
	376 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série C, 7,12 %, 17 juin 2029	376 000	380 225	
	221 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série C, 7,36 %, 17 juin 2028	221 000	221 494	
USD	250 000	Empire Communities Corp., 9,75 %, 1er mai 2029	350 991	348 425	
	393 000	Enbridge Inc., convertibles, taux variable, 19 janvier 2082	333 573	352 632	
	464 000	FPI First Capital, 3,45 %, 1er mars 2028	412 343	439 015	
	584 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 5,67 %, 20 février 2030	596 492	595 727	
	675 000	Fortified Trust, série C, 5,12 %, 23 décembre 2027	675 000	673 535	
	397 000	Gibson Energy Inc., 6,2 %, 12 juillet 2053	414 630	431 302	
	224 000	Glacier Credit Card Trust, série 23-1, 5,68 %, 20 septembre 2028	227 638	233 243	
	231 000	Glacier Credit Card Trust, série 2023, 6,88 %, 20 septembre 2028	234 693	237 415	
	245 000	Glacier Credit Card Trust, série 2024, 5,59 %, 20 septembre 2026	245 000	249 801	
	32 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er décembre 2055	28 619	28 041	
	1 148 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1er juin 2034	1 083 803	1 100 185	
	3 050 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er décembre 2033	2 971 637	2 988 306	

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>OBLIGATIONS (suite)</b>			
		<b>CANADA (suite)</b>			
	291 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mars 2029	296 013	297 041	
	787 000	Home Trust Co., 5,76 %, 19 mai 2026	787 000	791 890	
	598 000	Inter Pipeline Ltd., 4,64 %, 30 mai 2044	487 412	494 571	
	91 000	Inter Pipeline Ltd., 5,76 %, 17 février 2028	91 338	92 959	
	1 062 000	Inter Pipeline Ltd., 6,38 %, 17 février 2033	1 093 402	1 102 267	
	145 000	Inter Pipeline Ltd., série 19-A, convertibles, taux variable, 26 mars 2079	141 556	143 646	
USD	821 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 24 février 2032	1 029 674	1 076 573	
	656 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 23 février 2034	656 630	661 339	
	937 000	Société Financière Manuvie, taux variable, 19 juin 2082	928 027	947 569	
	495 000	Nissan Canada Inc., 2,1 %, 22 septembre 2025	458 342	477 205	
	640 000	Original Wempi Inc., 7,79 %, 4 octobre 2027	654 223	680 928	
	300 000	Pembina Pipeline Corp., convertibles, taux variable, 25 janvier 2081	253 500	269 542	
	455 000	Primaris REIT, 6,37 %, 30 juin 2029	469 165	476 119	
	280 000	FPI RioCan, 4,63 %, 1er mai 2029	264 355	273 516	
	355 000	Rogers Communications Inc., 5,7 %, 21 septembre 2028	362 704	368 172	
	375 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, 17 décembre 2081	343 288	363 300	
	512 000	Banque Royale du Canada, série 2, taux variable, 24 février 2081	446 493	491 148	
	840 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 25 janvier 2029	845 681	865 163	
	498 000	Sagen MI Canada Inc., 5,91 %, 19 mai 2028	496 537	501 139	
USD	187 000	Sienna Senior Living Inc., série B, 3,45 %, 27 février 2026	173 436	181 152	
	260 000	Strathcona Resources Ltd., 6,88 %, 1er août 2026	352 672	352 412	
	400 000	Suncor Énergie Inc., 3,95 %, 4 mars 2051	297 621	323 848	
USD	800 000	Banque Toronto-Dominion (La), 4,68 %, 1er août 2029	796 000	803 691	
	800 000	Banque Toronto-Dominion (La), convertibles, taux variable, 31 octobre 2082	1 121 949	1 136 952	
	650 000	Banque Toronto-Dominion (La), série 27, convertibles, taux variable, 1er octobre 2027	584 142	603 551	
	876 000	Banque Toronto-Dominion (La), série 28, convertibles, taux variable, 1er octobre 2027	882 310	890 778	
	700 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	671 820	688 491	
USD	1 160 000	Banque Toronto Dominion (La), taux variable, 9 avril 2034	1 162 513	1 169 479	
	246 000	TransCanada Trust, convertibles, taux variable, 15 septembre 2079	291 763	310 544	
	807 000	Veren Inc., 5,50 %, 21 juin 2034	807 000	796 645	
USD	400 000	Emera Inc., série 16-A, convertibles, taux variable, 15 juin 2076	515 025	545 667	
USD	192 000	Enbridge Inc., convertibles, taux variable, 15 janvier 2077	236 921	255 496	
	215 000	Gibson Energy Inc., série 20-A, convertibles, taux variable, 22 décembre 2080	185 975	198 003	
	611 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 avril 2034	611 000	614 521	
			45 172 128	46 239 342	28,1
		<b>R.-U.</b>			
	362 000	Aviva PLC, 4 %, 2 octobre 2030	322 433	339 094	
USD	500 000	Barclays PLC, convertibles, taux variable, 15 décembre 2034	676 792	672 141	
USD	100 000	Barclays PLC, convertibles, taux variable, 15 décembre 2029	137 463	148 697	
EUR	430 000	BP Capital Markets PLC, 1,64 %, 26 juin 2029	580 565	577 644	
USD	469 000	Brookfield Finance I (UK) PLC, 2,34 %, 30 janvier 2032	487 413	515 874	
USD	522 000	HSBC Holdings PLC, taux variable, 3 novembre 2028	738 241	755 647	
USD	413 000	HSBC Holdings PLC, taux variable, 3 novembre 2033	588 677	639 649	
USD	1 025 000	HSBC Holdings PLC, taux variable, 4 mars 2035	1 387 670	1 414 183	
USD	233 000	Lloyds Banking Group PLC, convertibles, taux variable, 27 septembre 2025	319 136	319 395	
USD	967 000	Lloyds Banking Group PLC, taux variable, 7 août 2027	1 289 245	1 331 078	
USD	402 000	NatWest Group PLC, convertibles, taux variable, 29 décembre 2025	516 077	539 312	
USD	386 000	NatWest Group PLC, convertibles, taux variable, 10 novembre 2033	531 470	534 743	
			7 575 182	7 787 457	4,7

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
<b>IRLANDE</b>					
USD	869 000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3 %, 29 octobre 2028	1 002 551	1 081 347	
USD	1 051 000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30 janvier 2032	1 231 035	1 237 898	
USD	185 000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,85 %, 29 octobre 2041	181 591	198 802	
USD	716 000	Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21 février 2028	808 212	880 853	
USD	496 000	Avolon Holdings Funding Ltd., 5,75 %, 1er mars 2029	665 353	675 331	
USD	302 000	Avolon Holdings Funding Ltd., 5,75 %, 15 novembre 2029	411 497	410 728	
USD	248 000	SMBC Aviation Capital Finance DAC, 5,3 %, 3 avril 2029	336 882	336 634	
USD	250 000	SMBC Aviation Capital Finance DAC, 5,55 %, 3 avril 2034	338 709	335 770	
			4 975 830	5 157 363	3,1
<b>AUSTRALIE</b>					
USD	470 000	Glencore Finance Canada Ltd., taux échelonné, 25 octobre 2042	588 643	602 779	
USD	275 000	Glencore Funding LLC, 3,38 %, 23 septembre 2051	242 550	245 620	
USD	502 000	Glencore Funding LLC, 5,63 %, 4 avril 2034	678 618	677 809	
AUD	675 000	Obligation du Trésor du gouvernement de l'Australie, série 152, 2,75 %, 21 novembre 2028	572 265	584 002	
AUD	700 000	Obligation du Trésor du gouvernement de l'Australie, série 164, 0,5 %, 21 septembre 2026	571 809	590 263	
AUD	725 000	Obligation du Trésor du gouvernement de l'Australie, série 166, 3 %, 21 novembre 2033	581 498	595 909	
			3 235 383	3 296 382	2,0
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	400 000	Daimler Truck International Finance BV, 3,88 %, 19 juin 2029	604 337	595 601	
EUR	5 000	République fédérale d'Allemagne, 0,25 %, 15 février 2027	6 880	6 895	
EUR	124 000	République fédérale d'Allemagne, 2,4 %, 15 novembre 2030	185 272	181 201	
EUR	750 000	République fédérale d'Allemagne, 2,6 %, 15 août 2033	1 135 405	1 111 170	
EUR	652 622	République fédérale d'Allemagne, série 184, coupon zéro, 9 octobre 2026	905 983	900 057	
EUR	320 000	République fédérale d'Allemagne, série 188, 2,4 %, 19 octobre 2028	477 429	467 025	
			3 315 306	3 261 949	2,0
<b>BELGIQUE</b>					
USD	592 000	Anheuser-Busch Cos. LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc., 4,9 %, 1er février 2046	740 024	750 132	
USD	509 000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc., 3,5 %, 1er juin 2030	647 134	647 631	
USD	407 000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc., 4,95 %, 15 janvier 2042	517 963	524 855	
			1 905 121	1 922 618	1,2
<b>JAPON</b>					
USD	966 000	Nissan Motor Co., Ltd., 4,81 %, 17 septembre 2030	1 141 166	1 229 285	0,7
<b>FRANCE</b>					
USD	547 000	BNP Paribas SA, taux variable, 9 juin 2026	685 226	723 583	
USD	225 000	BNP Paribas SA, taux variable, 9 janvier 2030	299 948	304 841	
			985 174	1 028 424	0,6
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	400 000	ABN AMRO Bank NV, 4,38 %, 20 octobre 2028	609 748	601 592	0,4
<b>MACAO</b>					
USD	91 000	Studio City Finance Ltd., 6,5 %, 15 janvier 2028	106 228	118 382	0,1
<b>FINLANDE</b>					
USD	7 000	Amer Sports Co., 6,75 %, 16 février 2031	9 417	9 558	0,0
		<b>Total des obligations</b>	<b>140 195 362</b>	<b>143 239 642</b>	<b>87,0</b>
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>156 776 212</b>	<b>160 605 830</b>	<b>97,5</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(10 334)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>156 765 878</b>	<b>160 605 830</b>	
		Contrat(s) de change à terme		(302 468)	(0,2)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>156 765 878</b>	<b>160 303 362</b>	<b>97,3</b>
		Autres actifs (passifs) nets		4 384 883	2,7
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>164 688 245</b>	<b>100,0</b>

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



# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position		Position			
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 126 787	USD	2 287 527	1,37	(1 629)
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 850 333	USD	2 837 888	1,36	(30 755)
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	1 779 915	USD	1 300 451	1,37	2 574
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	536 721	USD	395 054	1,36	(3 204)
Banque de Montréal	A-1	17 septembre 2024	CAD	5 006 047	USD	3 682 520	1,36	(22 568)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	12 528	USD	9 180	1,36	(27)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	524 032	CAD	719 414	0,73	(2 715)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	3 019 011	CAD	4 155 009	0,73	(26 022)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	3 920 338	USD	2 858 483	1,37	13 618
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	2 957 963	USD	2 167 419	1,36	(4 272)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	17 septembre 2024	CAD	4 120 656	USD	3 014 941	1,37	3 646
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	18 septembre 2024	CAD	3 158 277	EUR	2 115 000	1,49	53 581
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 998 334	USD	2 924 691	1,37	(1 466)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 236 041	USD	2 377 200	1,36	(15 011)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 850 631	USD	2 837 888	1,36	(30 457)
Citibank N.A., New York	A-1	13 août 2024	CAD	2 363 998	USD	1 733 935	1,36	(5 790)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	3 821 103	USD	2 837 888	1,35	(59 985)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	13 août 2024	CAD	2 958 646	USD	2 167 419	1,37	(3 589)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	1 922 712	USD	1 418 944	1,36	(17 832)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 juillet 2024	CAD	1 536 734	USD	1 135 155	1,35	(15 701)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	13 août 2024	CAD	1 779 388	USD	1 300 451	1,37	2 047
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	13 août 2024	CAD	2 366 882	USD	1 733 935	1,37	(2 906)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 septembre 2024	CAD	5 005 336	USD	3 682 520	1,36	(23 278)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	18 septembre 2024	CAD	1 076 503	AUD	1 183 100	0,91	(3 409)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	2 350 912	USD	1 719 682	1,37	(920)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	1 922 986	USD	1 418 944	1,36	(17 558)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	2 791 616	USD	2 061 128	1,35	(27 177)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 septembre 2024	CAD	4 122 419	USD	3 014 941	1,37	5 409
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 juillet 2024	CAD	3 819 839	USD	2 837 888	1,35	(61 249)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	13 août 2024	CAD	2 363 965	USD	1 733 935	1,36	(5 823)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(302 468)</b>

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	81	(14)	-	67
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>81</b>	<b>(14)</b>	<b>-</b>	<b>67</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(383)	14	-	(369)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(383)</b>	<b>14</b>	<b>-</b>	<b>(369)</b>

au 31 décembre 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	1 722	(115)	-	1 607
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 722</b>	<b>(115)</b>	<b>-</b>	<b>1 607</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(251)	115	-	(136)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(251)</b>	<b>115</b>	<b>-</b>	<b>(136)</b>

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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) (%)
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	17 651	5 550	31,4

au 31 décembre 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) (%)
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI	14 853	3 960	26,7

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	13	5
Paielements indirects†	5	2

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB en \$ CA		Série FNB couverte en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	5 585 000	4 318 000	230 000	165 000
Parts rachetables émises	3 350 000	1 693 000	725 000	365 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 225 000)	(1 176 000)	(785 000)	(275 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7 710 000</b>	<b>4 835 000</b>	<b>170 000</b>	<b>255 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Série FNB en \$ CA	0,500	0,15
Série FNB couverte en \$ US	0,500	0,15

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
Mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI (série FNB en \$ CA)	5 550

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB mandat privé de crédit rendement élevé mondial CI (série FNB en \$ CA)	3 325

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations de sociétés	64,4
Obligations d'état étrangères	20,3
Actions ordinaires	4,8
Autres actifs (passifs) nets	3,3
Fonds négocié(s) en bourse	3,3
Obligations d'état canadiennes	2,7
Contrat(s) de change à terme	1,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

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

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>^*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	18,8
AA/Aa/A+	2,7
A	16,7
BBB/Baa/B++	47,7
BB/Ba/B+	7,9
B	0,3
Aucune	0,1
<b>Total</b>	<b>94,2</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>^*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	24,3
AA/Aa/A+	4,1
A	14,4
BBB/Baa/B++	44,2
BB/Ba/B+	6,5
Aucune	0,2
<b>Total</b>	<b>93,7</b>

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

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

# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des actions.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 1 737 000 \$ (979 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	102 778	(71 001)	31 777	19,3
Euro	5 211	(3 105)	2 106	1,3
Dollar australien	1 820	(1 080)	740	0,4
<b>Total</b>	<b>109 809</b>	<b>(75 186)</b>	<b>34 623</b>	<b>21,0</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	75 871	(48 675)	27 196	22,4
Euro	5 241	(3 100)	2 141	1,8
Dollar australien	1 801	(996)	805	0,7
<b>Total</b>	<b>82 913</b>	<b>(52 771)</b>	<b>30 142</b>	<b>24,9</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 3 462 000 \$ (3 014 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	1 429	9 937	23 245	108 629	143 240

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	1 093	10 151	18 916	76 168	106 328

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 793 000 \$ (1 977 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.



# FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	11 816	-	-	11 816
Obligations	-	143 240	-	143 240
Fonds négocié(s) en bourse	5 550	-	-	5 550
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(302)	-	(302)
<b>Total</b>	<b>17 366</b>	<b>142 938</b>	<b>-</b>	<b>160 304</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	5 827	-	-	5 827
Obligations	-	106 328	-	106 328
Fonds négocié(s) en bourse	3 960	-	-	3 960
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 471	-	1 471
<b>Total</b>	<b>9 787</b>	<b>107 799</b>	<b>-</b>	<b>117 586</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	80 834	68 835
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	112	88
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	204	566
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	3	738
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	71	129
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	12	9
	81 236	70 365
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	16	68
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	23	21
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	4	387
Montant à payer pour le rachat de parts	-	366
Comptes créditeurs et charges à payer	13	10
	56	852
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>81 180</b>	<b>69 513</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	29 782	32 260	21,66	20,48	1 375 127	1 575 127
Parts ordinaires non couvertes	51 398	37 253	21,36	20,07	2 406 214	1 856 214

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 221	518
Intérêts aux fins des distributions	5	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	593	571
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3 465	(631)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>5 284</b>	<b>458</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	7	(4)
Rabais sur frais	67	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>78</b>	<b>(4)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>5 362</b>	<b>454</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	134	44
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	15
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charge d'intérêts	2	1
Retenues d'impôts	173	-
Taxe de vente harmonisée	8	6
<b>Total des charges</b>	<b>332</b>	<b>67</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>5 030</b>	<b>387</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	2 112	477	1,47	0,51	1 434 742	943 902
Parts ordinaires non couvertes	2 918	(90)	1,32	(0,19)	2 204 016	470 035

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	32 260	-	37 253	-	69 513	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 112	477	2 918	(90)	5 030	387
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(214)	(170)	(572)	(68)	(786)	(238)
Profits nets réalisés	(77)	-	-	-	(77)	-
Remboursement de capital	(11)	-	-	-	(11)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(302)	(170)	(572)	(68)	(874)	(238)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	5 127	17 169	2 009	17 169	7 136
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	4	-	3	-	7
Rachat de parts rachetables	(4 288)	(3 131)	(5 370)	(9 306)	(9 658)	(12 437)
Acquisition des actifs de fonds clôturés	-	31 422	-	19 699	-	51 121
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(4 288)	33 422	11 799	12 405	7 511	45 827
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 478)	33 729	14 145	12 247	11 667	45 976
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	29 782	33 729	51 398	12 247	81 180	45 976

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 030	387
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(593)	(571)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3 465)	631
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	14	15
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	14 175	11 146
Achat de placements et de dérivés	(16 565)	(10 830)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	58	(103)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	13
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	2
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(1 346)</b>	<b>691</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(873)	(231)
Produit de l'émission de parts rachetables	5 975	4 343
Acquisition des actifs de fonds dissous	-	951
Montant versé au rachat de parts rachetables	(3 734)	(5 617)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>1 368</b>	<b>(554)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	2	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	22	136
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	88	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>112</b>	<b>135</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	5	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 106	574
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(2)	(1)
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.

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		E.-U.			
USD	1 064	AbbVie Inc.	226 919	249 720	
USD	286	Akamai Technologies Inc.	39 061	35 253	
USD	256	Allstate Corp. (The)	45 323	55 929	
USD	31 128	Amdocs Ltd.	3 780 475	3 361 518	
USD	291	AMETEK Inc.	60 547	66 382	
USD	2 973	Amphenol Corp., catégorie A	247 037	274 068	
USD	194	Apple Inc.	45 159	55 911	
USD	479	Archer-Daniels-Midland Co.	46 176	39 621	
USD	270	Arthur J. Gallagher & Co.	80 573	95 803	
USD	1 946	AT&T Inc.	46 148	50 886	
USD	190	Automatic Data Processing Inc.	59 117	62 056	
USD	762	AutoZone Inc.	2 726 281	3 090 616	
USD	184	AvalonBay Communities Inc.	43 237	52 090	
USD	771	Baxter International Inc.	40 218	35 290	
USD	1 748	Becton, Dickinson and Co.	588 816	559 005	
USD	7 288	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	3 609 813	4 056 827	
	419	BRP Inc. du Canada	41 047	36 725	
USD	233	CBOE Global Markets, Inc.	49 279	54 219	
USD	232	Cencora Inc.	59 583	71 523	
USD	731	Cisco Systems Inc.	50 735	47 523	
USD	163	CME Group Inc.	44 227	43 850	
USD	652	Copart Inc.	42 708	48 320	
USD	372	Electronic Arts Inc.	63 628	70 923	
USD	471	Eli Lilly and Co.	335 396	583 511	
USD	14 269	Evergy Inc.	1 070 149	1 034 239	
USD	813	Exelon Corp.	43 979	38 503	
USD	590	Exxon Mobil Corp.	87 965	92 939	
USD	10 323	General Dynamics Corp.	4 056 029	4 098 367	
USD	633	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	84 633	87 084	
USD	1 859	Hershey Co. (The)	556 290	467 620	
USD	607	International Business Machines Corp.	128 869	143 650	
USD	12 609	Johnson & Johnson	2 646 346	2 521 775	
USD	81 963	Keurig Dr Pepper Inc.	3 621 430	3 745 946	
USD	1 970	Kinder Morgan Inc.	46 662	53 563	
USD	2 495	Labcorp Holdings Inc.	740 047	694 790	
USD	339	Leidos Holdings Inc.	47 312	67 669	
USD	459	Lockheed Martin Corp.	286 122	293 373	
USD	302	Marsh & McLennan Cos., Inc.	75 432	87 078	
USD	72	Mastercard Inc., catégorie A	39 917	43 464	
USD	2 909	McDonald's Corp.	1 101 424	1 014 398	
USD	118	McKesson Corp.	68 513	94 302	
USD	877	Merck & Co., Inc.	131 534	148 565	
USD	111	Microsoft Corp.	50 694	67 886	
USD	802	Newmont Corp.	45 052	45 949	
USD	122	Northrop Grumman Corp.	77 297	72 777	
USD	333	Oracle Corp.	48 092	64 339	
USD	1 061	O'Reilly Automotive Inc.	1 355 323	1 533 208	
USD	261	Packaging Corp. of America	54 541	65 199	
USD	15 740	PepsiCo Inc.	3 716 507	3 552 234	
USD	4 156	Pfizer Inc.	194 344	159 118	
USD	195	Procter & Gamble Co. (The)	40 912	44 005	
USD	1 638	Progressive Corp. (The)	358 944	465 552	
USD	4 045	Public Storage	1 533 254	1 592 136	
USD	16 206	Republic Services Inc.	3 353 419	4 309 584	
USD	679	Rollins Inc.	37 804	45 331	

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		É.-U. (suite)			
USD	273	Roper Technologies Inc.	187 777	210 561	
USD	95	S&P Global Inc.	48 066	57 977	
USD	184	Snap-On Inc.	65 456	65 812	
USD	11 443	Southern Co. (The)	1 080 264	1 214 593	
USD	217	T-Mobile US Inc.	43 863	52 313	
USD	191	Travelers Cos., Inc. (The)	47 340	53 144	
USD	126	Union Pacific Corp.	41 041	39 010	
USD	202	United Parcel Service Inc., catégorie B	45 950	37 826	
USD	167	VeriSign Inc.	46 400	40 630	
USD	553	Verisk Analytics Inc.	161 609	203 968	
USD	66 378	Verizon Communications Inc.	3 430 023	3 745 761	
USD	137	Visa Inc., catégorie A	45 636	49 204	
USD	2 727	W.R. Berkley Corp.	257 599	293 221	
USD	23 158	Walmart Inc.	1 784 088	2 145 611	
USD	14 616	Waste Management Inc.	3 450 270	4 266 759	
USD	322	Yum! Brands Inc.	56 883	58 363	
			48 862 604	52 376 965	64,5
		JAPON			
JPY	947	AGC Inc.	46 322	41 938	
JPY	830	Asahi Group Holdings Ltd.	41 334	40 068	
JPY	2 057	Brother Industries Ltd.	44 739	49 536	
JPY	1 335	Central Japan Railway Co.	43 206	39 440	
JPY	1 279	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	51 587	62 189	
JPY	1 481	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	55 999	68 181	
JPY	1 471	Daiwa House Industry Co., Ltd.	52 442	51 016	
JPY	1 789	East Japan Railway Co.	44 603	40 549	
JPY	1 389	Hankyu Hanshin Holdings Inc.	56 840	50 499	
JPY	2 240	Hitachi Ltd.	39 432	68 615	
JPY	2 420	Japan Metropolitan Fund Investment Corp.	2 231 507	1 863 000	
JPY	4 373	Japan Post Bank Co., Ltd.	53 898	56 524	
JPY	4 524	Japan Post Holdings Co., Ltd.	53 514	61 381	
JPY	1 298	Japan Tobacco Inc.	44 484	48 008	
JPY	1 531	KDDI Corp.	63 194	55 402	
JPY	1 382	Keihan Holdings Co., Ltd.	45 599	33 834	
JPY	1 131	Keio Corp.	46 253	35 914	
JPY	1 055	Kintetsu Group Holdings Co., Ltd.	43 225	31 428	
JPY	2 406	Kyocera Corp.	42 495	37 894	
JPY	1 435	Kyushu Railway Co.	42 569	42 541	
JPY	67 711	McDonald's Holdings Co. (Japan) Ltd.	3 856 001	3 651 720	
JPY	1 314	Mitsubishi Corp.	27 360	35 187	
JPY	2 591	Mitsubishi Estate Co., Ltd.	47 391	55 541	
JPY	3 520	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	37 783	51 771	
JPY	1 298	Mitsui & Co., Ltd.	31 768	40 312	
JPY	1 548	Mizuho Financial Group Inc.	34 240	44 218	
JPY	2 610	Monotaro Co., Ltd.	39 170	41 984	
JPY	42 104	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	67 523	54 368	
JPY	1 116	NISSIN FOODS HOLDINGS CO., LTD.	44 365	38 751	
JPY	7 506	Nomura Holdings Inc.	44 600	58 869	
JPY	2 563	Obayashi Corp.	30 762	41 686	
JPY	555	Oracle Corp. Japan	54 792	52 404	
JPY	973	Oriental Land Co., Ltd.	44 234	37 097	
JPY	727	Otsuka Holdings Co., Ltd.	35 768	41 867	
JPY	4 773	Resona Holdings Inc.	34 141	43 220	

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>JAPON (suite)</b>					
JPY	513	SECOM Co., Ltd.	46 382	41 443	
JPY	2 156	Seven & I Holdings Co., Ltd.	40 673	35 946	
JPY	1 429	Shin-Etsu Chemicals Co., Ltd.	65 883	75 828	
JPY	72 432	SoftBank Corp.	1 165 481	1 210 407	
JPY	5 847	Sohgo Security Services Co., Ltd.	45 209	46 733	
JPY	1 250	Sumitomo Corp.	33 804	42 713	
JPY	519	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	32 938	47 349	
JPY	1 259	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	51 555	44 681	
JPY	1 630	Tobu Railway Co.	53 868	37 555	
JPY	965	Tokio Marine Holdings Inc.	30 057	49 293	
JPY	1 597	West Japan Railway Co.	43 988	40 687	
JPY	2 139	Yamato Transport Co., Ltd.	47 015	32 178	
			9 229 993	8 771 765	10,8
<b>SUISSE</b>					
CHF	1 194	ABB Ltd., actions nominatives	60 570	90 763	
EUR	269	DSM-Firmenich AG	39 355	41 659	
CHF	9	Givaudan SA, actions nominatives	42 291	58 383	
CHF	834	Holcim Ltd.	78 717	101 116	
CHF	4 734	Nestlé SA, actions nominatives	738 542	661 185	
CHF	22 365	Novartis AG, actions nominatives	2 865 719	3 275 211	
CHF	122	Roche Holding AG	44 960	46 351	
CHF	791	Roche Holding AG-BR	314 709	329 792	
CHF	151	Schindler Holding AG	45 725	51 920	
CHF	195	Schindler Holding AG, actions nominatives	56 862	66 514	
CHF	411	Suisse Re AG	61 378	69 783	
CHF	4 682	Swisscom AG	3 886 944	3 603 988	
CHF	139	Zurich Insurance Group AG	92 807	101 408	
			8 328 579	8 498 073	10,5
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	445 034	Koninklijke KPN NV	2 199 760	2 336 506	
EUR	356	Wolters Kluwer NV	64 250	80 819	
			2 264 010	2 417 325	3,0
<b>HONG KONG</b>					
HKD	20 048	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd.	44 833	29 691	
HKD	2 648	Hang Seng Bank Ltd.	46 176	46 595	
HKD	856 848	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd.	703 936	743 361	
HKD	651 857	HKT Trust and HKT Ltd.	1 060 493	1 000 799	
USD	834	Jardine Matheson Holdings Ltd.	48 747	40 513	
HKD	6 980	Link REIT	50 719	37 128	
HKD	9 275	MTR Corp., Ltd.	50 667	40 070	
HKD	4 289	Swire Pacific Ltd., catégorie A	43 356	51 868	
			2 048 927	1 990 025	2,4
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	18 019	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	931 473	1 064 415	
EUR	1 971	Red Electrica Corp., SA	45 455	47 173	
			976 928	1 111 588	1,4
<b>BERMUDES</b>					
USD	5 642	Arch Capital Group Ltd.	604 952	778 894	
USD	128	Everest Re Group Ltd.	65 464	66 735	
			670 416	845 629	1,0
<b>CANADA</b>					
	1 734	Société aurifère Barrick	40 086	39 570	
	9 012	BCE Inc.	495 351	399 321	
	305	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	46 511	41 401	

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



# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>CANADA (suite)</b>			
	866	Emera Inc.	43 924	39 533	
	681	Banque Nationale du Canada	66 575	73 895	
	1 543	Saputo inc.	46 551	47 401	
	897	Suncor Énergie Inc.	40 175	46 779	
			779 173	687 900	0,8
		<b>ISRAËL</b>			
ILS	555	Azrieli Group Ltd.	42 565	44 552	
ILS	4 019	Bank Hapoalim BM	44 961	48 626	
ILS	4 315	Bank Leumi Le Israel	43 418	48 117	
ILS	369	Big Shopping Centers Ltd.	43 386	48 626	
USD	359	Check Point Software Technologies Ltd.	67 755	81 054	
ILS	310	Elbit Systems Ltd.	78 458	74 159	
ILS	947	First International Bank of Israel Ltd.	48 030	49 120	
ILS	6 196	Israel Discount Bank, catégorie A	40 608	42 288	
ILS	1 810	Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	80 989	83 890	
ILS	119	NICE Ltd.	33 793	26 630	
ILS	1 726	Strauss Group Ltd.	47 336	34 983	
ILS	921	Tower Semiconductor Ltd.	42 554	48 574	
			613 853	630 619	0,8
		<b>SINGAPOUR</b>			
SGD	10 328	Keppel Corp., Ltd.	65 825	67 468	
SGD	3 621	Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	46 768	52 756	
SGD	29 200	Singapore Airlines Ltd.	180 115	203 427	
SGD	4 400	Singapore Exchange Ltd.	42 075	42 115	
SGD	12 739	Singapore Technologies Engineering Ltd.	48 666	55 693	
SGD	21 867	Singapore Telecommunications Ltd.	54 120	60 716	
			437 569	482 175	0,6
		<b>ALLEMAGNE</b>			
EUR	187	Allianz SE, actions nominatives	62 711	71 166	
EUR	975	Bayer AG, actions nominatives	54 655	37 720	
EUR	285	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	42 793	36 939	
EUR	2 061	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	65 518	70 969	
EUR	793	Fresenius Medical Care AG & Co., KGaA	42 947	41 587	
EUR	195	Hannover Rueckversicherungs SE	58 263	67 690	
EUR	88	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, actions nominatives	47 819	60 268	
EUR	299	Siemens AG, actions nominatives	65 373	76 175	
			440 079	462 514	0,6
		<b>FRANCE</b>			
EUR	258	Aéroports de Paris	46 591	42 982	
EUR	281	Air Liquide SA	61 657	66 463	
EUR	6 452	Bolloré SE	53 201	51 852	
EUR	1 158	Bouygues SA	55 864	50 896	
EUR	17 384	Orange SA	281 646	238 472	
			498 959	450 665	0,6
		<b>R.-U.</b>			
GBP	5 930	BP PLC	50 760	48 743	
GBP	5 778	HSBC Holdings PLC	57 653	68 352	
GBP	3 812	National Grid PLC	66 176	58 196	
GBP	390	Next PLC	48 134	60 956	
GBP	3 015	Pearson PLC	46 682	51 672	
GBP	552	Reckitt Benckiser Group PLC	49 843	40 885	
GBP	1 207	RELX PLC	58 485	75 974	
GBP	5 156	Rentokil Initial PLC	45 128	41 132	
			422 861	445 910	0,5

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	1 994	Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	44 548	51 460	
AUD	1 033	BHP Group Ltd.	42 345	40 290	
AUD	3 400	Brambles Ltd.	43 174	45 146	
AUD	489	Commonwealth Bank of Australia	45 174	56 923	
AUD	12 363	Telstra Corp., Ltd.	44 262	40 899	
AUD	2 178	Westpac Banking Corp.	43 727	54 198	
AUD	1 498	Woodside Energy Group Ltd.	43 247	38 618	
AUD	1 411	Woolworths Group Ltd.	45 486	43 570	
			351 963	371 104	0,5
<b>DANEMARK</b>					
DKK	222	Carlsberg AS, série B	42 110	36 480	
DKK	10 661	Tryg AS	305 535	319 090	
			347 645	355 570	0,4
<b>FINLANDE</b>					
EUR	1 111	Elisa OYJ	77 721	69 800	
EUR	940	Huhtamaki OYJ	47 319	51 640	
EUR	686	Kone OYJ, catégorie B	44 570	46 368	
EUR	753	Sampo Oyj, actions A	45 285	44 282	
			214 895	212 090	0,3
<b>ITALIE</b>					
EUR	114	Ferrari NV	51 453	63 647	
EUR	3 860	Poste Italiane SPA	56 232	67 335	
EUR	6 291	Snam SpA	42 511	38 112	
EUR	3 867	Terna - Rete Elettrica Nazionale SpA	42 624	40 934	
			192 820	210 028	0,3
<b>SUÈDE</b>					
SEK	1 267	Axfood AB	42 438	45 576	
SEK	1 476	Industrivarden AB, série C	57 048	68 199	
SEK	1 897	Investor AB, catégorie A	53 685	70 518	
			153 171	184 293	0,2
<b>IRLANDE</b>					
USD	166	Aon PLC	71 946	66 686	
USD	75	Linde PLC	41 882	45 033	
			113 828	111 719	0,1
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	1 250	CA Immobilien Anlagen AG	52 376	56 755	
EUR	3 603	Telekom Austria AG	42 859	49 246	
			95 235	106 001	0,1
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	260	Ackermans & van Haaren NV	57 516	61 580	0,1
<b>PORTUGAL</b>					
EUR	8 831	Navigator Co., SA (Le)	46 237	50 327	0,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>77 147 261</b>	<b>80 833 865</b>	<b>99,6</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(36 403)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>77 110 858</b>	<b>80 833 865</b>	<b>99,6</b>
Contrat(s) de change à terme				187 772	0,2
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>77 110 858</b>	<b>81 021 637</b>	<b>99,8</b>
Autres actifs (passifs) nets				158 831	0,2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>81 180 468</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	132 002	AUD	145 145	0,91	(640)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	3 038 733	CHF	1 972 604	1,54	34 330
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	125 247	DKK	626 799	0,20	1 976
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	1 906 534	EUR	1 279 541	1,49	29 957
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	158 381	GBP	90 587	1,75	1 695
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	725 307	HKD	4 141 486	0,18	(556)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	3 308 679	JPY	373 171 734	0,01	133 457
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	68 417	SEK	521 963	0,13	971
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	174 141	SGD	171 221	1,02	1 256
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	19 544 485	USD	14 294 649	1,37	(14 674)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>187 772</b>

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	204	(16)	-	188
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>(16)</b>	<b>-</b>	<b>188</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(16)	16	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(16)</b>	<b>16</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	566	(68)	-	498
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>566</b>	<b>(68)</b>	<b>-</b>	<b>498</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(68)	68	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(68)</b>	<b>68</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	12	14
Paielements indirects†	5	5

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 575 127	-	1 856 214	-
Parts rachetables émises	-	250 000	800 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(200 000)	(150 000)	(250 000)	(450 000)
Émission de parts rachetables liée à l'acquisition des actifs de fonds clôturés	-	1 525 127	-	956 214
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 375 127</b>	<b>1 625 127</b>	<b>2 406 214</b>	<b>606 214</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,350
Parts ordinaires non couvertes	0,350

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	922	25
Garanties (hors trésorerie)	980	27

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	5	1
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	4	1
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,4</b>

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
É.-U.	60,9
Japon	12,8
Suisse	9,6
Canada	3,8
Hong Kong	2,5
Israël	2,4
Espagne	1,4
Bermudes	0,8
France	0,8
Contrat(s) de change à terme	0,7
Singapour	0,6
Allemagne	0,5
R.-U.	0,5
Danemark	0,5
Australie	0,5
Italie	0,3
Pays-Bas	0,3
Finlande	0,3
Suède	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Irlande	0,1
Belgique	0,1
Autriche	0,1
Portugal	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition directe du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,8
<b>Total</b>	<b>0,8</b>

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

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

# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait dans des actions et des actions privilégiées mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

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

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net de la volatilité minimale à la baisse des marchés développés (couvert en \$ CA)	7 693 014

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net de la volatilité minimale à la baisse des marchés développés (couvert en \$ CA)	6 578 786

## Risque de change

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

au 30 juin 2024-

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	53 510	(19 559)	33 951	41,8
Yen japonais	8 787	(3 175)	5 612	6,9
Franc suisse	8 435	(3 004)	5 431	6,7
Euro	5 127	(1 877)	3 250	4,0
Dollar de Hong Kong	1 954	(726)	1 228	1,5
Shekel israélien	550	-	550	0,7
Livre sterling	451	(157)	294	0,4
Dollar de Singapour	485	(173)	312	0,4
Dollar australien	375	(133)	242	0,3
Couronne danoise	359	(123)	236	0,3
Couronne suédoise	186	(67)	119	0,1
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>80 220</b>	<b>(28 994)</b>	<b>51 226</b>	<b>63,1</b>

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



# FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	42 376	(19 088)	23 289	33,5
Yen japonais	8 939	(4 106)	4 833	7,0
Franc suisse	7 325	(3 383)	3 942	5,7
Shekel israélien	1 596	-	1 596	2,3
Euro	2 692	(1 204)	1 488	2,1
Dollar de Hong Kong	1 738	(729)	1 009	1,5
Dollar de Singapour	438	(191)	247	0,4
Livre sterling	362	(162)	200	0,3
Couronne danoise	351	(162)	189	0,3
Dollar australien	319	(139)	179	0,3
Couronne suédoise	151	(64)	86	0,1
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
Couronne norvégienne	1	-	1	0,0
<b>Total</b>	<b>66 289</b>	<b>(29 228)</b>	<b>37 060</b>	<b>53,5</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 5 123 000 \$ (3 706 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	80 834	-	-	80 834
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	188	-	188
<b>Total</b>	<b>80 834</b>	<b>188</b>	<b>-</b>	<b>81 022</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	68 835	-	-	68 835
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	498	-	498
<b>Total</b>	<b>68 835</b>	<b>498</b>	<b>-</b>	<b>69 333</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Lingots à leur juste valeur	77 936	63 785
Trésorerie	47	7
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	6	740
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de lingots	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	77 989	64 532
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	60	25
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	10	8
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de lingots	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	3	4
	73	37
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>77 916</b>	<b>64 495</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB couverte en \$ CA	29 715	26 030	29,04*	26,00*	1 400 000	1 320 000
Série FNB non couverte en \$ CA	15 526	10 547	31,71*	27,27*	670 000	510 000
Série FNB en \$ US	32 675	27 918	23,17	20,68	1 410 000	1 350 000

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

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les lingots et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	-	3
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de lingots et de dérivés	718	708
Variation de la plus-value (moins-value) latente des lingots et des dérivés	6 468	1 850
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les lingots et les dérivés</b>	<b>7 186</b>	<b>2 561</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	9	1
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>9</b>	<b>1</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>7 195</b>	<b>2 562</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	55	41
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charge d'intérêts	1	2
Taxe de vente harmonisée	4	3
<b>Total des charges</b>	<b>61</b>	<b>47</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 134</b>	<b>2 515</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Série FNB couverte en \$ CA	1 940	1 056	1,43	1,20	1 353 846	876 575
Série FNB non couverte en \$ CA	1 399	476	2,39	0,85	585 824	563 039
Série FNB en \$ US	3 795	983	2,67	0,71	1 420 440	1 388 232

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

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

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

	Série FNB couverte		Série FNB non couverte		Série FNB en \$ US		Total du Fonds	
	en \$ CA		en \$ CA		en \$			
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	26 030	13 513	10 547	9 580	27 918	22 957	64 495	46 050
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 940	1 056	1 399	476	3 795	983	7 134	2 515
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>								
Revenu net de placement	-	-	-	-	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>								
Produit de l'émission de parts rachetables	3 346	2 878	3 580	1 560	4 233	9 464	11 159	13 902
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 601)	-	-	-	(3 271)	(2 745)	(4 872)	(2 745)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 745	2 878	3 580	1 560	962	6 719	6 287	11 157
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	3 685	3 934	4 979	2 036	4 757	7 702	13 421	13 672
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	29 715	17 447	15 526	11 616	32 675	30 659	77 916	59 722

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 134	2 515
Ajustements au titre des éléments suivants :		
Profit (perte) net(te) total(e) sur les lingots et les dérivés	(718)	(708)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des lingots et des dérivés	(6 468)	(1 850)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Produit de la vente et de l'échéance de lingots et de dérivés	994	860
Achat de lingots et de dérivés	(904)	(822)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	1
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	1
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>40</b>	<b>(3)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-	-
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	40	(3)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	7	3
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>47</b>	<b>-</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	3
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(1)	(2)
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.

# Fonds de lingots d'or CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (exprimé en \$ US)

Nombre de d'onces	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>LINGOTS</b>				
33 436	Lingots d'or 400 oz	63 569 297	77 936 005	
	<b>Total Lingots</b>	<b>63 569 297</b>	<b>77 936 005</b>	<b>100,0</b>
	Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-		
	<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>63 569 297</b>	<b>77 936 005</b>	<b>100,0</b>
	Contrat(s) de change à terme		(53 543)	(0,1)
	<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>63 569 297</b>	<b>77 882 462</b>	<b>99,9</b>
	Autres actifs (passifs) nets		33 680	0,1
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>77 916 142</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	41 109 154	USD	30 096 548	1,37	(53 683)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	30 096 548	CAD	41 191 233	0,73	(6 301)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	01 août 2024	CAD	40 225 956	USD	29 411 135	1,37	6 441
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(53 543)</b>

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

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	6	(6)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	6	(6)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(60)	6	-	(54)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(60)	6	-	(54)

au 31 décembre 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	740	(25)	-	715
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	740	(25)	-	715
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(25)	25	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(25)	25	-	-

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

# Fonds de lingots d'or CI

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

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paievements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Série FNB couverte en \$ CA		Série FNB non couverte en \$ CA		Série FNB en \$ US	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 320 000	800 000	510 000	530 000	1 350 000
Parts rachetables émises	160 000	160 000	160 000	80 000	200 000	480 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(80 000)	-	-	-	(140 000)	(140 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 400 000</b>	<b>960 000</b>	<b>670 000</b>	<b>610 000</b>	<b>1 410 000</b>	<b>1 610 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# Fonds de lingots d'or CI

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

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

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

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

# Fonds de lingots d'or CI

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

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Lingots	98,9
Contrat(s) de change à terme	1,1
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,1
<b>Total</b>	<b>1,1</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était principalement investi dans l'or et, par conséquent, le Fonds était sensible aux variations du prix de l'or.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur de l'or avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 7 794 000 \$ (6 379 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être

### Risque de change

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

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar canadien	46	29 358	29 404	37,7
<b>Total</b>	<b>46</b>	<b>29 358</b>	<b>29 404</b>	<b>37,7</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar canadien	6	25 976	25 982	40,3
<b>Total</b>	<b>6</b>	<b>25 976</b>	<b>25 982</b>	<b>40,3</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar américain avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 2 940 000 \$ (2 598 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# Fonds de lingots d'or CI

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

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des lingots d'or.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Lingots	77 936	-	-	77 936
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(54)	-	(54)
<b>Total</b>	<b>77 936</b>	<b>(54)</b>	<b>-</b>	<b>77 882</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Lingots	63 785	-	-	63 785
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	715	-	715
<b>Total</b>	<b>63 785</b>	<b>715</b>	<b>-</b>	<b>64 500</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	133 203	123 648
Placements donnés en garantie	12 190	11 018
Trésorerie	100	177
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	3
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	28	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	2	3
	145 523	134 849
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	6	27
Swaps, options sur swaps et options	617	388
Frais de gestion à payer	78	75
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	13	56
	714	546
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>144 809</b>	<b>134 303</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires couvertes	141 134	130 768	10,02	9,86	14 088 041	13 263 041
Parts ordinaires couvertes en \$ US	3 675	3 535	7,68*	7,62*	350 000	350 000

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

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

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

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 620	2 512
Intérêts aux fins des distributions	11	16
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	2 335	3 495
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(16 815)	(6 042)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	23 997	873
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>11 148</b>	<b>854</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	15	14
Profit (perte) de change sur la trésorerie	23	(20)
Rabais sur frais	21	130
Autres revenus	42	2
<b>Total des autres revenus</b>	<b>101</b>	<b>126</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>11 249</b>	<b>980</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	456	583
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	373	397
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	52	200
Taxe de vente harmonisée	49	47
<b>Total des charges</b>	<b>931</b>	<b>1 228</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>10 318</b>	<b>(248)</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	10 004	(167)	0,69	(0,01)	14 457 409	16 218 428
Parts ordinaires couvertes en \$ US	314	(81)	0,83	(0,38)	376 923	209 530

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

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

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	130 768	183 328	3 535	2 197	134 303	185 525
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10 004	(167)	314	(81)	10 318	(248)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(1 205)	(2 288)	(39)	(69)	(1 244)	(2 357)
Profits nets réalisés	(402)	-	(9)	-	(411)	-
Remboursement de capital	(3 442)	(4 813)	(85)	(44)	(3 527)	(4 857)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(5 049)</b>	<b>(7 101)</b>	<b>(133)</b>	<b>(113)</b>	<b>(5 182)</b>	<b>(7 214)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	36 743	47 620	2 552	594	39 295	48 214
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(31 332)	(95 845)	(2 593)	(289)	(33 925)	(96 134)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>5 411</b>	<b>(48 225)</b>	<b>(41)</b>	<b>305</b>	<b>5 370</b>	<b>(47 920)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>10 366</b>	<b>(55 493)</b>	<b>140</b>	<b>111</b>	<b>10 506</b>	<b>(55 382)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>141 134</b>	<b>127 835</b>	<b>3 675</b>	<b>2 308</b>	<b>144 809</b>	<b>130 143</b>

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

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

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	10 318	(248)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	16 815	6 042
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(23 997)	(873)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	373	397
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	47 982	44 842
Achat de placements et de dérivés	(46 520)	(41 799)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(28)	67
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	(32)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(41)	7
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>4 905</b>	<b>8 403</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(5 181)	(7 214)
Produit de l'émission de parts rachetables	(95)	125
Montant versé au rachat de parts rachetables	294	(1 559)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(4 982)</b>	<b>(8 648)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(77)	(245)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	177	493
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>100</b>	<b>248</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	11	16
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 540	2 379
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.

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>MATÉRIAUX</b>					
	108 037	Mines Agnico Eagle Limitée	7 680 984	9 667 150	
	446 051	Alamos Gold Inc., catégorie A	7 582 361	9 572 255	
USD	293 307	AngloGold Ashanti PLC	7 987 767	10 083 630	
	2 703 947	B2Gold Corp.	12 229 245	9 923 485	
	423 424	Société aurifère Barrick	10 801 060	9 662 536	
	326 831	Endeavour Mining PLC	9 155 085	9 445 416	
USD	59 871	Franco-Nevada Corp.	10 006 104	9 711 076	
	477 977	Gold Fields Ltd., CAAE	8 228 904	9 743 057	
USD	780 734	Harmony Gold Mining Co., Ltd., CAAE	8 437 024	9 794 322	
	926 546	Kinross Gold Corp.	6 486 433	10 553 360	
USD	164 912	Newmont Corp.	9 905 736	9 446 201	
	428 719	Redevances aurifères Osisko Ltée	9 669 306	9 140 289	
	344 792	Pan American Silver Corp.	8 490 780	9 374 895	
USD	56 654	Royal Gold Inc.	8 997 661	9 700 589	
	133 487	Wheaton Precious Metals Corp.	7 773 702	9 575 022	
			133 432 152	145 393 283	100,4
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>133 432 152</b>	<b>145 393 283</b>	<b>100,4</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(422 118)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>133 010 034</b>	<b>145 393 283</b>	<b>100,4</b>
Contrat(s) de change à terme				(5 609)	0,0
Position(s) vendeur sur option(s)				(617 145)	(0,4)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>133 010 034</b>	<b>144 770 529</b>	<b>100,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				38 150	0,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>144 808 679</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	38 267	CAD	52 311	0,73	16
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	98 581	CAD	134 867	0,73	(64)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	1 640 917	CAD	2 249 410	0,73	(5 561)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(5 609)</b>

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

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Date d'expiration	Taille du lot par contrat	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste du contrat (\$)
(270)	Agnico Eagle Mines Ltd., (option d'achat) – 92,00	19 juillet 2024	100	92,00	CAD	(47 520)	(36 855)
(1 117)	Alamos Gold Inc., catégorie A, (option d'achat) – 22,50	19 juillet 2024	100	22,50	CAD	(35 744)	(27 366)
(734)	AngloGold Ashanti Ltd., PLC, (option d'achat) – 25,00	19 juillet 2024	100	25,00	USD	(61 327)	(105 436)
(6 771)	B2Gold Corp., (option d'achat) – 3,75	19 juillet 2024	100	3,75	CAD	(60 939)	(71 096)
(1 060)	Barrick Gold Corp., (option d'achat) – 23,50	19 juillet 2024	100	23,50	CAD	(42 400)	(32 860)
(818)	Endeavour Mining PLC, (option d'achat) – 31,00	19 juillet 2024	100	31,00	CAD	(30 266)	(19 632)
(149)	Franco-Nevada Corp., (option d'achat) – 170,00	19 juillet 2024	100	170,00	CAD	(24 436)	(21 233)
(1 197)	Gold Fields Ltd., CAAE, (option d'achat) – 16,00	19 juillet 2024	100	16,00	USD	(40 989)	(32 751)
(1 955)	Harmony Gold Mining Co., Ltd., CAAE, (option d'achat) – 10,00	19 juillet 2024	100	10,00	USD	(40 167)	(26 745)
(2 320)	Kinross Gold Corp., (option d'achat) – 11,00	19 juillet 2024	100	11,00	CAD	(37 120)	(142 680)
(412)	Newmont Corp., (option d'achat) – 45,00	19 juillet 2024	100	45,00	USD	(36 681)	(17 191)
(1 073)	Redevances aurifères Osisko Ltée, (option d'achat) – 23,50	19 juillet 2024	100	23,50	CAD	(31 761)	(7 511)
(863)	Pan American Silver Corp., (option d'achat) – 29,00	19 juillet 2024	100	29,00	CAD	(67 313)	(38 835)
(141)	Royal Gold Inc., (option d'achat) – 130,00	19 juillet 2024	100	130,00	USD	(31 480)	(20 254)
(334)	Wheaton Precious Metals Corp., (option d'achat) – 76,00	19 juillet 2024	100	76,00	CAD	(30 394)	(16 700)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(618 537)</b>	<b>(617 145)</b>

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

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



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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

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

au 31 décembre 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	3	(3)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	3	(3)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(27)	3	-	(24)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(27)	3	-	(24)

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	373	386
Paielements indirects†	139	136

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	13 263 041	17 288 041	350 000	200 000
Parts rachetables émises	4 000 000	4 225 000	250 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(3 175 000)	(8 725 000)	(250 000)	(25 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>14 088 041</b>	<b>12 788 041</b>	<b>350 000</b>	<b>225 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	11 119	-
Garanties (hors trésorerie)	11 733	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	23	22
Charges	(8)	(8)
Revenu tiré des prêts de titres	15	14
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>36,1</b>	<b>39,1</b>

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Matériaux	100,3
Contrat(s) de change à terme	0,0
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,3</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,3)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,3)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 14 539 000 \$ (13 467 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	49 061	2 229	51 290	35,4
<b>Total</b>	<b>49 061</b>	<b>2 229</b>	<b>51 290</b>	<b>35,4</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	54 049	1 987	56 036	41,7
<b>Total</b>	<b>54 049</b>	<b>1 987</b>	<b>56 036</b>	<b>41,7</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 5 129 000 \$ (5 604 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	145 393	-	-	145 393
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(6)	-	(6)
<b>Total</b>	<b>145 393</b>	<b>(6)</b>	<b>-</b>	<b>145 387</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(617)	-	-	(617)
<b>Total</b>	<b>(617)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(617)</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	134 666	-	-	134 666
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(24)	-	(24)
<b>Total</b>	<b>134 666</b>	<b>(24)</b>	<b>-</b>	<b>134 642</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(388)	-	-	(388)
<b>Total</b>	<b>(388)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(388)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	23 648	2 089
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	80	11
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	1
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	23 728	2 101
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	4	-
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	1	-
	5	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	23 723	2 101

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	23 723	2 101	22,59	21,01	1 050 000	100 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	172	8
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	36	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	76	2
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>284</b>	<b>10</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	(2)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>(1)</b>	<b>(2)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>283</b>	<b>8</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	7	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Retenues d'impôts	16	-
Taxe de vente harmonisée	1	-
<b>Total des charges</b>	<b>28</b>	<b>1</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>255</b>	<b>7</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	255	7	0,83	0,15	307 967	50 000

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 101	-	2 101	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	255	7	255	7
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(67)	-	(67)	-
Profits nets réalisés	(6)	-	(6)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(73)	-	(73)	-
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	22 533	1 000	22 533	1 000
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 093)	-	(1 093)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	21 440	1 000	21 440	1 000
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	21 622	1 007	21 622	1 007
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	23 723	1 007	23 723	1 007

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



# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	255	7
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(36)	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(76)	(2)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 345	2
Achat de placements et de dérivés	(1 365)	(1 005)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	1	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	4	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>132</b>	<b>(998)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(73)	-
Produit de l'émission de parts rachetables	14	1 000
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(63)</b>	<b>1 000</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	69	2
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	11	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>80</b>	<b>2</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	157	8
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.

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	83 723	FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	3 600 562	3 636 090	
	302 413	FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	6 620 661	6 547 242	
	231 294	FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	5 794 116	6 039 086	
USD	49 481	iShares Core MSCI EAFE ETF	5 024 508	4 917 182	
USD	19 448	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	1 421 301	1 424 210	
	51 539	Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	1 081 151	1 084 381	
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>23 542 299</b>	<b>23 648 191</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(30 811)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>23 511 488</b>	<b>23 648 191</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		75 080	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>23 723 271</b>	<b>100,0</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

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

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

au 30 juin 2024

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	126 660	6 039	4,8
FNB Indice d'actions canadiennes CI	177 396	6 547	3,7
FNB Indice des obligations totales du Canada CI	106 809	3 636	3,4
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	159 407	1 085	0,7
iShares Core MSCI EAFE ETF	159 656 119	4 917	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	108 221 831	1 424	-

au 31 décembre 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	89 811	508	0,6
FNB Indice d'actions canadiennes CI	154 779	545	0,4
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	143 190	100	0,1
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	7 003 863	341	-
iShares Core MSCI EAFE ETF	141 503 812	429	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	99 043 677	166	-

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	3	-
Paiements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	100 000	-
Parts rachetables émises	1 000 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>1 050 000</b>	<b>50 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,220

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (parts non couvertes)	3 636
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	6 547
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	6 039

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	252
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	238

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

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

au 30 juin 2024

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	27,6
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	25,5
iShares Core MSCI EAFE ETF	20,7
FNB Indice des obligations totales du Canada CI (Parts non couvertes)	15,3
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	6,0
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	4,6
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

au 31 décembre 2023

	Actif net (%)
<b>Fonds</b>	
FNB Indice d'actions canadiennes CI (parts ordinaires non couvertes)	26,0
FNB Indice 1000 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	24,2
iShares Core MSCI EAFE ETF	20,4
iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF	16,2
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	7,9
Vanguard Global Aggregate Bond Index ETF	4,7
Autres actifs (passifs) nets	0,6
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds avait une exposition indirecte à l'autre risque de prix des fonds sous-jacents.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des fonds sous-jacents avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 2 365 000 \$ (209 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	6 362	-	6 362	26,8
<b>Total</b>	<b>6 362</b>	<b>-</b>	<b>6 362</b>	<b>26,8</b>

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

# FNB de répartition de l'actif de croissance CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	305	-	305	14,5
<b>Total</b>	<b>305</b>	<b>-</b>	<b>305</b>	<b>14,5</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 636 000 \$ (31 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	23 648	-	-	23 648
<b>Total</b>	<b>23 648</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23 648</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Fonds négocié(s) en bourse	2 089	-	-	2 089
<b>Total</b>	<b>2 089</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2 089</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et l'exercice clos le 31 décembre 2023.

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	69 438	68 393
Placements donnés en garantie	23 156	23 144
Trésorerie	97	272
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	220	1 109
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	84	77
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	6
	92 995	93 001
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	31
Swaps, options sur swaps et options	296	573
Frais de gestion à payer	51	52
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	12	54
	362	710
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>92 633</b>	<b>92 291</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires couvertes	85 659	73 860	11,27	11,36	7 600 000	6 500 000
Parts ordinaires couvertes en \$ US	1 319	1 285	9,64*	9,70*	100 000	100 000
Parts ordinaires non couvertes	5 655	17 146	12,57	12,25	450 000	1 400 000

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

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 068	1 168
Intérêts aux fins des distributions	12	11
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	1 405	1 793
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	58	3 630
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	602	(8 645)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 145</b>	<b>(2 043)</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	9	(15)
Rabais sur frais	25	58
Autres revenus	37	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>71</b>	<b>43</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 216</b>	<b>(2 000)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	314	366
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	31	36
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	100	169
Taxe de vente harmonisée	31	33
<b>Total des charges</b>	<b>477</b>	<b>605</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 739</b>	<b>(2 605)</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	1 765	(1 952)	0,25	(0,26)	7 076 923	7 626 243
Parts ordinaires couvertes en \$ US	78	(78)	0,78	(0,71)	100 000	109 392
Parts ordinaires non couvertes	896	(575)	0,83	(0,30)	1 079 121	1 922 376

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	73 860	82 126	1 285	1 375	17 146	6 554	92 291	90 055
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 765	(1 952)	78	(78)	896	(575)	2 739	(2 605)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>								
Revenu net de placement	(536)	(295)	(9)	(4)	(53)	(86)	(598)	(385)
Profits nets réalisés	(1 485)	(147)	(24)	(2)	(222)	(62)	(1 731)	(211)
Remboursement de capital	(701)	(1 680)	(11)	(24)	(106)	(750)	(818)	(2 454)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2 722)	(2 122)	(44)	(30)	(381)	(898)	(3 147)	(3 050)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>								
Produit de l'émission de parts rachetables	20 199	19 565	-	660	2 597	58 579	22 796	78 804
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(7 443)	(10 844)	-	(642)	(14 603)	(47 729)	(22 046)	(59 215)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	12 756	8 721	-	18	(12 006)	10 850	750	19 589
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	11 799	4 647	34	(90)	(11 491)	9 377	342	13 934
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	85 659	86 773	1 319	1 285	5 655	15 931	92 633	103 989

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 739	(2 605)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(58)	(3 630)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(602)	8 645
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	31	36
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	24 461	20 161
Achat de placements et de dérivés	(23 454)	(18 857)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(6)	(11)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	7
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(37)	12
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>3 074</b>	<b>3 758</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 147)	(3 050)
Produit de l'émission de parts rachetables	7	(31)
Montant versé au rachat de parts rachetables	(109)	(668)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(3 249)</b>	<b>(3 749)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(175)	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	272	270
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>97</b>	<b>279</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	12	11
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	962	988
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.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
É.-U.					
USD	32 356	Abbott Laboratories	4 729 465	4 599 537	
USD	20 050	AbbVie Inc.	4 172 360	4 704 691	
USD	11 009	Amgen Inc.	4 002 341	4 705 766	
USD	82 426	Bristol-Myers Squibb Co.	6 388 441	4 683 043	
USD	10 076	Cigna Corp.	3 879 149	4 556 733	
USD	55 952	CVS Health Corp.	5 617 106	4 520 756	
USD	13 467	Danaher Corp.	4 059 439	4 603 119	
USD	6 407	Elevance Health Inc.	4 032 301	4 749 455	
USD	3 859	Eli Lilly and Co.	2 962 295	4 779 777	
USD	48 703	Gilead Sciences Inc.	4 841 071	4 571 357	
USD	10 049	HCA Healthcare Inc.	3 538 548	4 416 808	
USD	22 961	Johnson & Johnson	4 846 071	4 591 148	
USD	5 654	McKesson Corp.	4 691 238	4 517 523	
USD	26 275	Merck & Co., Inc.	3 763 957	4 450 055	
USD	123 266	Pfizer Inc.	5 616 971	4 718 381	
USD	10 012	Stryker Corp.	3 595 351	4 660 376	
USD	6 047	Thermo Fisher Scientific Inc.	4 452 025	4 574 747	
USD	7 066	UnitedHealth Group Inc.	4 466 415	4 922 833	
USD	19 975	Zoetis Inc.	4 551 836	4 737 374	
			84 206 380	88 063 479	95,1
IRLANDE					
USD	42 074	Medtronic PLC	4 921 129	4 530 495	4,9
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>89 127 509</b>	<b>92 593 974</b>	<b>100,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(40 220)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>89 087 289</b>	<b>92 593 974</b>	<b>100,0</b>
Contrat(s) de change à terme				216 971	0,2
Position(s) vendeur sur option(s)				(295 746)	(0,3)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>89 087 289</b>	<b>92 515 199</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				118 003	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>92 633 202</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	89 963 657	USD	65 630 672	1,37	217 936
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	417 150	CAD	569 191	0,73	1 234
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	419 971	CAD	573 259	0,73	1 025
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	836 629	CAD	1 144 188	0,73	(152)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	415 700	CAD	569 300	0,73	(857)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	1 331 358	CAD	1 822 762	0,73	(2 215)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>216 971</b>

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

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

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

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(82)	Abbott Laboratories, (option d'achat) – 110,00	100	19 juillet 2024	110,00	USD	(9 798)	(5 721)
(51)	AbbVie Inc., (option d'achat) – 175,00	100	19 juillet 2024	175,00	USD	(8 592)	(6 698)
(28)	Amgen Inc., (option d'achat) – 310,00	100	19 juillet 2024	310,00	USD	(26 961)	(29 591)
(209)	Bristol-Myers Squibb Co., (option d'achat) – 42,00	100	19 juillet 2024	42,00	USD	(24 619)	(14 296)
(25)	Cigna Corp., (option d'achat) – 350,00	100	19 juillet 2024	350,00	USD	(10 547)	(2 822)
(142)	CVS Health Corp., (option d'achat) – 62,50	100	19 juillet 2024	62,50	USD	(23 145)	(7 382)
(34)	Danaher Corp., (option d'achat) – 260,00	100	19 juillet 2024	260,00	USD	(16 398)	(7 791)
(16)	Elevance Health Inc., (option d'achat) – 540,00	100	19 juillet 2024	540,00	USD	(23 406)	(31 192)
(9)	Eli Lilly and Co., (option d'achat) – 890,00	100	19 juillet 2024	890,00	USD	(27 305)	(37 183)
(123)	Gilead Sciences Inc., (option d'achat) – 72,50	100	19 juillet 2024	72,50	USD	(18 027)	(4 375)
(25)	HCA Healthcare Inc., (option d'achat) – 345,00	100	19 juillet 2024	345,00	USD	(20 477)	(4 532)
(58)	Johnson & Johnson, (option d'achat) – 150,00	100	19 juillet 2024	150,00	USD	(20 496)	(8 927)
(14)	McKesson Corp., (option d'achat) – 610,00	100	19 juillet 2024	610,00	USD	(18 946)	(2 777)
(107)	Medtronic PLC, (option d'achat) – 82,50	100	19 juillet 2024	82,50	USD	(10 113)	(4 318)
(66)	Merck & Co. Inc., (option d'achat) – 135,00	100	19 juillet 2024	135,00	USD	(6 238)	(1 716)
(313)	Pfizer Inc., (option d'achat) – 28,00	100	19 juillet 2024	28,00	USD	(24 437)	(27 191)
(25)	Stryker Corp., (option d'achat) – 350,00	100	19 juillet 2024	350,00	USD	(11 232)	(7 781)
(15)	Thermo Fisher Scientific Inc., (option d'achat) – 570,00	100	19 juillet 2024	570,00	USD	(20 772)	(9 542)
(17)	UnitedHealth Group Inc., (option d'achat) – 490,00	100	19 juillet 2024	490,00	USD	(27 197)	(61 048)
(50)	Zoetis Inc., (option d'achat) – 175,00	100	19 juillet 2024	175,00	USD	(15 957)	(20 863)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(364 663)</b>	<b>(295 746)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2024

	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	220	(3)	-	217
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>220</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>217</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(3)</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	1 109	(31)	-	1 078
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 109</b>	<b>(31)</b>	<b>-</b>	<b>1 078</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(31)	31	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(31)</b>	<b>31</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	31	27
Paielements indirects†	12	9

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	6 500 000	6 850 000	100 000	100 000	1 400 000	500 000
Parts rachetables émises	1 750 000	1 700 000	-	50 000	200 000	4 600 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(650 000)	(950 000)	-	(50 000)	(1 150 000)	(3 800 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>7 600 000</b>	<b>7 600 000</b>	<b>100 000</b>	<b>100 000</b>	<b>450 000</b>	<b>1 300 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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



# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Actions - É.-U.	94,3
Actions - Irlande	4,8
Contrat(s) de change à terme	1,2
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,6</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,6)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,6)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

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

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,2
<b>Total</b>	<b>1,2</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 9 259 000 \$ (9 154 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024-

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	92 708	(85 364)	7 344	7,9
<b>Total</b>	<b>92 708</b>	<b>(85 364)</b>	<b>7 344</b>	<b>7,9</b>

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

# FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	91 674	(71 314)	20 360	22,1
<b>Total</b>	<b>91 674</b>	<b>(71 314)</b>	<b>20 360</b>	<b>22,1</b>

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

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 734 000 \$ (2 036 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	92 594	-	-	92 594
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	217	-	217
<b>Total</b>	<b>92 594</b>	<b>217</b>	<b>-</b>	<b>92 811</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(296)	-	-	(296)
<b>Total</b>	<b>(296)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(296)</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	91 537	-	-	91 537
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 078	-	1 078
<b>Total</b>	<b>91 537</b>	<b>1 078</b>	<b>-</b>	<b>92 615</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(573)	-	-	(573)
<b>Total</b>	<b>(573)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(573)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	6 606 435	8 231 639
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	697 795	513 782
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	20 015	10 012
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	709	1 003
Rabais sur frais à recevoir	2 231	2 698
	7 327 185	8 759 134
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	2 587	3 091
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	2 436	3 092
	5 023	6 183
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>7 322 162</b>	<b>8 752 951</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	7 322 162	8 752 951	50,04	50,06	146 300 000	174 800 000

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	192 238	163 608
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	-	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	-	-
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>192 238</b>	<b>163 608</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	4 727	3 857
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>4 727</b>	<b>3 857</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>196 965</b>	<b>167 465</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	5 490	4 645
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charge d'intérêts	-	11
Taxe de vente harmonisée	45	100
<b>Total des charges</b>	<b>5 536</b>	<b>4 757</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>191 429</b>	<b>162 708</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	191 429	162 708	1,22	1,22	157 417 857	133 536 188

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	8 752 951	5 313 512	8 752 951	5 313 512
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	191 429	162 708	191 429	162 708
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(193 344)	(166 863)	(193 344)	(166 863)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(789)	(1 559)	(789)	(1 559)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(194 133)	(168 422)	(194 133)	(168 422)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	598 719	2 858 300	598 719	2 858 300
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 026 804)	(633 388)	(2 026 804)	(633 388)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(1 428 085)	2 224 912	(1 428 085)	2 224 912
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 430 789)	2 219 198	(1 430 789)	2 219 198
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	7 322 162	7 532 710	7 322 162	7 532 710

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	191 429	162 708
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	75 869 841	1 891 713
Achat de placements et de dérivés	(74 218 895)	(4 016 755)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	294	(359)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(503)	970
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(189)	124
Amortissement des produits d'intérêts	(25 743)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 816 234</b>	<b>(1 961 599)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(194 134)	(168 666)
Produit de l'émission de parts rachetables	588 717	2 860 809
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 026 804)	(633 388)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(1 632 221)</b>	<b>2 058 755</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	184 013	97 156
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	513 782	18 999
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>697 795</b>	<b>116 155</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	166 788	163 249
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	(11)
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.

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>COMPTES D'ÉPARGNE À INTÉRÊT ÉLEVÉ</b>				
602 225 888	Banque de Montréal, compte d'épargne à intérêt élevé	602 225 890	602 225 890	
262 408	Banque Canadienne Impériale de Commerce, compte d'épargne à intérêt élevé	262 408	262 408	
3 011 685 192	Banque Nationale du Canada, compte d'épargne à intérêt élevé	3 011 685 192	3 011 685 192	
1 865 787 306	Banque Scotia, compte d'épargne à intérêt élevé	1 865 787 306	1 865 787 306	
<b>Total comptes d'épargne à Intérêt élevé</b>		<b>5 479 960 796</b>	<b>5 479 960 796</b>	<b>74,8</b>
<b>PLACEMENT(S) À COURT TERME</b>				
234 000	Gouvernement du Canada, 2,37%, 2 juillet 2024	233 970	233 970	
632 900 000	Gouvernement du Canada, 3,596 %, 4 juillet 2024	632 651 240	632 651 240	
131 256 000	Gouvernement du Canada, 4,413 %, 18 juillet 2024	130 971 130	130 971 130	
364 050 000	Gouvernement du Canada, 4,499 %, 1er août 2024	362 617 960	362 617 960	
<b>Total des placement(s) à court terme</b>		<b>1 126 474 300</b>	<b>1 126 474 300</b>	<b>15,4</b>
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>6 606 435 096</b>	<b>6 606 435 096</b>	<b>90,2</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-	-	
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>6 606 435 096</b>	<b>6 606 435 096</b>	<b>90,2</b>
Autres actifs (passifs) nets			715 727 024	9,8
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>7 322 162 120</b>	<b>100,0</b>

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



# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

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

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

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

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	174 800 000	106 150 000
Parts rachetables émises	11 950 000	57 050 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(40 450 000)	(12 650 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	146 300 000	150 550 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,140

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

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

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

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

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Comptes d'épargne à intérêt élevé	83,7
Placement(s) à court terme	10,3
Autres actifs (passifs) nets	6,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

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

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	15,4
A	74,8
<b>Total</b>	<b>90,2</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	10,3
A	83,7
<b>Total</b>	<b>94,0</b>

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

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

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	1 126 474	-	-	-	1 126 474

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	906 204	-	-	-	906 204

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

# FNB d'épargne à intérêt élevé CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

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

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Placement(s) à court terme	-	1 126 474	-	1 126 474
<b>Total</b>	-	<b>1 126 474</b>	-	<b>1 126 474</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Placement(s) à court terme	-	906 204	-	906 204
<b>Total</b>	-	<b>906 204</b>	-	<b>906 204</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

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

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	202 546	239 786
Placements donnés en garantie	2 456	3 983
Trésorerie	989	3 972
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	719	196
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	186	674
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	1 707	2 211
Montant à recevoir pour la vente de placements	211	24
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	1 492	1 787
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	210 306	252 633
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	79	410
Swaps, options sur swaps et options	297	1 490
Frais de gestion à payer	91	123
Frais d'administration à payer	7	8
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	338	-
Montant à payer pour le rachat de parts	370	-
	1 182	2 031
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>209 124</b>	<b>250 602</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	198 480	236 473	9,24	9,34	21 467 688	25 321 688
Parts ordinaires couvertes en \$ US	10 644	14 129	8,90*	8,93*	874 500	1 194 500

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

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

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

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	4 172	6 140
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	(167)	(666)
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(10 958)	(9 929)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	10 226	11 624
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 273</b>	<b>7 169</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	17	9
Profit (perte) de change sur la trésorerie	163	(176)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	50	19
<b>Total des autres revenus</b>	<b>230</b>	<b>(148)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 503</b>	<b>7 021</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	734	1 064
Frais d'administration (note 5)	45	65
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	7
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	89	125
<b>Total des charges</b>	<b>869</b>	<b>1 262</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 634</b>	<b>5 759</b>

## États du résultat global (suite)

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	2 040	5 778	0,09	0,17	23 252 842	33 265 468
Parts ordinaires couvertes en \$ US	594	(19)	0,55	(0,01)	1 078 896	1 838 320

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

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

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

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	236 473	311 939	14 129	21 274	250 602	333 213
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 040	5 778	594	(19)	2 634	5 759
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(1 867)	(5 701)	(93)	(373)	(1 960)	(6 074)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(2 567)	(671)	(122)	-	(2 689)	(671)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(4 434)</b>	<b>(6 372)</b>	<b>(215)</b>	<b>(373)</b>	<b>(4 649)</b>	<b>(6 745)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	2 403	13 448	241	3 521	2 644	16 969
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(38 002)	(33 435)	(4 105)	(4 454)	(42 107)	(37 889)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(35 599)</b>	<b>(19 987)</b>	<b>(3 864)</b>	<b>(933)</b>	<b>(39 463)</b>	<b>(20 920)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(37 993)</b>	<b>(20 581)</b>	<b>(3 485)</b>	<b>(1 325)</b>	<b>(41 478)</b>	<b>(21 906)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>198 480</b>	<b>291 358</b>	<b>10 644</b>	<b>19 949</b>	<b>209 124</b>	<b>311 307</b>

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

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

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 634	5 759
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	10 958	9 929
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(10 226)	(11 624)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(329)	100
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	7
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	285 729	91 993
Achat de placements et de dérivés	(248 496)	(74 319)
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	505	(219)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	(523)	(1 512)
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	295	348
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(31)	(39)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	(2)	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	(9)
Amortissement des produits d'intérêts	(83)	51
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>40 431</b>	<b>20 463</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4 649)	(6 744)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 643	16 603
Montant versé au rachat de parts rachetables	(41 737)	(38 072)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(43 743)</b>	<b>(28 213)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	329	(100)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(3 312)	(7 750)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	3 972	8 057
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>989</b>	<b>207</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 384	6 538
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.



# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>CANADA</b>			
	960 000	407 International Inc., 3,67 %, 8 mars 2049	958 781	795 343	
	500 000	407 International Inc., 3,98 %, 11 septembre 2052	539 460	432 599	
	685 000	Aéroports de Montréal, 3,44 %, 26 avril 2051	685 000	547 692	
	1 000 000	Aéroports de Montréal, série N, 3,36 %, 24 avril 2047	1 000 000	802 363	
	780 000	Aéroports de Montréal, série R, 3,03 %, 21 avril 2050	780 000	579 388	
	225 000	AIMCo Realty Investors LP, 4,64 %, 15 février 2030	224 993	226 132	
USD	400 000	Air Canada, 3,88 %, 15 août 2026	519 817	522 366	
	210 000	Air Canada, 4,63 %, 15 août 2029	201 600	203 569	
	1	Alberta PowerLine LP, 4,07 %, 1er décembre 2053	1	1	
	445 000	Alectra Inc., 4,63 %, 13 juin 2034	445 000	444 943	
	855 000	Alimentation Couche-Tard Inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	845 988	853 903	
	445 000	Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	438 392	439 526	
	1 000 000	FPI Allied Properties, série C, 3,64 %, 21 avril 2025	1 000 000	982 755	
	410 000	AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	400 036	399 170	
	1 015 000	AltaGas Ltd., 2,48 %, 30 novembre 2030	1 015 000	877 004	
	845 000	AltaGas Ltd., convertibles, taux variable, 11 janvier 2082	845 000	745 491	
	745 000	AltaLink LP, 3,72 %, 3 décembre 2046	745 000	632 717	
	110 000	AltaLink LP, 4,74 %, 22 mai 2054	110 000	108 962	
	1 965 000	ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	1 965 000	1 888 907	
	830 000	ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	830 000	760 960	
	2 065 000	Banque de Montréal, 5,04 %, 29 mai 2028	2 091 102	2 099 197	
	1 590 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 septembre 2029	1 562 270	1 582 182	
	335 000	Banque de Montréal, taux variable, 17 juin 2030	323 764	325 684	
	115 000	Banque de Montréal, taux variable, 3 juillet 2034	115 000	114 655	
	495 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), taux variable, 3 juillet 2029	495 000	494 974	
	570 000	Banque de Nouvelle-Écosse (La), taux variable, 1er août 2034	568 928	567 750	
	1 345 000	BCI QuadReal Realty, 1,75 %, 24 juillet 2030	1 346 166	1 148 822	
	620 000	Bell Canada, 3,5 %, 30 septembre 2050	619 392	452 505	
	325 000	Bell Canada, 5,15 %, 24 août 2034	323 850	325 709	
USD	415 000	Bell Canada, série US-5, 2,15 %, 15 février 2032	453 164	456 049	
	290 000	BP Capital Markets PLC, 3,47 %, 15 mai 2025	284 151	286 608	
	1 455 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 2,86 %, 1er septembre 2032	1 455 000	1 236 818	
	420 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 5,32 %, 10 janvier 2054	420 015	413 072	
	270 000	Cameco Corp., 4,94 %, 24 mai 2031	269 968	271 732	
	1 130 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 4,25 %, 15 mars 2034	1 153 493	1 160 714	
	1 030 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, convertibles, taux variable, 28 octobre 2080	1 030 000	1 001 087	
	1 100 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 21 juillet 2030	1 105 592	1 065 963	
	115 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable, 28 juillet 2084	115 000	115 020	
	1 985 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 1er août 2047	1 991 959	1 629 075	
	1 325 000	Capital Power Corp., 3,15 %, 1er octobre 2032	1 325 000	1 131 695	
	95 000	Capital Power Corp., convertible, taux variable, 5 juin 2054	95 000	96 937	
	460 000	Capital Power Corp., taux variable, 9 septembre 2082	460 000	471 847	
	920 000	Cascades Inc./Cascades USA Inc., 5,13 %, 15 janvier 2025	916 320	917 982	
	1 115 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	1 115 000	1 075 861	
	1 580 000	Cenovus Energy Inc., 3,5 %, 7 février 2028	1 532 176	1 523 188	
	285 000	CGI Inc., 2,1 %, 18 septembre 2028	284 555	258 974	
	425 000	Propriétés de Choix FPI, 5,03 %, 28 février 2031	424 983	427 165	
	700 000	Propriétés de Choix FPI, 5,7 %, 28 février 2034	719 215	719 870	
	850 000	FPI Propriétés de Choix, série J, 3,55 %, 10 janvier 2025	841 186	842 934	
	2 465 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	2 465 000	2 457 320	
	415 000	CNH Capital Canada Ltd., 4,8 %, 25 mars 2027	414 485	415 948	

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>CANADA (suite)</b>			
	695 000	CNH Industrial Capital Canada Ltd., 1,5 %, 1er octobre 2024	677 500	688 719	
	425 000	Pipeline Coastal Gaslink LP, série B, 4,69 %, 30 septembre 2029	424 987	428 963	
	365 000	Cogeco Communications Inc., 2,99 %, 22 septembre 2031	365 000	318 475	
	335 000	Daimler Trucks Finance Canada Inc., 2,14 %, 13 décembre 2024	332 072	330 684	
	1 425 000	Dollarama Inc., 1,51 %, 20 septembre 2027	1 425 000	1 301 545	
	480 000	Dollarama Inc., 5,08 %, 27 octobre 2025	486 480	481 876	
	1 065 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	1 039 757	1 016 623	
	1 915 000	FPI industriel Dream, série C, 2,06 %, 17 juin 2027	1 915 000	1 764 931	
	990 000	Dream Summit Industrial LP, série C, 2,25 %, 12 janvier 2027	883 160	927 275	
	376 846	Autorité aéroportuaire régionale d'Edmonton, série D, 3,72 %, 20 mai 2051	376 846	313 541	
	1 705 000	L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, série 1, taux variable, 17 avril 2026	1 705 000	1 434 154	
	835 000	Enbridge Gas Inc., 3,65 %, 1er avril 2050	840 086	681 437	
	830 000	Enbridge Gas Inc., 5,67 %, 6 octobre 2053	936 821	924 336	
	220 000	Enbridge Gas Inc., 5,7 %, 6 octobre 2033	235 508	236 026	
	165 000	Enbridge Inc., convertibles, taux variable, 15 janvier 2084	173 264	184 614	
	520 000	Enbridge Inc., convertibles, taux variable, 27 septembre 2077	520 000	506 458	
	755 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 décembre 2027	726 330	742 518	
	1 360 000	FPI First Capital, série S, 4,32 %, 31 juillet 2025	1 365 508	1 347 279	
	280 000	First National Financial Corp., 6,26 %, 1er novembre 2027	279 975	284 061	
	630 000	First National Financial Corp., série 3, 2,96 %, 17 novembre 2025	630 000	608 387	
	1 738 389	First Nations ETF LP, série 1A, 4,14 %, 31 décembre 2041	1 738 389	1 585 122	
	165 000	Compagnie Crédit Ford du Canada, 5,58 %, 23 mai 2031	165 000	166 216	
	1 040 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,7 %, 9 juillet 2025	1 037 306	1 006 203	
	850 000	Gibson Energy Inc., 2,45 %, 14 juillet 2025	848 334	828 793	
	1 970 000	Gibson Energy Inc., 2,85 %, 14 juillet 2027	1 969 508	1 868 093	
	405 000	Gibson Energy Inc., série 20-A, convertibles, taux variable, 22 décembre 2080	405 000	372 983	
	1 260 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1er décembre 2030	1 038 089	1 047 155	
	6 305 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er juin 2031	5 472 223	5 540 977	
	825 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er décembre 2031	713 205	718 082	
	4 380 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1er décembre 2053	3 005 438	3 039 721	
	2 505 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1er juin 2028	2 355 978	2 368 515	
	3 135 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1er décembre 2032	2 914 390	2 907 446	
	1 355 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er septembre 2027	1 298 171	1 319 699	
	1 700 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er juin 2033	1 602 828	1 602 625	
	13 690 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1er juin 2034	12 912 700	13 119 789	
	2 050 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er septembre 2028	2 018 117	2 027 175	
	4 165 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er décembre 2033	4 072 310	4 080 750	
	235 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1er mars 2028	233 399	234 314	
	3 945 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1er mars 2034	3 912 059	3 950 523	
	265 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mai 2026	264 315	265 018	
	2 550 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mars 2029	2 598 468	2 602 935	
	1 125 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 19-2, 2,75 %, 17 octobre 2039	893 878	881 464	
	390 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 21-1, 3,15 %, 5 octobre 2051	389 321	297 742	
	1 005 000	Great-West Lifeco Inc., série 1, taux variable, 31 décembre 2081	1 005 000	839 992	
	220 000	Honda Canada Finance Inc., 4,9 %, 4 juin 2029	220 000	222 912	
	640 000	Hydro One Inc., 2,16 %, 28 février 2030	560 058	571 482	
	1 070 000	Hydro One Inc., 2,71 %, 28 février 2050	934 633	739 351	
	695 000	Hyundai Capital Canada Inc., série A, 2,01 %, 12 mai 2026	677 449	660 860	
	2 500 000	Société financière IGM Inc., 6 %, 10 décembre 2040	3 087 013	2 746 593	
	840 000	L'Ordre Indépendant des Forestiers, série 20-1, taux variable, 15 octobre 2035	840 000	720 708	
	830 000	Intact Corporation financière, convertibles, taux variable, 31 mars 2081	830 000	782 307	

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

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>CANADA (suite)</b>			
	425 000	Intact Corporation financière, taux variable, 16 mai 2034	425 000	427 846	
	770 000	Inter Pipeline Ltd., 3,17 %, 24 mars 2025	755 510	759 495	
	1 305 000	Inter Pipeline Ltd., 4,23 %, 1er juin 2027	1 305 000	1 276 462	
	1 295 000	Inter Pipeline Ltd., série 12, 3,98 %, 25 novembre 2031	1 295 000	1 170 045	
	110 000	John Deere Financial Inc., 4,63 %, 4 avril 2029	109 976	110 795	
	560 000	Keyera Corp., 3,96 %, 29 mai 2030	560 000	534 883	
	735 000	Keyera Corp., 5,02 %, 28 mars 2032	735 000	730 809	
	680 000	Les Compagnies Loblaw limitée, 2,28 %, 7 mai 2030	680 000	604 487	
	1 200 000	Loblaw Cos., Ltd., 5,12 %, 4 mars 2054	1 194 516	1 193 099	
	1 460 000	Société Financière Manuvie, série 1, taux variable, 19 juin 2081	1 460 000	1 221 777	
	1 290 000	Metro Inc., 4,27 %, 4 décembre 2047	1 288 697	1 137 055	
	1 520 000	Administration portuaire de Montréal, série A, 3,24 %, 22 mars 2051	1 520 000	1 169 662	
	215 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., 4,85 %, 1er juin 2034	214 852	214 935	
	1 578 293	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série C, 3,75 %, 31 mars 2033	1 578 293	1 472 438	
	1 308 107	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série D, 3,74 %, 31 décembre 2032	1 308 107	1 223 189	
	480 000	OMERS Realty Corp., série 11, 3,63 %, 5 juin 2030	487 113	456 823	
	855 000	Ontario Power Generation Inc., 3,32 %, 4 octobre 2027	814 345	827 443	
	115 000	Ontario Power Generation Inc., 4,83 %, 28 juin 2034	115 000	115 122	
	300 000	Corporation Parkland, 3,88 %, 16 juin 2026	299 925	289 813	
	1 060 000	Pembina Pipeline Corp., 4,54 %, 3 avril 2049	1 123 823	910 388	
	115 000	Pembina Pipeline Corp., 5,22 %, 28 juin 2033	114 951	115 059	
	240 000	Pembina Pipeline Corp., 5,67 %, 12 janvier 2054	239 827	242 168	
	965 000	Pembina Pipeline Corp., 5,72 %, 22 juin 2026	965 601	964 751	
	945 000	Pembina Pipeline Corp., série 15, 3,31 %, 1er février 2030	944 282	878 741	
	790 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 2,7 %, 30 septembre 2024	788 388	784 986	
	1 480 000	Power Corporation du Canada, 4,46 %, 27 juillet 2048	1 483 015	1 382 580	
	1 195 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	1 181 269	1 184 878	
	4 840 000	Province de l'Ontario, 4,15 %, 2 juin 2034	4 792 245	4 824 921	
	5 960 000	Province de l'Ontario, 4,15 %, 2 décembre 2054	5 804 914	5 788 273	
	805 000	Reliance LP, 2,68 %, 1er décembre 2027	804 855	751 111	
	360 000	FPI RioCan, série AB, 2,58 %, 12 février 2025	349 618	354 542	
	1 435 000	FPI RioCan, série AC, 2,36 %, 10 mars 2027	1 435 000	1 342 530	
	545 000	Rogers Communications Inc., 6,56 %, 22 mars 2041	674 321	602 699	
	310 000	Rogers Communications Inc., convertibles, taux variable, 17 décembre 2081	310 000	300 328	
	625 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 25 juillet 2029	625 000	624 069	
	430 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 30 juin 2030	415 324	417 775	
	1 585 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 1er février 2033	1 494 734	1 591 880	
	300 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 3 avril 2034	300 798	301 729	
	520 000	Banque Royale du Canada, taux variable, 24 novembre 2080	520 000	507 297	
	120 000	Métaux Russel Inc., 5,75 %, 27 octobre 2025	120 000	120 244	
	1 840 000	Saputo Inc., 1,42 %, 19 juin 2026	1 840 000	1 728 860	
	435 000	Saputo Inc., 3,6 %, 14 août 2025	421 954	428 515	
	835 000	Secure Energy Services Inc., 6,75 %, 22 mars 2029	837 350	844 916	
	1 195 000	Shaw Communications Inc., 3,3 %, 10 décembre 2029	1 189 348	1 112 102	
	750 000	Shaw Communications Inc., 4,25 %, 9 décembre 2049	746 093	620 817	
	1 375 000	Shaw Communications Inc., 6,75 %, 9 novembre 2039	1 666 066	1 541 331	
	815 000	SmartCentres REIT, série U, 3,53 %, 20 décembre 2029	815 000	748 456	
	850 000	SmartCentres REIT, série Y, 2,31 %, 18 décembre 2028	686 307	753 003	
	1 950 000	Groupe SNC-Lavalin Inc., série 6, 3,8 %, 19 août 2024	1 927 277	1 944 918	
	925 000	Groupe SNC-Lavalin Inc., série 8, 5,7 %, 26 mars 2029	926 613	936 825	
	760 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,15 %, 16 novembre 2048	758 807	595 247	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>CANADA (suite)</b>			
	135 000	Financière Sun Life Inc., taux variable, 15 mai 2036	135 000	136 280	
	290 000	Suncor Énergie Inc., 5,6 %, 17 novembre 2025	289 611	292 592	
	70 000	TELUS Corp., 4,8 %, 15 décembre 2028	69 927	70 425	
	415 000	TELUS Corp., 4,95 %, 18 février 2031	413 784	417 198	
	2 050 000	Teranet Holdings LP, série 1, 2,08 %, 11 juin 2025	2 050 000	2 016 978	
	1 775 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	1 775 000	1 733 947	
	135 000	TMX Group Ltd., 4,75 %, 26 mai 2026	135 000	135 479	
	665 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux variable, 25 juillet 2029	658 450	664 202	
	625 000	Banque Toronto-Dominion (La), taux variable, 22 avril 2030	625 000	614 724	
	575 000	Tourmaline Oil Corp., série 1, 2,08 %, 25 janvier 2028	575 000	529 429	
	200 000	Crédit Toyota Canada Inc., 4,42 %, 28 juin 2027	199 966	199 620	
	1 525 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,8 %, 5 avril 2027	1 522 575	1 497 147	
	280 000	Transcontinental Inc., 2,67 %, 3 février 2025	267 756	275 500	
	545 000	Vidéotron Ltée, 5,63 %, 15 juin 2025	547 126	546 688	
	540 000	Waste Connections Inc., 4,50 %, 14 juin 2029	539 638	539 454	
	490 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	488 971	470 203	
			177 958 593	171 290 558	81,9
		<b>É.-U.</b>			
	370 000	Air Lease Corp., 5,4 %, 1er juin 2028	376 882	376 449	
	1 010 000	Athene Global Funding, 2,1 %, 24 septembre 2025	1 008 758	975 682	
	290 000	Bank of America Corp., taux variable, 20 septembre 2025	290 000	288 866	
USD	410 000	Boeing Co. (The), 4,88 %, 1er mai 2025	548 720	555 045	
USD	430 000	Builders FirstSource Inc., 5 %, 1er mars 2030	554 977	557 280	
USD	620 000	Cox Communications Inc., 2,95 %, 1er octobre 2050	811 463	507 820	
USD	606 750	Delta Air Lines Inc./SkyMiles IP Ltd., 4,5 %, 20 octobre 2025	810 592	820 152	
USD	100 000	EQM Midstream Partners LP, 4 %, 1er août 2024	136 963	136 471	
USD	95 000	EQM Midstream Partners LP, 6 %, 1er juillet 2025	129 762	130 061	
USD	1 050 000	Ford Motor Credit Co., LLC, 3,66 %, 8 septembre 2024	1 379 761	1 429 741	
	2 750 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, 31 octobre 2025	2 750 000	2 733 024	
USD	425 000	Hess Midstream Operations LP, 5,63 %, 15 février 2026	575 462	577 429	
	510 000	McDonald's Corp., 4,86 %, 21 mai 2031	510 000	516 755	
USD	1 017 000	Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6,5 %, 20 juin 2027	1 391 147	1 394 958	
USD	190 000	Molina Healthcare Inc., 4,38 %, 15 juin 2028	240 990	244 886	
	825 000	Molson Coors International LP, 3,44 %, 15 juillet 2026	797 462	804 416	
	225 000	Mondelez International Inc., 4,63 %, 3 juillet 2031	223 594	224 468	
USD	135 000	Morgan Stanley, taux variable, 28 avril 2026	178 962	179 459	
USD	260 000	Paramount Global, 4 %, 15 janvier 2026	338 745	343 209	
USD	170 000	Paramount Global, 4,75 %, 15 mai 2025	226 914	229 036	
USD	80 000	T-Mobile USA Inc., 4,95 %, 15 mars 2028	107 760	108 797	
USD	755 000	Obligation du Trésor américain, 4,38 %, 15 mai 2034	1 036 532	1 035 541	
USD	1 335 000	Obligation du Trésor américain, 4,50 %, 31 mai 2029	1 840 430	1 840 187	
USD	140 000	Obligation du Trésor américain, 4,63 %, 31 mai 2031	195 473	194 879	
USD	775 000	Obligation du Trésor américain, 4,75 %, 15 novembre 2043	1 083 337	1 079 290	
USD	1 325 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 30 avril 2026	1 820 456	1 815 569	
USD	900 000	Obligation du Trésor américain, 4,88 %, 31 mai 2026	1 229 986	1 233 794	
	560 000	Verizon Communications Inc., 2,38 %, 22 mars 2028	492 615	518 516	
	510 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	446 255	454 114	
	1 035 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	853 843	787 479	
	250 000	Verizon Communications Inc., 4,05 %, 22 mars 2051	202 033	204 217	
USD	255 000	Viatis Inc., 1,65 %, 22 juin 2025	346 317	335 349	
USD	685 000	Viatis Inc., 2,7 %, 22 juin 2030	929 435	795 928	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U. (suite)</b>					
USD	1 010 000	Walgreens Boots Alliance Inc., 3,8 %, 18 novembre 2024	1 336 216	1 366 451	
USD	200 000	Western Midstream Operating LP, taux échelonné, 1er février 2025	263 437	269 089	
USD	640 000	Western Midstream Operating LP, taux échelonné, 1er février 2050	839 312	769 794	
			26 304 591	25 834 201	12,3
<b>R.-U.</b>					
USD	1 265 000	Aviva PLC, 4 %, 2 octobre 2030	1 263 760	1 184 954	
USD	260 000	BAE Systems PLC, 5,25 %, 26 mars 2031	349 873	355 195	
USD	635 000	Lloyds Banking Group PLC, 3,5 %, 3 février 2025	635 000	629 187	
USD	1 225 000	National Grid Electricity Transmission PLC, 2,3 %, 22 juin 2029	1 225 000	1 099 129	
			3 473 633	3 268 465	1,6
<b>JERSEY</b>					
USD	315 000	Heathrow Funding Ltd., 3,4 %, 8 mars 2030	314 575	300 931	
USD	1 280 000	Heathrow Funding Ltd., 3,78 %, 4 septembre 2032	1 280 000	1 203 906	
			1 594 575	1 504 837	0,7
<b>PAYS-BAS</b>					
USD	775 000	Viterra Finance BV, 3,2 %, 21 avril 2031	968 296	918 996	0,4
<b>AUSTRALIE</b>					
USD	575 000	Macquarie Group Ltd., taux variable, 21 août 2029	575 000	526 794	0,3
<b>SUISSE</b>					
USD	200 000	UBS Group AG, convertibles, taux variable, 19 février 2025	271 191	273 447	0,1
<b>FRANCE</b>					
USD	170 000	BNP Paribas SA, convertible, taux variable, 19 août 2025	229 422	232 571	0,1
<b>PLACEMENT(S) À COURT TERME</b>					
USD	1 155 000	Gouvernement du Canada, 3,516 %, 4 juillet 2024	1 151 893	1 151 893	0,6
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>212 527 194</b>	<b>205 001 762</b>	<b>98,0</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			-	-	-
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>212 527 194</b>	<b>205 001 762</b>	<b>98,0</b>
Contrat(s) de change à terme				106 805	0,1
Swap(s) sur défaillance				(296 637)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>212 527 194</b>	<b>204 811 930</b>	<b>98,0</b>
Autres actifs (passifs) nets				4 311 578	2,0
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>209 123 508</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	25 994 515	USD	18 873 600	1,38	181 810
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	985 952	USD	719 186	1,37	2 348
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	400 000	USD	291 796	1,37	921
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	CAD	245 220	USD	179 058	1,37	330
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	179 058	CAD	245 220	0,73	(330)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	145 699	CAD	200 000	0,73	(733)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	719 186	CAD	985 952	0,73	(2 348)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	15 juillet 2024	USD	8 723 726	CAD	12 006 302	0,73	(75 193)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>106 805</b>

## Swap(s) sur défaillance

Contrat(s)	Nombre de contrat(s)	Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date d'échéance	Montant nominal	Juste valeur (\$)
	1	CitiGroup Global Markets Inc.	A+	20 juin 2028	10 595 000	(296 637)
<b>Valeur totale du (des) latent(e)s sur le(s) swap(s) sur défaillance</b>						<b>(296 637)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	186	(79)	-	107
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>186</b>	<b>(79)</b>	<b>-</b>	<b>107</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(79)	79	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(297)	-	-	(297)
<b>Total</b>	<b>(376)</b>	<b>79</b>	<b>-</b>	<b>(297)</b>

au 31 décembre 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	674	(410)	-	264
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>674</b>	<b>(410)</b>	<b>-</b>	<b>264</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(410)	410	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	(1 490)	-	-	(1 490)
<b>Total</b>	<b>(1 900)</b>	<b>410</b>	<b>-</b>	<b>(1 490)</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	25 321 688	34 029 588	1 194 500	1 816 000
Parts rachetables émises	260 000	1 445 000	20 000	300 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(4 114 000)	(3 592 900)	(340 000)	(380 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>21 467 688</b>	<b>31 881 688</b>	<b>874 500</b>	<b>1 736 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650	0,04
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650	0,04

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	56 720	-
Garanties (hors trésorerie)	59 639	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	24	13
Charges	(7)	(4)
Revenu tiré des prêts de titres	17	9
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,0</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Canada	84,1
É.-U.	10,2
Autres actifs (passifs) nets	3,2
R.-U.	1,6
Jersey	0,6
Pays-Bas	0,6
Australie	0,2
Contrat(s) de change à terme	0,1
Swap(s) sur défaillance	(0,6)
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit ^*	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	26,1
AA/Aa/A+	11,1
A	9,5
BBB/Baa/B++	46,4
BB/Ba/B+	5,1
<b>Total</b>	<b>98,2</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit ^*	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	22,8
AA/Aa/A+	3,9
A	8,6
BBB/Baa/B++	58,0
BB/Ba/B+	4,3
<b>Total</b>	<b>97,6</b>

^Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

## Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	25 386	(14 378)	11 008	5,3
<b>Total</b>	<b>25 386</b>	<b>(14 378)</b>	<b>11 008</b>	<b>5,3</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	29 183	(13 895)	15 288	6,1
Euro	(4 644)	4 125	(519)	(0,2)
<b>Total</b>	<b>24 539</b>	<b>(9 770)</b>	<b>14 769</b>	<b>5,9</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 1 101 000 \$ (1 477 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	22 719	31 777	28 665	121 841	205 002

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	8 969	29 830	48 118	156 852	243 769

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 3 614 000 \$ (5 024 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	203 850	-	203 850
Placement(s) à court terme	-	1 152	-	1 152
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	107	-	107
Swap(s)	-	(297)	-	(297)
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>204 812</b>	<b>-</b>	<b>204 812</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'obligations de qualité supérieure CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	243 769	-	243 769
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	264	-	264
Swap(s)	-	(1 490)	-	(1 490)
<b>Total</b>	-	<b>242 543</b>	-	<b>242 543</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB marché monétaire CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	18 554	5 997
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	412	10
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	51	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	19 017	6 007
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	2	-
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	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>19 015</b>	<b>6 007</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB en \$ CA	19 015	6 007	50,03	50,05	380 000	120 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

États financiers (non audité)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	-
Intérêts aux fins des distributions	347
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	-
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>347</b>
Autres revenus	
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>347</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	9
Frais du comité d'examen indépendant	1
Taxe de vente harmonisée	1
<b>Total des charges</b>	<b>11</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>336</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :	Nombre moyen pondéré de parts :
	2024	2024	2024
Série FNB en \$ CA	336	1,21	276 923

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

États financiers (non audité)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Série FNB en \$ CA	Total du Fonds
	2024	2024
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	6 007	6 007
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	336	336
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(336)	(336)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(21)	(21)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(357)</b>	<b>(357)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	14 032	14 032
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 003)	(1 003)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>13 029</b>	<b>13 029</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>13 008</b>	<b>13 008</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	<b>19 015</b>	<b>19 015</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

États financiers (non audité)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	336
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	25 755
Achat de placements et de dérivés	(38 002)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(51)
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	(310)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(12 270)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(357)
Produit de l'émission de parts rachetables	14 032
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 003)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>12 672</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	402
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	10
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>412</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Dividendes payés*	-
Intérêts payés*	(15)
Impôts à recouvrer (payés)	-

\*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.  
Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>				
997 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	993 908	993 908	
850 000	Banque de Montréal, 2,28 %, 29 juillet 2024	848 233	848 233	
548 000	Banque de Montréal, 2,37 %, 17 janvier 2025	539 434	539 434	
195 000	bcIMC Realty Corp., 2,84 %, 3 juin 2025	191 655	191 655	
317 000	CARDS II Trust, série A, 2,43 %, 15 novembre 2024	313 992	313 992	
500 000	Fiducie cartes de crédit Eagle, série A, 2,22 %, 17 juillet 2024	499 343	499 343	
534 000	Banque HSBC Canada, 4,81 %, 16 décembre 2024	533 335	533 335	
444 000	Banque Manuvie du Canada, 2,38 %, 19 novembre 2024	439 517	439 517	
82 000	Metropolitan Life Global Funding I, 3,26 %, 1 <sup>er</sup> avril 2025	81 043	81 043	
192 000	OMERS Realty Corp., série 10, 3,33 %, 5 juin 2025	189 567	189 567	
391 000	Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 <sup>er</sup> mai 2025	381 550	381 550	
659 000	Banque Royale du Canada, 2,35 %, 2 juillet 2024	658 955	658 955	
383 000	Banque Toronto-Dominion (La), 1,94 %, 13 mars 2025	374 923	374 923	
155 000	Banque Toronto-Dominion (La), 2,5 %, 2 décembre 2024	153 363	153 363	
422 000	Banque Toronto-Dominion (La), 3,23 %, 24 juillet 2024	421 494	421 494	
502 000	Crédit Toyota Canada Inc., 2,31 %, 23 octobre 2024	498 012	498 012	
		<b>7 118 324</b>	<b>7 118 324</b>	<b>37,5</b>
<b>PLACEMENT(S) À COURT TERME</b>				
522 000	Gouvernement du Canada, 3,565 %, 4 juillet 2024	521 797	521 797	
400 000	Gouvernement du Canada, 4,375 %, 27 février 2025	388 429	388 429	
645 000	Gouvernement du Canada, 4,633 %, 5 décembre 2024	632 100	632 100	
560 000	Gouvernement du Canada, 4,633 %, 3 janvier 2025	546 743	546 743	
620 000	Gouvernement du Canada, 4,716 %, 7 novembre 2024	609 615	609 615	
420 000	Gouvernement du Canada, 4,721 %, 1 <sup>er</sup> août 2024	418 266	418 266	
770 000	Gouvernement du Canada, 4,73 %, 10 octobre 2024	759 850	759 850	
735 000	Gouvernement du Canada, 4,786 %, 12 septembre 2024	727 888	727 888	
500 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 4,80 %, 17 septembre 2024	494 820	494 820	
74 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 4,95 %, 23 juillet 2024	73 770	73 770	
272 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 5,035 %, 8 août 2024	270 541	270 541	
121 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 5,047 %, 27 août 2024	120 032	120 032	
207 000	Inter Pipeline Corridor Inc., 5,052 %, 22 août 2024	205 486	205 486	
300 000	Mercedes-Benz Finance Canada Inc., 4,632 %, 22 juillet 2024	299 165	299 165	
106 000	North West Redwater Partnership, 3,433 %, 3 juillet 2024	105 970	105 970	
500 000	Province de l'Alberta, 2,461 %, 2 juillet 2024	499 933	499 933	
560 000	Province de l'Alberta, 4,611 %, 1 <sup>er</sup> avril 2025	540 598	540 598	
450 000	Province de l'Alberta, 4,733 %, 27 août 2024	446 625	446 625	
180 000	Province de l'Ontario, 4,255 %, 21 mai 2025	173 198	173 198	
500 000	Province de l'Ontario, 4,539 %, 19 mars 2025	483 755	483 755	
260 000	Province de l'Ontario, 4,626 %, 5 mars 2025	251 850	251 850	
260 000	Province de l'Ontario, 4,637 %, 22 janvier 2025	253 214	253 214	
100 000	Province de l'Ontario, 4,771 %, 4 décembre 2024	97 953	97 953	
530 000	Province de l'Ontario, 4,806 %, 4 septembre 2024	525 407	525 407	
481 000	Province de l'Ontario, 4,876 %, 21 août 2024	477 668	477 668	
520 000	Province de Québec, 4,604 %, 21 février 2025	504 563	504 563	
270 000	Province de Québec, 4,811 %, 26 juillet 2024	269 077	269 077	
348 000	Province de Québec, 4,829 %, 23 août 2024	345 520	345 520	
400 000	Toyota Credit Canada Inc., 4,796 %, 4 décembre 2024	391 771	391 771	
	<b>Total des placement(s) à court terme</b>	<b>11 435 604</b>	<b>11 435 604</b>	<b>60,1</b>
	<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>18 553 928</b>	<b>18 553 928</b>	<b>97,6</b>
	Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-	
	<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>18 553 928</b>	<b>18 553 928</b>	<b>97,6</b>
	Autres actifs (passifs) nets		461 116	2,4
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>19 015 044</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.



# FNB marché monétaire CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Série FNB en \$ CA
	2024
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	120 000
Parts rachetables émises	280 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	(20 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	380 000

<sup>†</sup> Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Série FNB en \$ CA	0,140

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Placement(s) à court terme	99,8
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	40,4
AA/Aa/A+	33,4
A	17,7
BBB/Baa/B++	6,1
<b>Total</b>	<b>97,6</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	41,3
AA/Aa/A+	37,6
A	20,9
<b>Total</b>	<b>99,8</b>

\*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 an à 3 ans (en k\$)	3 à 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	18 554	-	-	-	18 554

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 an à 3 ans (en k\$)	3 à 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
<b>Exposition aux taux d'intérêt</b>	5 997	-	-	-	5 997

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	7 118	-	7 118
Placement(s) à court terme	-	11 436	-	11 436
<b>Total</b>	-	18 554	-	18 554

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Placement(s) à court terme	-	5 997	-	5 997
<b>Total</b>	-	5 997	-	5 997

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des périodes closes les 30 juin 2024 et 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	545 669	524 619
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	927	1 004
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	1 372	1 270
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	147	150
	548 115	527 043
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	269	271
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	165	171
	434	442
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>547 681</b>	<b>526 601</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	547 681	526 601	26,94	24,46	20 329 315	21 529 315

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	6 132	6 017
Intérêts aux fins des distributions	25	32
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	39 196	13 983
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	13 256	8 595
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>58 609</b>	<b>28 627</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	10	12
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(1)	(2)
Rabais sur frais	881	950
Autres revenus	-	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>890</b>	<b>961</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>59 499</b>	<b>29 588</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	1 644	1 813
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	298	233
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	61	82
<b>Total des charges</b>	<b>2 004</b>	<b>2 129</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>57 495</b>	<b>27 459</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	57 495	27 459	2,72	1,11	21 155 689	24 688 818

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	526 601	643 037	526 601	643 037
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	57 495	27 459	57 495	27 459
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(4 234)	(1 783)	(4 234)	(1 783)
Profits nets réalisés	-	(3 704)	-	(3 704)
Remboursement de capital	(410)	-	(410)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(4 644)	(5 487)	(4 644)	(5 487)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	16 936	32 386	16 936	32 386
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(48 707)	(121 401)	(48 707)	(121 401)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(31 771)	(89 015)	(31 771)	(89 015)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	21 080	(67 043)	21 080	(67 043)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	547 681	575 994	547 681	575 994

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	57 495	27 459
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(39 196)	(13 983)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(13 256)	(8 595)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	298	233
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	491 648	253 370
Achat de placements et de dérivés	(492 259)	(253 427)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(102)	503
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(63)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(4)	(7)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>4 623</b>	<b>5 490</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4 644)	(5 487)
Produit de l'émission de parts rachetables	221	152
Montant versé au rachat de parts rachetables	(277)	(720)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(4 700)</b>	<b>(6 055)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(77)	(565)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 004	946
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>927</b>	<b>381</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	25	32
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	6 029	6 520
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.



# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ÉNERGIE</b>				
737 141	ARC Resources Ltd.	15 895 884	17 993 612	
685 878	Cenovus Energy Inc.	17 551 618	18 443 259	
200 292	Imperial Oil Ltd.	18 138 444	18 683 238	
353 109	Pembina Pipeline Corp.	16 737 476	17 923 813	
1 522 022	Secure Energy Services Inc.	17 602 516	18 431 686	
346 417	Suncor Énergie Inc.	17 405 293	18 065 647	
		103 331 231	109 541 255	20,0
<b>MATÉRIAUX</b>				
200 874	Mines Agnico Eagle Limitée	17 934 233	17 974 206	
826 717	Alamos Gold Inc., catégorie A	17 823 774	17 741 347	
249 784	CCL Industries Inc., catégorie B	17 819 822	17 969 461	
877 635	Eldorado Gold Corp.	18 048 619	17 737 003	
1 758 681	Kinross Gold Corp.	18 360 716	20 031 376	
246 316	Wheaton Precious Metals Corp.	17 880 230	17 668 247	
		107 867 394	109 121 640	19,9
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
1 121 936	Galaxy Digital Holdings Ltd.	17 249 086	17 928 537	
510 777	Société Financière Manuvie	13 521 610	18 607 606	
165 283	Banque Nationale du Canada	18 232 201	17 934 859	
462 361	Power Corporation du Canada	17 697 032	17 578 965	
489 236	Groupe TMX Limitée	16 500 205	18 630 107	
		83 200 134	90 680 074	16,6
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
330 294	AtkinsRealis Group Inc.	14 674 457	19 560 011	
203 519	Bombardier Inc., catégorie B	18 228 190	17 854 722	
107 031	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	18 591 729	17 302 631	
77 389	Thomson Reuters Corp.	13 699 030	17 846 677	
		65 193 406	72 564 041	13,2
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
240 234	Celestica Inc.	9 602 733	18 819 931	
4 692	Constellation Software Inc.	8 611 577	18 495 301	
7 132	Constellation Software Inc., bons de souscription, 31 mars 2040	-	1	
		18 214 310	37 315 233	6,8
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
150 131	Dollarama Inc.	9 321 958	18 752 863	
346 019	Gildan Activewear Inc.	16 009 754	17 954 926	
		25 331 712	36 707 789	6,7
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
93 820	George Weston Limitée	16 919 169	18 462 838	
113 917	Les Compagnies Loblaw limitée	17 170 364	18 078 628	
		34 089 533	36 541 466	6,7
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
440 731	Capital Power Corp.	17 787 022	17 184 102	
1 840 980	TransAlta Corp.	17 794 659	17 857 506	
		35 581 681	35 041 608	6,4
<b>IMMOBILIER</b>				
257 606	Boardwalk REIT	19 672 098	18 156 071	3,3
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>492 481 499</b>	<b>545 669 177</b>	<b>99,6</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(155 586)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>492 325 913</b>	<b>545 669 177</b>	<b>99,6</b>
Autres actifs (passifs) nets		2 011 821		0,4
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>547 680 998</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	294	228
Paievements indirects†	110	81

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	21 529 315	26 799 315
Parts rachetables émises	650 000	1 300 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 850 000)	(4 900 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>20 329 315</b>	<b>23 199 315</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	35 461	-
Garanties (hors trésorerie)	37 310	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	15	19
Charges	(5)	(7)
Revenu tiré des prêts de titres	10	12
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>35,7</b>	<b>35,9</b>

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Services financiers	20,2
Actions - Énergie	16,4
Actions - Technologies de l'information	13,8
Actions - Produits industriels	13,5
Actions - Matériaux	9,5
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	9,5
Actions - Services publics	6,7
Actions - Biens de consommation de base	3,4
Actions - Services de communication	3,4
Actions - Immobilier	3,2
Autres actifs (passifs) nets	0,4
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Canada Target Momentum Total Return Index™	54 344 598

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Canada Target Momentum Total Return Index™	52 380 161

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

# FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	545 669	-	-	545 669
Total	545 669	-	-	545 669

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	524 619	-	-	524 619
Total	524 619	-	-	524 619

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	294 599	310 594
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	316	1 024
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	741	656
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	108	124
	295 764	312 398
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	147	162
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	117	138
	264	300
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>295 500</b>	<b>312 098</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	295 500	312 098	21,99	20,55	13 438 640	15 188 640

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 938	6 676
Intérêts aux fins des distributions	21	19
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	12 451	1 855
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	8 512	8 636
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>25 922</b>	<b>17 186</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	13	34
Profit (perte) de change sur la trésorerie	1	(1)
Rabais sur frais	674	887
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>688</b>	<b>920</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>26 610</b>	<b>18 106</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	921	1 149
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	208	320
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	16	24
<b>Total des charges</b>	<b>1 146</b>	<b>1 494</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>25 464</b>	<b>16 612</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	25 464	16 612	1,76	0,89	14 493 860	18 712 673

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	312 098	408 664	312 098	408 664
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	25 464	16 612	25 464	16 612
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(2 891)	(3 126)	(2 891)	(3 126)
Profits nets réalisés	(1 379)	(2 292)	(1 379)	(2 292)
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(4 270)	(5 418)	(4 270)	(5 418)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	3 187	11 462	3 187	11 462
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(40 979)	(111 923)	(40 979)	(111 923)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(37 792)	(100 461)	(37 792)	(100 461)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(16 598)	(89 267)	(16 598)	(89 267)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	295 500	319 397	295 500	319 397

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	25 464	16 612
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(12 451)	(1 855)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(8 512)	(8 636)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	208	320
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	215 277	156 052
Achat de placements et de dérivés	(216 137)	(134 007)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(85)	37
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(15)	(45)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(5)	(5)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>3 744</b>	<b>28 473</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4 270)	(5 419)
Produit de l'émission de parts rachetables	15	40
Montant versé au rachat de parts rachetables	(197)	(23 026)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(4 452)</b>	<b>(28 405)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(708)	68
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 024	992
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>316</b>	<b>1 060</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	21	19
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 853	6 713
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.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
316 766	AltaGas Ltd.	9 288 087	9 791 237	
247 769	ATCO Ltd., catégorie I	9 534 257	9 655 558	
318 410	Canadian Utilities Ltd., catégorie A	9 755 643	9 409 016	
239 663	Capital Power Corp.	9 561 169	9 344 460	
181 486	Fortis Inc.	10 176 142	9 649 611	
998 630	TransAlta Corp.	9 652 884	9 686 711	
		57 968 182	57 536 593	19,5
<b>ÉNERGIE</b>				
345 289	MEG Energy Corp.	10 374 857	10 106 609	
250 488	Corporation Parkland	8 922 916	9 606 215	
104 768	Precision Drilling Corp.	9 554 636	10 078 682	
825 614	Secure Energy Services Inc.	9 541 263	9 998 186	
979 693	Whitecap Resources Inc.	9 660 320	9 806 727	
		48 053 992	49 596 419	16,8
<b>MATÉRIAUX</b>				
2 742 044	B2Gold Corp.	9 981 346	10 063 301	
476 069	Eldorado Gold Corp.	9 789 778	9 621 354	
953 987	Kinross Gold Corp.	6 835 735	10 865 913	
136 399	Nutrien Ltd.	9 637 441	9 500 190	
90 392	West Fraser Timber Co., Ltd.	9 675 798	9 497 487	
		45 920 098	49 548 245	16,8
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
151 094	Banque de Nouvelle-Écosse (La)	9 372 951	9 455 463	
6 346	Fairfax Financial Holdings Ltd.	7 330 162	9 876 470	
608 589	Galaxy Digital Holdings Ltd.	9 359 396	9 725 252	
277 071	Société Financière Manuvie	6 693 959	10 093 697	
250 806	Power Corporation du Canada	8 733 506	9 535 644	
		41 489 974	48 686 526	16,5
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
299 927	Empire Co., Ltd., catégorie A	11 094 545	10 488 448	
50 893	George Weston Limitée	7 071 337	10 015 233	
131 909	Metro inc.	9 750 605	9 997 383	
		27 916 487	30 501 064	10,3
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
69 904	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	9 524 984	9 488 769	
165 039	Magna International Inc.	11 957 608	9 463 336	
		21 482 592	18 952 105	6,4
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
130 316	Celestica Inc.	5 181 398	10 208 955	6,4
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
555 550	Air Canada	10 924 813	9 944 345	6,4
<b>IMMOBILIER</b>				
139 740	Boardwalk REIT	10 643 482	9 848 875	6,4
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
338 620	Québecor Inc., catégorie B	10 339 293	9 775 959	6,4
	<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>279 920 311</b>	<b>294 599 086</b>	<b>99,7</b>
	Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(5 478)		
	<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>279 914 833</b>	<b>294 599 086</b>	<b>99,7</b>
	Autres actifs (passifs) nets		901 269	0,3
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>295 500 355</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	206	318
Paiements indirects†	77	112

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	15 188 640	20 488 640
Parts rachetables émises	150 000	550 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 900 000)	(5 450 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	13 438 640	15 588 640

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	15 308	-
Garanties (hors trésorerie)	16 135	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	20	63
Charges	(7)	(29)
Revenu tiré des prêts de titres	13	34
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>32,7</b>	<b>46,1</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur Cl

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Services financiers	16,6
Actions - Énergie	16,3
Actions - Services publics	16,3
Actions - Matériaux	13,5
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	10,2
Actions - Produits industriels	10,2
Actions - Biens de consommation de base	9,6
Actions - Technologies de l'information	3,5
Actions - Services de communication	3,3
Autres actifs (passifs) nets	0,5
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Canada Target Value Total Return IndexTM	29 253 510

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Canada Target Value Total Return IndexTM	30 873 313

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	294 599	-	-	294 599
<b>Total</b>	<b>294 599</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>294 599</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	310 594	-	-	310 594
<b>Total</b>	<b>310 594</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>310 594</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	51 458	50 486
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	97	153
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	263	377
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	32	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	77	38
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	7	7
	51 934	51 061
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	31	49
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	27	25
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	32	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	16	174
	106	248
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>51 828</b>	<b>50 813</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	32 276	30 112	41,98	36,33	768 902	828 902
Parts ordinaires non couvertes	19 552	20 701	37,39	33,77	522 975	612 975

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 324	1 745
Intérêts aux fins des distributions	4	1
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	4 341	1 447
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 727	1 981
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>8 396</b>	<b>5 174</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	14	15
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(18)
Rabais sur frais	43	48
Autres revenus	161	13
<b>Total des autres revenus</b>	<b>218</b>	<b>58</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>8 614</b>	<b>5 232</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	163	165
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	51	111
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	206	194
Taxe de vente harmonisée	13	18
<b>Total des charges</b>	<b>434</b>	<b>489</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>8 180</b>	<b>4 743</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	5 378	3 096	6,58	3,64	817 473	851 278
Parts ordinaires non couvertes	2 802	1 647	4,81	2,06	582 535	799 992

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds
	2024	2023	2024	2023	
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	30 112	28 706	20 701	27 325	50 813
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 378	3 096	2 802	1 647	8 180
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>					
Revenu net de placement	(633)	(700)	(476)	(663)	(1 109)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	(3)	-	(3)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(633)	(700)	(479)	(663)	(1 112)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Produit de l'émission de parts rachetables	-	3 398	-	-	3 398
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 581)	(3 343)	(3 472)	(3 385)	(6 053)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(2 581)	55	(3 472)	(3 385)	(6 053)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 164	2 451	(1 149)	(2 401)	1 015
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	32 276	31 157	19 552	24 924	51 828

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 180	4 743
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4 341)	(1 447)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 727)	(1 981)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	1	2
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	51	111
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	33 252	45 647
Achat de placements et de dérivés	(27 109)	(42 267)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(39)	4
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(158)	35
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>7 110</b>	<b>4 846</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 112)	(1 364)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	3 398
Montant versé au rachat de parts rachetables	(6 053)	(6 728)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(7 165)</b>	<b>(4 694)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	(2)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(55)	152
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	153	(16)
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>97</b>	<b>134</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	1
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 079	1 556
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.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>JAPON</b>					
JPY	8 472	Adastria Co., Ltd.	292 356	261 963	
JPY	6 248	ASAHI YUKIZAI Corp.	250 646	278 498	
JPY	13 032	Asics Corp.	162 197	272 817	
JPY	14 873	Chubu Electric Power Co., Inc.	282 266	240 508	
JPY	29 404	Citizen Watch Co., Ltd.	237 250	268 883	
JPY	19 469	Daicel Corp.	240 068	255 457	
JPY	4 073	Dexerials Corp.	160 320	258 223	
JPY	484	Disco Corp.	70 516	251 310	
JPY	737	Fast Retailing Co., Ltd.	200 520	254 281	
JPY	20 628	Hokkaido Electric Power Co., Inc.	227 203	209 513	
JPY	28 188	Hokuriku Electric Power Co.	247 868	244 216	
JPY	2 476	Horiba Ltd.	206 550	273 385	
JPY	27 466	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	255 466	243 335	
JPY	8 956	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	224 450	230 075	
JPY	4 033	ITOCHU Corp.	177 398	269 444	
JPY	11 580	Japan Elevator Service Holding Co., Ltd.	229 757	254 635	
JPY	8 086	Japan Exchange Group Inc.	202 216	258 075	
JPY	6 611	Japan Tobacco Inc.	186 718	244 515	
JPY	32 671	JVCKENWOOD Corp.	162 745	259 017	
JPY	15 049	Kobe Steel Ltd.	275 031	255 580	
JPY	6 586	Komatsu Ltd.	260 649	261 686	
JPY	10 115	KROSAKI HARIMA Corp.	252 169	240 232	
JPY	16 864	Kyushu Electric Power Co., Inc.	201 330	237 702	
JPY	10 019	Marubeni Corp.	143 296	253 591	
JPY	7 306	Meidensha Corp.	236 327	226 841	
JPY	9 314	Mitsubishi Corp.	204 094	249 414	
JPY	7 936	Mitsui & Co., Ltd.	142 002	246 469	
JPY	6 171	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	155 454	252 913	
JPY	3 467	Mizuno Corp.	240 974	233 576	
JPY	6 140	NGK Spark Plug Co., Ltd.	199 437	243 913	
JPY	6 358	Nippon Sanso Holdings Corp.	212 451	257 386	
JPY	34 645	Nippon Suisan Kaisha Ltd.	243 387	254 273	
JPY	3 558	Organo Corp.	180 468	249 997	
JPY	3 890	Recruit Holdings Co., Ltd.	185 780	284 807	
JPY	940	RORZE CORP.	127 242	253 875	
JPY	11 051	Ryohin Keikaku Co., Ltd.	244 778	251 369	
JPY	11 139	Sanrio Co., Ltd.	239 265	280 281	
JPY	10 448	Sanwa Shutter Corp.	159 279	261 427	
JPY	10 458	SBI Sumishin Net Bank Ltd.	266 045	271 775	
JPY	1 969	SCREEN Holdings Co., Ltd.	177 801	242 864	
JPY	20 473	Shikoku Electric Power Co., Inc.	243 700	240 331	
JPY	8 868	Sompo Holdings Inc.	242 945	259 120	
JPY	7 415	Strike Co., Ltd.	310 809	290 777	
JPY	8 826	Subaru Corp.	254 012	256 016	
JPY	7 428	Sumitomo Corp.	173 532	253 818	
JPY	4 708	Takasago Thermal Engineering Co., Ltd.	191 498	229 077	
JPY	5 162	Takeuchi Mfg. Co., Ltd.	208 486	247 215	
JPY	13 966	Tamron Co., Ltd.	511 753	494 806	
JPY	15 711	Tocalo Co., Ltd.	269 422	275 042	
JPY	19 719	Tohoku Electric Power Co., Inc.	237 521	243 473	
JPY	5 360	Tokio Marine Holdings Inc.	254 060	273 796	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>JAPON (suite)</b>					
JPY	845	Tokyo Electron Ltd.	269 040	250 860	
JPY	11 043	Toyo Tire & Rubber Co., Ltd.	242 309	241 277	
JPY	9 759	Toyota Tsusho Corp.	266 524	260 002	
JPY	3 791	Yamato Kogyo Co., Ltd.	179 423	252 373	
JPY	7 696	Yokogawa Electric Corp.	231 529	254 662	
			12 450 332	14 460 766	27,9
<b>R.-U.</b>					
GBP	4 865	3i Group PLC	116 078	258 008	
GBP	2 524	4imprint Group PLC	153 997	255 838	
GBP	39 404	AJ Bell PLC	267 051	258 661	
GBP	6 170	Alpha Group International PLC	266 246	241 197	
GBP	10 798	BAE Systems PLC	138 685	246 545	
GBP	42 401	Balfour Beatty PLC	230 129	267 846	
GBP	4 025	Bank of Georgia Group PLC	203 690	280 923	
GBP	3 626	Clarkson PLC	261 832	259 661	
GBP	25 656	Darktrace PLC	257 669	255 883	
GBP	164 015	Evrax PLC	1 464 762	-	
GBP	9 341	GSK PLC	265 741	247 128	
GBP	120 912	Helios Towers PLC	247 834	243 445	
GBP	44 097	IntegraFin Holdings PLC	272 001	264 678	
GBP	6 375	Intermediate Capital Group PLC	181 414	240 610	
GBP	49 597	Marks & Spencer Group PLC	170 907	245 787	
GBP	1 634	Next PLC	203 000	255 392	
GBP	31 941	Rolls-Royce Holdings PLC	80 301	252 379	
GBP	105 289	Shaftesbury Capital PLC	253 185	253 513	
GBP	8 504	Softcat PLC	209 355	267 274	
NOK	4 234	Stolt-Neilsen Ltd.	212 064	274 784	
GBP	17 775	PLC Wise, catégorie A	242 731	209 534	
			5 698 672	5 079 086	9,8
<b>SUÈDE</b>					
SEK	6 456	AAK AB	258 493	259 094	
SEK	7 236	AB Volvo, actions B	246 732	253 467	
SEK	9 638	Atlas Copco AB, actions A	188 666	248 067	
SEK	7 186	Avanza Bank Holding AB	252 110	239 088	
SEK	7 582	BoneSupport Holding AB	182 310	257 651	
SEK	10 652	H & M Hennes et Mauritz AB, actions B	271 205	230 743	
SEK	6 775	Investor AB, catégorie B	255 766	254 039	
SEK	13 205	Inwido AB	232 134	246 547	
SEK	10 472	Lagercrantz Group AB, catégorie B	209 410	233 000	
SEK	8 313	Groupe Munters AB	130 021	214 608	
SEK	4 485	Mycronic AB	204 816	236 785	
SEK	8 894	Nordnet AB	261 660	254 430	
SEK	28 054	Peab AB, catégorie B	251 943	241 595	
SEK	7 796	Saab AB, catégorie B	245 403	256 865	
SEK	12 529	SkiStar AB	245 694	240 239	
SEK	13 126	SWECO AB, actions B	258 303	246 598	
SEK	9 036	Swedbank AB, série A	209 830	254 639	
SEK	4 141	Groupe VBG AB, catégorie B	252 993	259 233	
			4 157 489	4 426 688	8,5

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ITALIE</b>					
EUR	7 417	Azimut Holding SpA	267 153	239 517	
EUR	4 612	Banca Generali SPA	254 363	253 366	
EUR	16 388	Banca Mediolanum SPA	188 398	247 785	
EUR	38 004	Banca Monte dei Paschi di Siena SPA	167 584	244 393	
EUR	38 028	BPER Banca SPA	132 198	263 286	
EUR	4 555	Buzzi SPA	168 764	251 036	
EUR	19 166	Credito Emiliano S.p.A.	191 037	261 400	
EUR	5 447	De'Longhi SPA	237 331	233 255	
EUR	450	Ferrari NV	163 288	251 238	
EUR	50 270	Intesa Sanpaolo SPA	165 801	255 891	
EUR	24 564	Maire Tecnimont SPA	132 543	278 825	
EUR	3 061	Prysmian SPA	174 511	259 557	
EUR	4 104	Sanlorenzo SPA	213 869	232 319	
EUR	108 882	Saras Raffinerie	257 176	258 520	
EUR	4 973	UniCredit SPA	121 735	252 376	
EUR	19 407	Unipol Gruppo SPA	263 746	264 117	
			3 099 497	4 046 881	7,8
<b>POLOGNE</b>					
PLN	8 133	Alior Bank SA	207 630	283 338	
PLN	4 820	Bank Polska Kasa Opieki SA	181 178	275 627	
PLN	268	Benefit Systems SA	189 151	264 544	
PLN	1 114	Budimex SA	140 575	264 292	
PLN	879	Grupa Kety SA	183 667	267 780	
EUR	10 361	InPost SA	216 025	250 105	
PLN	1 684	Kruk SA	269 155	265 163	
PLN	43	LPP SA	200 620	250 136	
PLN	13 403	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	223 485	287 050	
PLN	16 004	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	259 035	280 762	
PLN	1 552	Santander Bank Polska SA	206 587	285 901	
PLN	11 206	X-Trade Brokers Dom Maklerski SA	212 064	273 257	
			2 489 172	3 247 955	6,3
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	19 716	Brambles Ltd.	219 971	261 795	
AUD	8 044	carsales.com Ltd.	208 003	259 124	
AUD	886	Cochlear Ltd.	262 164	268 933	
AUD	34 826	Data#3 Ltd.	207 332	266 382	
AUD	78 597	Emerald Resources NL	201 883	253 546	
AUD	8 285	Goodman Group	227 532	263 102	
AUD	4 727	JB Hi-Fi Ltd.	255 221	264 414	
AUD	2 211	Pro Medicus Ltd.	141 056	289 460	
AUD	16 008	Technology One Ltd.	207 440	272 099	
AUD	77 958	Ventia Services Group PTY Ltd.	266 779	272 857	
			2 197 381	2 671 712	5,2
<b>SUISSE</b>					
CHF	3 329	ABB Ltd., actions nominatives	175 627	253 057	
CHF	4 845	Accelleron Industries AG	231 018	259 697	
CHF	1 872	Burkhalter Holding AG	258 034	262 541	
CHF	39	Givaudan SA, actions nominatives	258 158	252 991	
CHF	2 095	Holcim Ltd.	177 886	254 002	
CHF	116	Inficon Holding AG, actions nominatives	188 597	241 290	
CHF	1 886	Logitech International SA, actions nominatives	239 534	249 627	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SUISSE (suite)</b>					
CHF	1 394	Sulzer AG, actions nominatives	192 040	263 643	
CHF	6 147	UBS Group AG, enregistrées	254 947	247 582	
CHF	1 486	VZ Holding AG	214 826	260 677	
			2 190 667	2 545 107	4,9
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	11 935	Avance Gas Holding Ltd.	249 385	261 668	
NOK	18 149	Hoegh Autoliners ASA	166 179	293 416	
NOK	2 198	Kongsberg Gruppen ASA	126 384	245 752	
NOK	92 914	MPC Container Ships AS	245 092	268 786	
NOK	143 748	Norwegian Air Shuttle ASA	295 724	232 398	
NOK	35 040	Odfjell Drilling Ltd.	213 049	261 631	
NOK	8 103	Protector Forsikring ASA	147 317	267 105	
NOK	17 735	Veidekke ASA	263 451	260 739	
NOK	20 694	Wilh. Wilhelmsen ASA	238 442	289 616	
			1 945 023	2 381 111	4,6
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	4 415	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	257 100	260 802	
EUR	957	Aena SME SA	263 607	263 853	
EUR	33 935	Atresmedia Corporacion de Medios de Comunicacion SA	225 889	220 218	
EUR	18 994	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	176 044	260 502	
EUR	97 248	Banco de Sabadell SA	252 172	256 782	
EUR	6 642	Compania de Distribucion Integral Logista Holdings SA	230 858	257 349	
EUR	3 819	Industria de Diseño Textil SA	168 299	259 647	
EUR	2 013	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	161 891	258 458	
EUR	22 637	Melia Hotels International SA	249 980	254 461	
			1 985 840	2 292 072	4,4
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	1 510	Logiciel Atoss AG	234 958	248 019	
EUR	52 633	CECONOMY AG	243 898	229 248	
EUR	1 790	Hochtief AG	219 747	278 785	
EUR	379	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, actions nominatives	256 944	259 565	
EUR	1 890	Nemetschek SE	218 952	254 584	
EUR	346	Rheinmetall AG	233 604	241 379	
EUR	2 384	Talanx AG	233 738	260 643	
			1 641 841	1 772 223	3,4
<b>DANEMARK</b>					
SEK	7 658	INVISIO AB	250 497	230 550	
DKK	1 338	Novo Nordisk AS, catégorie B	169 212	264 595	
DKK	457	Rockwool International AS, catégorie B	247 484	253 974	
DKK	10 456	Spar Nord Bank AS	221 726	275 531	
DKK	3 677	Sydbank AS	204 622	266 821	
			1 093 541	1 291 471	2,5
<b>FRANCE</b>					
EUR	1 188	Airbus SE	203 199	223 459	
EUR	1 373	Gaztransport & Technigaz SA	236 790	245 451	
EUR	82	Hermes International	166 353	257 347	
EUR	1 788	Legrand SA	238 712	242 916	
EUR	852	Safran SA	189 833	246 648	
			1 034 887	1 215 821	2,3

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SINGAPOUR</b>					
NOK	10 379	BW LPG Ltd.	253 870	264 501	
SGD	7 200	DBS Group Holdings Ltd.	258 352	260 179	
NOK	24 286	Hafnia Ltd.	152 979	279 961	
SGD	52 252	SembCorp Industries Ltd.	188 952	253 762	
			854 153	1 058 403	2,0
<b>PORTUGAL</b>					
EUR	507 950	Banco Comercial Portugues SA	252 788	250 741	
EUR	9 373	Galp Energia SGPS SA	191 212	271 068	
EUR	49 217	Mota - Engil SGPS SA	292 051	248 437	
EUR	47 556	Navigator Co., SA (Le)	252 803	271 018	
			988 854	1 041 264	2,0
<b>ISRAËL</b>					
ILS	1 702	Camtek Ltd.	133 845	289 324	
ILS	854	Nova Measuring Instruments Ltd.	128 255	274 213	
GBP	6 903	Plus500 Ltd.	207 972	270 568	
			470 072	834 105	1,6
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	2 985	BAWAG Group AG	257 060	258 716	
EUR	3 954	Erste Group Bank AG	251 385	256 533	
EUR	19 786	Telekom Austria AG	220 321	270 435	
			728 766	785 684	1,5
<b>HONG KONG</b>					
HKD	74 062	SITC International Holdings Co., Ltd.	283 908	275 183	
HKD	106 176	Stella International Holdings Ltd.	263 251	294 763	
			547 159	569 946	1,1
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	11 247	ABN AMRO Bank NV	232 287	253 184	
EUR	180	ASML Holding NV	170 736	254 525	
			403 023	507 709	1,0
<b>FINLANDE</b>					
EUR	2 218	Cargotec OYJ	255 771	243 794	
EUR	17 214	Puuhilo OYJ	215 789	254 468	
			471 560	498 262	1,0
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	3 944	Colruyt Group	250 958	257 850	0,5
<b>MACAO</b>					
HKD	111 367	MGM China Holdings Ltd.	183 642	237 345	0,5
<b>IRLANDE</b>					
EUR	2 026	Kingspan Group PLC	215 124	236 209	0,5
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>45 097 653</b>	<b>51 457 670</b>	<b>99,3</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(51 364)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>45 046 289</b>	<b>51 457 670</b>	<b>99,3</b>
Contrat(s) de change à terme				231 561	0,4
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>45 046 289</b>	<b>51 689 231</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				138 893	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>51 828 124</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	AUD	1 021 232	CAD	929 544	1,10	3 785
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	2 583 200	AUD	2 831 059	0,91	(4 174)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 802 029	CHF	1 168 321	1,54	19 555
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	530 032	DKK	2 690 947	0,20	492
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	124 472	DKK	632 906	0,20	(75)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	7 444 974	EUR	5 069 051	1,47	7 543
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	386 288	EUR	263 382	1,47	(152)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	211 721	EUR	144 581	1,46	(411)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	2 567 838	GBP	1 479 645	1,74	9 303
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	635 565	GBP	366 928	1,73	1 090
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	326 524	HKD	1 861 374	0,18	241
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	15 109	HKD	86 161	0,18	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	171 348	HKD	979 344	0,17	(323)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	11 281 824	JPY	1 303 481 737	0,01	165 608
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 506 150	NOK	11 577 133	0,13	18 249
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	413 693	NOK	3 195 312	0,13	3 029
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	70 451	NOK	548 383	0,13	(28)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	44 614	PLN	131 465	0,34	(105)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	2 079 782	PLN	6 136 733	0,34	(7 679)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 730 702	SEK	13 196 402	0,13	24 721
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 102 050	SEK	8 466 824	0,13	7 491
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	139 970	SEK	1 076 849	0,13	759
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	162 700	SGD	160 800	1,01	266
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	163 498	SGD	161 851	1,01	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CHF	135 224	CAD	207 301	0,65	(993)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	HKD	57 551	CAD	10 090	5,70	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	JPY	274 330 268	CAD	2 355 466	116,47	(15 952)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	PLN	809 945	CAD	276 169	2,93	(659)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SEK	519 382	CAD	67 171	7,73	(27)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>231 561</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	263	(31)	-	232
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>263</b>	<b>(31)</b>	<b>-</b>	<b>232</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(31)	31	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(31)</b>	<b>31</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	377	(49)	-	328
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>377</b>	<b>(49)</b>	<b>-</b>	<b>328</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(49)	49	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(49)</b>	<b>49</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	51	78
Paielements indirects†	19	28

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	828 902	878 902	612 975	862 975
Parts rachetables émises	-	100 000	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(60 000)	(100 000)	(90 000)	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>768 902</b>	<b>878 902</b>	<b>522 975</b>	<b>762 975</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	4 483	655
Garanties (hors trésorerie)	4 736	692

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	20	22
Charges	(6)	(7)
Revenu tiré des prêts de titres	14	15
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,8</b>	<b>31,0</b>

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Japon	38,1
Actions - R.-U.	7,4
Actions - Italie	7,4
Actions - Australie	6,3
Actions - Suisse	5,7
Actions - Pologne	5,4
Actions - Suède	5,2
Actions - France	3,5
Actions - Allemagne	2,9
Actions - Espagne	2,5
Actions - Pays-Bas	2,0
Actions - Singapour	2,0
Actions - Norvège	2,0
Actions - Portugal	1,8
Actions - Danemark	1,5
Actions - Irlande	1,1
Actions - Israël	1,0
Actions - Finlande	1,0
Actions - Autriche	1,0
Actions - Belgique	0,6
Contrat(s) de change à terme	0,6
Actions - É.-U.	0,5
Actions - Macao	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,5
<b>Total</b>	<b>0,5</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2023

	Actif net (%)
<b>Note de crédit <sup>A*</sup></b>	
AAA/Aaa/A++	0,7
<b>Total</b>	<b>0,7</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Momentum Total Return IndexTM	4 944 568

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Momentum Total Return IndexTM	4 920 886

## Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Yen japonais	14 496	(8 777)	5 719	11,0
Euro	12 916	(8 036)	4 880	9,4
Livre sterling	5 108	(3 193)	1 915	3,7
Couronne suédoise	4 658	(2 873)	1 785	3,4
Couronne norvégienne	3 201	(1 969)	1 232	2,4
Zloty polonais	2 999	(1 857)	1 142	2,2
Dollar australien	2 675	(1 654)	1 021	2,0
Franc suisse	2 547	(1 576)	971	1,9
Shekel israélien	565	-	565	1,1
Couronne danoise	1 062	(654)	408	0,8
Dollar de Hong Kong	808	(503)	305	0,6
Dollar de Singapour	515	(326)	189	0,4
Dollar américain	8	-	8	0,0
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>51 560</b>	<b>(31 418)</b>	<b>20 142</b>	<b>38,9</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Indice Morningstar International Momentum CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Yen japonais	19 380	(11 113)	8 267	16,3
Euro	12 038	(7 025)	5 013	9,9
Livre sterling	3 783	(2 193)	1 590	3,1
Dollar australien	3 467	(2 041)	1 426	2,8
Franc suisse	2 883	(1 702)	1 181	2,3
Zloty polonais	2 756	(1 636)	1 120	2,2
Couronne suédoise	2 638	(1 564)	1 074	2,1
Couronne norvégienne	1 539	(907)	632	1,2
Shekel israélien	531	-	531	1,0
Couronne danoise	743	(434)	309	0,6
Dollar de Hong Kong	547	(311)	236	0,5
Dollar de Singapour	264	(149)	115	0,2
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>50 571</b>	<b>(29 075)</b>	<b>21 496</b>	<b>42,2</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 2 014 000 \$ (2 150 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	51 458	-	-	51 458
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	232	-	232
<b>Total</b>	<b>51 458</b>	<b>232</b>	<b>-</b>	<b>51 690</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	50 486	-	-	50 486
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	328	-	328
<b>Total</b>	<b>50 486</b>	<b>328</b>	<b>-</b>	<b>50 814</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	267 525	256 423
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	802	255
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	120	204
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	5 102	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	2	-
Dividendes à recevoir	563	213
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	120	125
	274 234	257 220
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	6	12
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	139	137
Frais d'administration à payer	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	2 687	-
Montant à payer pour le rachat de parts	2 764	-
Comptes créditeurs et charges à payer	138	329
	5 734	478
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>268 500</b>	<b>256 742</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	15 177	14 042	33,44	29,63	453 952	473 952
Parts ordinaires non couvertes	253 323	242 700	29,32	27,17	8 639 099	8 934 099

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	8 852	9 639
Intérêts aux fins des distributions	1	3
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	17 467	10 285
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	3 516	8 353
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>29 836</b>	<b>28 280</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	76	124
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(36)	(334)
Rabais sur frais	714	835
Autres revenus	196	72
<b>Total des autres revenus</b>	<b>950</b>	<b>697</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>30 786</b>	<b>28 977</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	826	922
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	200	315
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Charge d'intérêts	1	-
Retenues d'impôts	1 230	1 321
Taxe de vente harmonisée	9	15
<b>Total des charges</b>	<b>2 267</b>	<b>2 574</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>28 519</b>	<b>26 403</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	2 185	1 814	4,51	3,64	484 639	498 952
Parts ordinaires non couvertes	26 334	24 589	2,95	2,12	8 924 758	11 616 834

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023		
	2024	2023	2024	2023		
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	14 042	12 218	242 700	315 470	256 742	327 688
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 185	1 814	26 334	24 589	28 519	26 403
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(325)	(301)	(6 586)	(7 589)	(6 911)	(7 890)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(325)	(301)	(6 586)	(7 589)	(6 911)	(7 890)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	1 464	-	15 528	24 896	16 992	24 896
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(2 189)	-	(24 653)	(79 215)	(26 842)	(79 215)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(725)	-	(9 125)	(54 319)	(9 850)	(54 319)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 135	1 513	10 623	(37 319)	11 758	(35 806)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	15 177	13 731	253 323	278 151	268 500	291 882

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	28 519	26 403
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(17 467)	(10 285)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(3 516)	(8 353)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	8	10
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	200	315
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	102 345	175 900
Achat de placements et de dérivés	(95 001)	(120 320)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(350)	23
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	(28)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(186)	29
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>14 554</b>	<b>63 694</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(6 911)	(7 889)
Produit de l'émission de parts rachetables	16 990	24 895
Montant versé au rachat de parts rachetables	(24 078)	(79 215)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(13 999)</b>	<b>(62 209)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(8)	(10)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	555	1 485
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	255	371
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>802</b>	<b>1 846</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1	3
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	7 271	8 341
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(1)	-
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.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>JAPON</b>					
JPY	116 037	AISAN INDUSTRY CO., LTD.	1 276 896	1 381 891	
JPY	106 295	AOYAMA TRADING Co., Ltd.	1 522 523	1 350 867	
JPY	54 287	ARCS Co., Ltd.	1 424 123	1 342 425	
JPY	77 857	Chubu Electric Power Co., Inc.	1 471 673	1 259 009	
JPY	101 913	Daicel Corp.	945 986	1 337 223	
JPY	103 903	DCM Japan Holdings Co., Ltd.	1 292 371	1 290 417	
JPY	61 435	Electric Power Development Co., Ltd.	1 243 481	1 311 974	
JPY	69 040	F.C.C. Co., Ltd.	1 233 147	1 379 536	
JPY	55 712	Ferrotec Corp.	1 646 339	1 313 211	
JPY	12 895	Fuyo General Lease Co., Ltd.	1 097 476	1 349 746	
JPY	83 866	G-TEKT Corp.	1 390 063	1 396 130	
JPY	25 653	HANWA Co., Ltd.	1 055 491	1 344 213	
JPY	107 976	Hokkaido Electric Power Co., Inc.	668 250	1 096 682	
JPY	147 554	Hokuriku Electric Power Co.	1 057 361	1 278 383	
JPY	91 919	Honda Motor Co., Ltd.	1 292 864	1 344 878	
JPY	79 452	Hosiden Corp.	1 345 316	1 454 440	
JPY	143 771	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	951 243	1 273 737	
JPY	21 110	ITOCHU Corp.	776 962	1 410 354	
JPY	16 723	Iwatani International Corp.	1 033 550	1 330 640	
JPY	24 191	Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	1 020 276	1 337 569	
JPY	68 112	JFE Holdings Inc.	1 177 899	1 341 583	
JPY	143 181	JTEKT Corp.	1 630 805	1 363 511	
JPY	171 021	JVCKENWOOD Corp.	868 344	1 355 859	
JPY	52 701	Kanamoto Co., Ltd.	1 361 620	1 329 656	
JPY	90 022	Kandenko Co., Ltd.	964 515	1 318 654	
JPY	37 203	Kaneka Corp.	1 477 632	1 337 069	
JPY	56 191	Kansai Electric Power Co., Inc.	1 039 311	1 291 520	
JPY	78 775	Kobe Steel Ltd.	824 716	1 337 848	
JPY	37 876	Kohnan Shoji Co., Ltd.	1 277 562	1 345 147	
JPY	84 909	Kuraray Co., Ltd.	935 242	1 335 848	
JPY	75 480	KYOEI STEEL LTD.	1 456 505	1 345 775	
JPY	88 275	Kyushu Electric Power Co., Inc.	866 955	1 244 255	
JPY	23 716	Makino Milling Machine Co., Ltd.	1 204 271	1 361 740	
JPY	52 446	Marubeni Corp.	830 594	1 327 460	
JPY	102 882	Mazda Motor Corp.	1 205 632	1 361 752	
JPY	67 122	Medipal Holdings Corp.	1 500 212	1 397 737	
JPY	190 902	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	1 538 226	1 450 306	
JPY	48 757	Mitsubishi Corp.	843 971	1 305 632	
JPY	357 138	Mitsubishi Motors Corp.	1 654 039	1 346 434	
JPY	29 455	Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	1 047 660	1 368 046	
JPY	41 733	Mitsui & Co., Ltd.	628 076	1 296 106	
JPY	32 304	Mitsui O.S.K. Lines Ltd.	773 766	1 323 952	
JPY	35 123	MITSUI-SOKO Co., Ltd.	1 315 303	1 426 639	
JPY	95 614	NHK Spring Co., Ltd.	926 624	1 304 186	
JPY	46 257	Nippon Steel Corp.	1 118 962	1 338 238	
JPY	181 353	Nippon Suisan Kaisha Ltd.	1 059 897	1 331 018	
JPY	33 108	Nippon Yusen Kabushiki Kaisha	754 715	1 318 601	
JPY	62 177	Nishi-Nippon Railroad Co.	1 510 125	1 363 256	
JPY	37 470	NISHIO RENT ALL CO., LTD.	1 134 022	1 316 385	
JPY	287 911	Nissan Motor Co., Ltd.	1 461 946	1 336 966	
JPY	32 271	Nisshin Oilfield Group Ltd. (The)	1 290 635	1 328 639	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>JAPON (suite)</b>					
JPY	40 050	Noritake Co., Ltd.	1 032 094	1 357 625	
JPY	247 474	Oji Holdings Corp.	1 337 016	1 336 336	
JPY	155 443	Oki Electric Industry Co., Ltd.	1 355 518	1 343 427	
JPY	101 485	PACIFIC INDUSTRIAL CO., LTD.	1 406 372	1 301 824	
JPY	153 618	Rengo Co., Ltd.	1 446 485	1 363 590	
JPY	66 609	Ryobi Ltd.	1 596 414	1 298 664	
JPY	139 182	SENKO Co., Ltd.	1 460 710	1 334 308	
JPY	107 166	Shikoku Electric Power Co., Inc.	1 148 431	1 258 013	
JPY	176 998	SKY Perfect JSAT Holdings Inc.	1 080 519	1 306 885	
JPY	39 877	Sojitz Corp.	891 209	1 325 981	
JPY	45 639	STARTS CORP., INC.	1 367 169	1 318 029	
JPY	38 880	Sumitomo Corp.	942 241	1 328 548	
JPY	29 494	Sumitomo Forestry Co., Ltd.	773 685	1 283 803	
JPY	117 778	Sumitomo Riko Co., Ltd.	1 253 908	1 486 781	
JPY	61 327	Sumitomo Warehouse Co., Ltd. (The)	1 440 442	1 364 183	
JPY	153 168	TOA Corp.	1 345 962	1 327 674	
JPY	39 289	TOHO GAS Co., Ltd.	1 036 390	1 304 424	
JPY	40 112	Toho Holdings Co., Ltd.	821 604	1 434 452	
JPY	103 220	Tohoku Electric Power Co., Inc.	955 839	1 274 471	
JPY	72 718	TOKAI RIKA CO., LTD.	1 580 730	1 334 881	
JPY	175 514	Tokyo Electric Power Co., Holdings Inc.	1 533 912	1 293 240	
JPY	43 977	Tokyo Gas Co., Ltd.	1 186 554	1 292 477	
JPY	94 520	Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	1 337 451	1 311 375	
JPY	36 200	Toppan Inc.	882 641	1 365 072	
JPY	73 501	Topre Corp.	1 274 020	1 321 119	
JPY	76 065	TV Asahi Corp.	1 106 931	1 382 087	
JPY	96 912	Universal Entertainment Corp.	1 312 866	1 299 221	
JPY	65 416	Valor Holdings Co., Ltd.	1 580 396	1 370 002	
JPY	41 911	Yokohama Rubber Co., Ltd. (The)	1 096 814	1 268 122	
			95 009 496	106 719 757	39,7
<b>ITALIE</b>					
EUR	483 354	A2A SpA	978 689	1 318 112	
EUR	198 931	Banca Monte dei Paschi di Siena SPA	891 306	1 279 272	
EUR	149 598	Banco BPM SPA	1 329 939	1 319 410	
EUR	199 058	BPER Banca SPA	589 485	1 378 175	
EUR	91 799	Cementir Holding NV	982 672	1 254 713	
EUR	100 325	Credito Emiliano S.p.A.	857 321	1 368 305	
EUR	24 448	Danieli & C. Officine Meccaniche SPA	791 007	1 276 392	
EUR	66 634	Eni SPA	1 182 546	1 402 683	
EUR	274 043	Hera SPA	1 164 665	1 283 643	
EUR	490 758	Iren SpA	1 405 952	1 395 519	
EUR	79 846	Iveco Group NV	745 917	1 226 000	
EUR	212 879	MFE - MediaForEurope N.V., catégorie B	938 504	1 264 383	
EUR	154 422	Pirelli & C. SPA	1 102 299	1 259 142	
EUR	73 877	Poste Italiane SPA	1 033 601	1 288 737	
EUR	569 942	Saras Raffinerie	1 005 028	1 353 219	
EUR	101 586	Unipol Gruppo SPA	694 118	1 382 524	
EUR	452 291	Webuild S.p.A.	1 354 005	1 358 434	
			17 047 054	22 408 663	8,3

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>R.-U.</b>			
GBP	606 501	BT Group PLC	1 251 300	1 472 389	
GBP	594 105	Centrica PLC	1 615 838	1 386 289	
GBP	155 717	Drax Group PLC	1 396 719	1 325 734	
GBP	168 849	easyJet PLC	1 512 219	1 336 774	
GBP	497 977	FirstGroup PLC	1 342 321	1 363 543	
GBP	39 438	Imperial Brands PLC	1 101 929	1 380 715	
GBP	1 427 450	Lloyds Banking Group PLC	1 002 907	1 351 588	
GBP	259 614	Marks & Spencer Group PLC	716 807	1 286 564	
GBP	475 644	Premier Foods PLC	876 249	1 306 505	
GBP	187 083	Redde Northgate PLC	1 212 069	1 363 988	
NOK	22 164	Stolt-Neilsen Ltd.	649 622	1 438 431	
GBP	577 068	TI Fluid Systems PLC	1 289 850	1 301 617	
GBP	164 015	Vesuvius PLC	1 216 614	1 309 284	
GBP	366 735	Virgin Money UK PLC	903 405	1 354 978	
GBP	1 137 409	Vodafone Group PLC	1 505 143	1 372 467	
			17 592 992	20 350 866	7,6
		<b>FRANCE</b>			
EUR	29 059	Bouygues SA	1 443 897	1 277 198	
EUR	62 665	Carrefour SA	1 394 063	1 213 081	
EUR	67 028	Coface SA	1 002 642	1 278 864	
EUR	67 417	Crédit Agricole SA	917 965	1 259 591	
EUR	97 380	Orange SA	1 480 999	1 335 850	
EUR	77 806	Orpea SA	1 355 813	1 310 607	
EUR	18 295	Renault SA	975 260	1 283 554	
EUR	33 856	Rexel SA	953 120	1 199 564	
EUR	29 872	Rubis SCA	1 203 022	1 150 402	
EUR	36 120	SCOR SE	1 577 793	1 253 295	
EUR	39 786	Société Générale SA	1 511 880	1 278 973	
EUR	115 261	Télévision Française 1 SA	1 172 564	1 232 255	
EUR	25 663	Vicat SA	1 184 982	1 262 672	
			16 174 000	16 335 906	6,1
		<b>HONG KONG</b>			
HKD	971 583	Cathay Pacific Airways Ltd.	1 406 062	1 360 559	
HKD	209 862	CK Hutchison Holdings Ltd.	1 825 288	1 375 613	
HKD	2 150 226	First Pacific Co., Ltd.	978 055	1 367 986	
USD	27 369	Jardine Matheson Holdings Ltd.	1 680 632	1 329 488	
HKD	661 330	Johnson Electric Holdings Ltd.	1 415 913	1 363 064	
HKD	922 606	Kerry Logistics Network Ltd.	1 370 858	1 215 976	
HKD	1 143 870	NWS Holdings Ltd.	1 389 444	1 389 315	
HKD	119 421	Swire Pacific Ltd., catégorie A	1 271 862	1 444 177	
HKD	1 748 850	VST Holdings Ltd.	1 578 455	1 357 835	
HKD	538 292	Yue Yuen Industrial (Holdings) Ltd.	881 970	1 424 576	
			13 798 539	13 628 589	5,1
		<b>ALLEMAGNE</b>			
EUR	55 763	1&1 AG	1 391 942	1 303 542	
EUR	12 779	Aurubis AG	1 236 993	1 372 763	
EUR	10 293	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	1 258 483	1 334 095	
EUR	62 099	Deutsche Bank AG, actions nominatives	1 315 121	1 357 671	
EUR	30 915	Fresenius SE & Co., KGaA	1 431 154	1 264 016	
EUR	9 350	HeidelbergCement AG	1 008 319	1 327 600	
EUR	14 332	Mercedes-Benz Group AG	1 421 680	1 357 151	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ALLEMAGNE (suite)</b>					
EUR	65 934	Suedzucker AG	1 316 427	1 315 040	
EUR	12 478	Talanx AG	749 150	1 364 217	
EUR	8 480	Volkswagen AG, privilégiées	1 968 907	1 310 772	
			13 098 176	13 306 867	5,0
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	93 603	Acerinox SA	1 362 936	1 330 161	
EUR	99 423	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	826 046	1 363 584	
EUR	509 044	Banco de Sabadell SA	572 792	1 344 123	
EUR	201 958	Banco Santander SA	882 953	1 282 596	
EUR	313 853	Gestamp Automocion SA	1 565 219	1 279 563	
EUR	24 642	Grupo Catalana Occidente SA	1 129 495	1 366 024	
EUR	426 541	Mapfre SA	1 146 711	1 347 402	
EUR	64 897	Repsol SA	1 074 684	1 402 380	
EUR	724 089	Unicaja Banco SA	1 332 507	1 352 858	
			9 893 343	12 068 691	4,5
<b>POLOGNE</b>					
PLN	330 012	Cyfrowy Polsat SA	1 353 808	1 361 439	
PLN	411 544	Enea SA	1 340 801	1 491 872	
PLN	495 424	Orange Polska SA	1 142 263	1 312 640	
PLN	64 407	Polski Koncern Naftowy Orlen SA	1 427 469	1 483 964	
PLN	83 774	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	1 153 970	1 469 669	
PLN	1 027 284	Tauron Polska Energia SA	1 380 021	1 384 686	
			7 798 332	8 504 270	3,2
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	22 995	OMV AG	1 320 178	1 371 171	
EUR	55 863	Raiffeisen Bank International AG	1 087 329	1 328 819	
EUR	21 731	Strabag SE	1 220 883	1 241 303	
EUR	103 568	Telekom Austria AG	993 414	1 415 573	
EUR	31 653	Vienna Insurance Group	1 082 796	1 415 811	
EUR	36 233	voestalpine AG	1 331 186	1 340 109	
			7 035 786	8 112 786	3,0
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	239 330	Aker Solutions ASA	1 140 138	1 359 468	
NOK	95 002	Hoegh Autoliners ASA	839 097	1 535 900	
NOK	486 360	MPC Container Ships AS	841 489	1 406 964	
NOK	108 323	Wilh. Wilhelmsen ASA	1 219 279	1 515 996	
			4 040 003	5 818 328	2,2
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	146 905	AGL Energy Ltd.	1 126 182	1 453 922	
AUD	73 345	Bluescope Steel Ltd.	1 394 124	1 369 352	
AUD	115 208	Super Cheap Auto Group Ltd.	1 280 074	1 468 699	
AUD	195 301	Whitehaven Coal Ltd.	1 253 651	1 365 344	
			5 054 031	5 657 317	2,1
<b>SINGAPOUR</b>					
NOK	54 329	BW LPG Ltd.	610 979	1 384 534	
SGD	5 016 800	Golden Agri-Resources Ltd.	1 372 471	1 367 629	
SGD	50 107	Jardine Cycle & Carriage Ltd.	1 210 629	1 345 730	
SGD	441 200	Wilmar International Ltd.	1 500 253	1 380 941	
			4 694 332	5 478 834	2,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	22 225	Bekaert SA	1 085 325	1 273 758	
EUR	20 645	Colruyt Group	1 313 014	1 349 726	
EUR	128 404	Proximus SA	1 514 540	1 402 897	
EUR	28 306	Solvay SA	1 406 295	1 364 485	
			5 319 174	5 390 866	2,0
<b>PORTUGAL</b>					
EUR	2 658 860	Banco Comercial Portugues SA	1 095 879	1 312 503	
EUR	279 400	NOS SGPS SA	1 396 114	1 354 218	
EUR	1 014 198	Sonae SGPS SA	1 352 910	1 301 432	
			3 844 903	3 968 153	1,5
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	9 235	EXOR NV	1 107 004	1 323 190	
EUR	33 322	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 249 048	1 348 259	
EUR	45 945	Stellantis NV	1 170 967	1 244 503	
			3 527 019	3 915 952	1,5
<b>SUÈDE</b>					
SEK	264 713	Ratos AB, actions B	1 184 526	1 233 372	
SEK	180 181	SSAB AB, série A	1 405 157	1 360 543	
SEK	299 324	Volvo Car AB, catégorie B	1 598 570	1 267 972	
			4 188 253	3 861 887	1,4
<b>DANEMARK</b>					
DKK	599	A.P. Moller-Maersk AS, catégorie B	1 344 446	1 425 910	
DKK	33 867	DFDS AS	1 523 079	1 311 362	
			2 867 525	2 737 272	1,0
<b>ISRAËL</b>					
ILS	121 454	Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	1 377 140	1 333 609	
ILS	107 940	Phoenix Holdings Ltd. (The)	1 400 226	1 348 712	
			2 777 366	2 682 321	1,0
<b>JERSEY</b>					
GBP	169 542	Glencore PLC	1 311 300	1 322 905	
GBP	379 136	TP ICAP Group PLC	1 424 844	1 310 295	
			2 736 144	2 633 200	1,0
<b>SUISSE</b>					
CHF	3 375	Bell Food Group AG, actions nominatives	1 244 625	1 331 081	0,5
<b>CURAÇAO</b>					
EUR	7 967	Fiducie HAL	1 345 522	1 320 274	0,5
<b>LUXEMBOURG</b>					
EUR	41 252	ArcelorMittal SA	1 489 084	1 292 826	0,5
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>240 575 699</b>	<b>267 524 706</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(317 118)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>240 258 581</b>	<b>267 524 706</b>	<b>99,7</b>
Contrat(s) de change à terme				114 438	0,0
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>240 258 581</b>	<b>267 639 144</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				861 158	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>268 500 302</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	AUD	177 839	CAD	161 872	1,10	660
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	AUD	23 121	CAD	21 069	1,10	61
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	497 655	AUD	545 405	0,91	(804)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	80 730	CHF	52 340	1,54	876
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	2 101	CHF	1 370	1,53	10
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	254 619	DKK	1 292 687	0,20	237
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	4 028	DKK	20 536	0,20	(13)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	5 398 724	EUR	3 675 823	1,47	5 470
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 242 264	GBP	715 820	1,74	4 500
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	62 205	GBP	35 913	1,73	107
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	742 276	HKD	4 231 406	0,18	547
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	6 309 697	JPY	729 011 066	0,01	92 621
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	150 449	JPY	17 594 331	0,01	403
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	728 688	NOK	5 601 116	0,13	8 829
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	10 353	NOK	80 348	0,13	27
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	16 966	NOK	132 063	0,13	(7)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	116 801	PLN	342 553	0,34	279
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	12 043	PLN	35 419	0,34	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	12 849	PLN	37 863	0,34	(30)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	376 589	PLN	1 111 185	0,34	(1 390)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	339 942	SEK	2 592 019	0,13	4 856
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	242 952	SGD	240 115	1,01	397
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	13 568	SGD	13 431	1,01	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	73 453	USD	53 688	1,37	22
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	8 733	USD	6 396	1,37	(15)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CHF	1 246	CAD	1 906	0,65	(5)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CHF	3 305	CAD	5 055	0,65	(13)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	DKK	485 757	CAD	95 533	5,08	57
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	DKK	52 260	CAD	10 280	5,08	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	EUR	225 926	CAD	331 517	0,68	(33)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	GBP	47 185	CAD	81 649	0,58	(60)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	HKD	264 790	CAD	46 434	5,70	(19)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	JPY	47 072 413	CAD	402 245	117,02	(807)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	NOK	246 304	CAD	31 678	7,78	(23)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	NOK	1 830 342	CAD	236 972	7,72	(1 735)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	PLN	91 967	CAD	31 220	2,95	63
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	PLN	30 545	CAD	10 345	2,95	45
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SEK	112 032	CAD	14 466	7,74	17
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SEK	43 459	CAD	5 620	7,73	(2)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SEK	812 385	CAD	105 741	7,68	(719)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SGD	15 591	CAD	15 725	0,99	25
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	SGD	5 474	CAD	5 524	0,99	6
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	1 633	CAD	2 234	0,73	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	3 728	CAD	5 100	0,73	(1)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>114 438</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	120	(6)	-	114
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	120	(6)	-	114
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(6)	6	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(6)	6	-	-

au 31 décembre 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	204	(12)	-	192
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	204	(12)	-	192
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(12)	12	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(12)	12	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	200	269
Paielements indirects†	75	95

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	473 952	498 952	8 934 099	13 234 099
Parts rachetables émises	45 000	-	525 000	975 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(65 000)	-	(820 000)	(3 150 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>453 952</b>	<b>498 952</b>	<b>8 639 099</b>	<b>11 059 099</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,600
Parts ordinaires non couvertes	0,600

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	31 999	6 838
Garanties (hors trésorerie)	33 915	7 186

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	109	177
Charges	(33)	(53)
Revenu tiré des prêts de titres	76	124
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,1</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Japon	40,1
Actions - Italie	10,0
Actions - Allemagne	6,5
Actions - R.-U.	6,5
Actions - France	5,5
Actions - Hong Kong	4,1
Actions - Espagne	3,8
Actions - Autriche	3,7
Actions - Australie	3,1
Actions - Pays-Bas	2,5
Actions - Norvège	2,1
Actions - Pologne	1,9
Actions - Belgique	1,6
Actions - Danemark	1,6
Actions - Singapour	1,5
Actions - Suède	1,5
Actions - Portugal	1,4
Actions - Israël	0,9
Actions - Luxembourg	0,5
Actions - Jersey	0,5
Actions - Suisse	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Contrat(s) de change à terme	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
Aucune	0,5
<b>Total</b>	<b>0,5</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de crédit (suite)

au 31 décembre 2023

	Actif net (%)
<b>Note de crédit <sup>A*</sup></b>	
AAA/Aaa/A++	0,1
Aucune	0,5
<b>Total</b>	<b>0,6</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

## Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Value Total Return IndexTM	26 208 549

### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Value Total Return IndexTM	25 134 567

## Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Yen japonais	107 010	(5 966)	101 044	37,6
Euro	88 083	(5 062)	83 021	30,9
Livre sterling	21 695	(1 218)	20 477	7,6
Dollar de Hong Kong	12 433	(695)	11 738	4,4
Couronne norvégienne	8 745	(480)	8 265	3,1
Zloty polonais	8 571	(478)	8 093	3,0
Dollar australien	5 657	(315)	5 342	2,0
Dollar de Singapour	4 094	(235)	3 859	1,4
Couronne suédoise	3 861	(210)	3 651	1,4
Shekel israélien	2 692	-	2 692	1,0
Couronne danoise	2 737	(153)	2 584	1,0
Dollar américain	1 381	(75)	1 306	0,5
Franc suisse	1 333	(75)	1 258	0,5
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>268 294</b>	<b>(14 962)</b>	<b>253 332</b>	<b>94,4</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Indice Morningstar International Valeur CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Yen japonais	103 104	(5 453)	97 651	38,0
Euro	91 484	(4 894)	86 590	33,7
Livre sterling	16 695	(887)	15 808	6,2
Dollar de Hong Kong	9 168	(496)	8 672	3,4
Couronne norvégienne	8 015	(446)	7 569	2,9
Dollar australien	7 973	(433)	7 540	2,9
Zloty polonais	4 898	(269)	4 629	1,8
Couronne danoise	4 106	(220)	3 886	1,5
Couronne suédoise	3 869	(215)	3 654	1,4
Dollar de Singapour	2 690	(143)	2 547	1,0
Shekel israélien	2 191	-	2 191	0,9
Dollar américain	1 308	(66)	1 242	0,5
Franc suisse	1 227	(67)	1 160	0,5
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
<b>Total</b>	<b>256 730</b>	<b>(13 589)</b>	<b>243 141</b>	<b>94,7</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 25 333 000 \$ (24 314 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	267 525	-	-	267 525
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	114	-	114
<b>Total</b>	<b>267 525</b>	<b>114</b>	<b>-</b>	<b>267 639</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	256 423	-	-	256 423
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	192	-	192
<b>Total</b>	<b>256 423</b>	<b>192</b>	<b>-</b>	<b>256 615</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	69 703	67 015
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	59	179
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	195	182
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	69 957	67 376
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	28	28
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	8	9
	36	37
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	69 921	67 339

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	69 921	67 339	28,27	26,68	2 473 791	2 523 791

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	724	623
Intérêts aux fins des distributions	5	3
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	1 341	2 944
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 571	4 144
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>4 641</b>	<b>7 714</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	9	29
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	1	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>10</b>	<b>29</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>4 651</b>	<b>7 743</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	172	165
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	25	23
<b>Total des charges</b>	<b>200</b>	<b>191</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>4 451</b>	<b>7 552</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	4 451	7 552	1,77	2,92	2 514 450	2 587 051

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	67 339	67 405	67 339	67 405
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 451	7 552	4 451	7 552
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(74)	(78)	(74)	(78)
Profits nets réalisés	(369)	(324)	(369)	(324)
Remboursement de capital	(2)	-	(2)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(445)	(402)	(445)	(402)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	-	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 424)	(7 621)	(1 424)	(7 621)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(1 424)	(7 621)	(1 424)	(7 621)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 582	(471)	2 582	(471)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	69 921	66 934	69 921	66 934

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 451	7 552
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 341)	(2 944)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 571)	(4 144)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 360	2 235
Achat de placements et de dérivés	(2 555)	(1 581)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(13)	9
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	(3)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(1)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>332</b>	<b>1 126</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(445)	(402)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(7)	(32)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(452)</b>	<b>(434)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(120)	692
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	179	87
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>59</b>	<b>779</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	5	3
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	711	632
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.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>				
122 294	Air Canada	2 058 608	2 189 063	
59 836	AtkinsRealis Group Inc.	2 277 341	3 543 488	
29 301	Bombardier Inc., catégorie B	853 862	2 570 577	
108 634	CAE Inc.	2 266 948	2 760 390	
19 343	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1 937 692	3 126 989	
4 182	GDI Integrated Facility Services Inc.	122 021	134 870	
10 297	Héroux-Devtek Inc.	127 833	256 395	
17 672	Quincaillerie Richelieu Ltée	449 238	727 910	
19 436	Savaria Corp.	268 182	349 654	
15 951	TFI International Inc.	692 781	3 168 507	
13 137	Transat A.T. Inc.	90 429	30 346	
16 401	WSP Global Inc.	1 102 753	3 493 905	
		12 247 688	22 352 094	32,0
<b>SERVICES FINANCIERS</b>				
28 058	Corporation Fiera Capital	261 752	219 975	
33 807	iA Société financière inc.	1 795 755	2 904 359	
14 929	Banque Laurentienne du Canada	608 200	396 365	
30 277	Banque Nationale du Canada	1 667 618	3 285 357	
21 686	Nuvei Corp.	2 666 008	960 907	
91 049	Power Corporation du Canada	2 909 344	3 461 683	
		9 908 677	11 228 646	16,1
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>				
45 836	Alimentation Couche-Tard Inc.	1 411 572	3 518 830	
1 026	Industries Lassonde Inc., catégorie A	164 461	158 425	
48 072	Metro inc.	2 253 014	3 643 377	
83 870	Saputo inc.	2 739 596	2 576 486	
		6 568 643	9 897 118	14,2
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>				
11 524	BRP Inc. du Canada	582 148	1 010 079	
34 066	Dollarama Inc.	1 457 833	4 255 183	
56 203	Gildan Activewear Inc.	1 648 112	2 916 374	
6 952	MTY Food Group Inc.	298 840	312 423	
		3 986 933	8 494 059	12,1
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>				
76 554	BCE Inc.	3 961 862	3 392 108	
10 273	Cogeco Communications Inc.	672 850	529 984	
2 689	Cogeco Inc.	166 088	129 610	
52 351	Québecor Inc., catégorie B	1 239 981	1 511 373	
14 051	Stingray Group Inc.	82 100	106 507	
		6 122 881	5 669 582	8,1
<b>MATÉRIAUX</b>				
28 813	5N Plus Inc.	65 939	180 369	
38 854	Aya Gold & Silver Inc.	314 049	527 637	
26 478	Cascades Inc.	280 512	239 096	
61 151	G Mining Ventures Corp.	143 666	144 316	
40 774	NanoXplore Inc.	219 527	100 712	
63 029	Redevances aurifères Osisko Ltée	908 717	1 343 778	
19 370	Stella-Jones Inc.	734 523	1 729 160	
24 973	Transcontinental Inc., catégorie A	393 958	377 592	
		3 060 891	4 642 660	6,6
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>				
23 334	CGI inc.	1 472 671	3 186 258	
20 827	Coveo Solutions Inc.	174 357	162 242	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)</b>				
46 779	Lightspeed Commerce Inc.	1 995 565	874 767	
4 168	TECSYS Inc.	96 893	145 838	
		3 739 486	4 369 105	6,2
<b>SERVICES PUBLICS</b>				
35 055	Boralex Inc., catégorie A	900 512	1 174 693	
52 796	Innergex énergie renouvelable inc.	777 629	540 103	
		1 678 141	1 714 796	2,5
<b>SOINS DE SANTÉ</b>				
111 474	Bausch Health Cos., Inc.	3 238 294	1 063 462	
18 505	Knight Therapeutics Inc.	143 679	104 923	
		3 381 973	1 168 385	1,7
<b>IMMOBILIER</b>				
29 176	BTB REIT	79 969	91 321	
15 674	PRO REIT	84 368	75 549	
		164 337	166 870	0,2
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>50 859 650</b>	<b>69 703 315</b>	<b>99,7</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		(5 478)		
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>50 854 172</b>	<b>69 703 315</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets			217 231	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>			<b>69 920 546</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	2	2
Paiements indirects†	1	1

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 523 791	2 823 791
Parts rachetables émises	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	(300 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2 473 791	2 523 791

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,500

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	5 461	-
Garanties (hors trésorerie)	5 740	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	14	44
Charges	(5)	(15)
Revenu tiré des prêts de titres	9	29
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>36,1</b>	<b>32,8</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Produits industriels	31,2
Actions - Services financiers	17,5
Actions - Biens de consommation de base	13,2
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	11,1
Actions - Services de communication	8,3
Actions - Technologies de l'information	7,4
Actions - Matériaux	6,0
Actions - Services publics	2,6
Actions - Soins de santé	2,0
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Actions - Immobilier	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Morningstar® National Bank Québec Total Return Index™	6 957 559

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Morningstar® National Bank Québec Total Return Index™	6 695 072

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	69 703	-	-	69 703
<b>Total</b>	<b>69 703</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>69 703</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	67 015	-	-	67 015
<b>Total</b>	<b>67 015</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>67 015</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.



# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	77 231	72 149
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	142	74
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	92	258
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	72	61
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	17	16
	77 554	72 558
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	46	44
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	23	22
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	22	32
	91	98
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>77 463</b>	<b>72 460</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	11 392	11 156	32,55	31,88	350 000	350 000
Parts ordinaires non couvertes	66 071	61 304	31,46	30,65	2 100 000	2 000 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 025	923
Intérêts aux fins des distributions	9	3
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	4 043	765
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(2 166)	7 226
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>2 911</b>	<b>8 917</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	258	4
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(16)	(26)
Rabais sur frais	99	94
Autres revenus	8	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>349</b>	<b>72</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 260</b>	<b>8 989</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	136	127
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	49	33
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	185	108
Taxe de vente harmonisée	3	4
<b>Total des charges</b>	<b>374</b>	<b>273</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 886</b>	<b>8 716</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	366	1 734	1,05	3,80	350 000	456 354
Parts ordinaires non couvertes	2 520	6 982	1,21	3,07	2 083 516	2 273 757

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023		
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	11 156	13 968	61 304	59 212	72 460	73 180
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	366	1 734	2 520	6 982	2 886	8 716
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(23)	(75)	(165)	(552)	(188)	(627)
Profits nets réalisés	(107)	(23)	(721)	(103)	(828)	(126)
Remboursement de capital	-	-	(3)	-	(3)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(130)	(98)	(889)	(655)	(1 019)	(753)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	-	3 136	-	3 136	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(3 910)	-	(2 593)	-	(6 503)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	-	(3 910)	3 136	(2 593)	3 136	(6 503)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	236	(2 274)	4 767	3 734	5 003	1 460
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	11 392	11 694	66 071	62 946	77 463	74 640

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 886	8 716
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4 043)	(765)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	2 166	(7 226)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	49	33
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	35 171	21 626
Achat de placements et de dérivés	(36 506)	(18 852)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(11)	3
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(11)	3
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(299)</b>	<b>3 538</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 020)	(753)
Produit de l'émission de parts rachetables	1 386	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(2 764)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>366</b>	<b>(3 517)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	67	21
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	74	82
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>142</b>	<b>102</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	9	3
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	829	817
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.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>É.-U.</b>					
USD	6 063	Amgen Inc.	2 015 165	2 592 181	
USD	1 644	Biogen Inc.	579 676	521 495	
USD	7 310	Boston Properties Inc.	748 605	615 762	
USD	11 085	Church & Dwight Co., Inc.	1 446 268	1 572 635	
USD	5 640	Clorox Co. (The)	1 210 961	1 053 206	
USD	21 726	Conagra Brands Inc.	955 487	844 892	
USD	13 572	D.R. Horton Inc.	2 734 584	2 617 246	
USD	4 361	DexCom Inc.	592 899	676 581	
USD	15 305	Digital Realty Trust Inc.	2 499 141	3 184 322	
USD	6 802	Edwards Lifesciences Corp.	814 467	859 735	
USD	25 857	Enphase Energy Inc.	4 508 441	3 527 882	
USD	3 639	Equinix Inc.	3 608 419	3 767 433	
USD	13 592	First Solar Inc.	5 035 338	4 193 244	
USD	25 657	General Mills Inc.	2 225 249	2 220 917	
USD	2 655	Hologic Inc.	243 062	269 748	
USD	13 690	Hormel Foods Corp.	751 261	571 160	
USD	792	Insulet Corp.	233 727	218 697	
USD	4 825	J.M. Smucker Co. (The)	882 780	719 914	
USD	12 425	Kellanova	914 167	980 661	
USD	30 225	NVIDIA Corp.	1 072 580	5 109 415	
USD	3 953	Owens Corning	612 408	939 667	
USD	532	Teleflex Inc.	198 636	153 112	
USD	35 754	Weyerhaeuser Co.	1 553 122	1 388 952	
USD	10 988	Xylem Inc.	1 559 467	2 039 255	
			36 995 910	40 638 112	52,4
<b>DANEMARK</b>					
DKK	748	Genmab AS	347 694	256 683	
DKK	21 364	Novo Nordisk AS, catégorie B	1 338 755	4 224 819	
DKK	8 597	Orsted AS	1 118 840	626 546	
DKK	423	Rockwool International AS, catégorie B	160 925	235 078	
DKK	45 895	Vestas Wind Systems AS	1 705 349	1 455 343	
			4 671 563	6 798 469	8,8
<b>JAPON</b>					
JPY	7 598	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	315 298	369 437	
JPY	20 925	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	780 481	983 260	
JPY	27 467	Daiwa House Industry Co., Ltd.	997 831	952 579	
JPY	2 852	Eisai Co., Ltd.	238 952	159 925	
JPY	21 173	Kao Corp.	1 585 909	1 175 021	
JPY	45 454	Kubota Corp.	954 540	869 969	
JPY	10 669	Meiji Holdings Co., Ltd.	334 330	314 831	
JPY	5 696	Sysmex Corp.	179 540	125 541	
JPY	6 435	Toto Ltd.	318 550	207 899	
JPY	18 339	Uni-Charm Corp.	906 265	806 052	
JPY	19 960	West Japan Railway Co.	663 330	508 518	
			7 275 026	6 473 032	8,3
<b>R.-U.</b>					
GBP	17 537	AstraZeneca PLC	3 730 995	3 748 106	
GBP	4 816	Berkeley Group Holdings PLC (The)	371 784	382 198	
GBP	34 681	Land Securities Group PLC	394 948	371 631	
GBP	62 305	Segro PLC	1 123 163	967 998	
			5 620 890	5 469 933	7,1
<b>SUISSE</b>					
CHF	1 519	Geberit AG, actions nominatives	1 245 638	1 227 777	
CHF	22 297	Novartis AG, actions nominatives	2 968 298	3 265 253	
			4 213 936	4 493 030	5,8

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>FRANCE</b>					
EUR	2 475	Covivio	175 702	161 084	
EUR	68 918	Dassault Systemes SE	4 074 024	3 567 780	
EUR	2 255	Gecina SA	373 214	284 239	
			4 622 940	4 013 103	5,2
<b>SUÈDE</b>					
SEK	27 691	Essity AB, catégorie B	1 028 985	971 050	
SEK	3 464	Holmen AB, catégorie B	209 600	186 730	
SEK	27 541	Svenska Cellulosa AB, série B	537 727	557 091	
			1 776 312	1 714 871	2,2
<b>AUSTRALIE</b>					
AUD	5 467	CSL Ltd.	1 389 059	1 474 879	1,9
<b>SINGAPOUR</b>					
SGD	183 000	FPI de CapitaLand Ascendas	482 158	473 008	
SGD	263 843	CapitaLand Integrated Commercial Trust	519 184	527 459	
SGD	66 151	Keppel Corp., Ltd.	406 231	432 134	
			1 407 573	1 432 601	1,8
<b>NORVÈGE</b>					
NOK	21 151	Mowi ASA	549 709	483 023	
NOK	31 858	Orkla ASA	364 856	355 171	
NOK	3 000	Salmar ASA	238 677	216 674	
			1 153 242	1 054 868	1,4
<b>ALLEMAGNE</b>					
EUR	3 297	Knorr-Bremse AG	310 797	344 746	
EUR	3 632	LEG Immobilien SE	502 281	406 194	
			813 078	750 940	1,0
<b>BELGIQUE</b>					
EUR	9 518	Umicore SA	458 093	195 837	
EUR	8 603	Warehouses De Pauw SCA	340 887	319 198	
			798 980	515 035	0,7
<b>FINLANDE</b>					
EUR	19 227	Neste OYJ	886 505	468 774	0,6
<b>ESPAGNE</b>					
EUR	18 443	Red Electrica Corp., SA	465 047	441 410	0,6
<b>CANADA</b>					
	7 203	FPI RioCan	136 735	121 082	
	2 527	West Fraser Timber Co., Ltd.	244 805	265 512	
			381 540	386 594	0,5
<b>AUTRICHE</b>					
EUR	3 095	Verbund AG	371 808	334 291	0,4
<b>HONG KONG</b>					
HKD	70 637	MTR Corp., Ltd.	440 091	305 169	0,4
<b>PAYS-BAS</b>					
EUR	5 538	JDE Peet's N.V.	210 809	151 062	
EUR	2 508	QIAGEN NV	146 207	141 789	
			357 016	292 851	0,4
<b>NOUVELLE-ZÉLANDE</b>					
NZD	31 677	Mercury NZ Ltd.	170 745	173 397	0,2
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>73 811 261</b>	<b>77 231 359</b>	<b>99,7</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(77 847)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>73 733 414</b>	<b>77 231 359</b>	<b>99,7</b>
		Contrat(s) de change à terme		45 541	0,1
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>73 733 414</b>	<b>77 276 900</b>	<b>99,8</b>
		Autres actifs (passifs) nets		185 705	0,2
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>77 462 605</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	AUD	235 916	CAD	214 956	1,10	637
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	AUD	4 547	CAD	4 155	1,09	-
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	7 705	AUD	8 427	0,91	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	6 703	AUD	7 402	0,91	(61)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	67 959	AUD	74 667	0,91	(276)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	136 245	AUD	149 967	0,91	(803)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	17 841	CHF	11 623	1,53	142
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	746 984	CHF	492 378	1,52	(2 789)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 042 441	DKK	5 240 289	0,20	11 923
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	22 554	DKK	113 204	0,20	292
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 074 972	EUR	724 771	1,48	12 074
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	651 210	GBP	374 271	1,74	3 822
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	158 188	GBP	90 865	1,74	1 016
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	19 852	GBP	11 347	1,75	225
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	3 470	GBP	2 001	1,73	9
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	98 186	HKD	561 315	0,17	(192)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 715 873	JPY	195 759 055	0,01	50 655
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	132 280	NOK	1 018 134	0,13	1 436
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	30 962	NOK	238 041	0,13	371
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	3 632	NOK	28 230	0,13	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	20 138	NZD	24 058	0,84	78
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	5 930	NZD	7 050	0,84	52
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	627	NZD	746	0,84	4
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	840	NZD	1 003	0,84	3
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	52 359	SEK	400 384	0,13	626
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	5 372	SEK	40 846	0,13	94
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	203 387	SEK	1 574 421	0,13	(43)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	127 142	SGD	125 380	1,01	550
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	86 349	SGD	85 335	1,01	188
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	145 959	USD	106 553	1,37	157
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	6 153 164	USD	4 504 811	1,37	(10 995)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CHF	65 294	CAD	99 488	0,66	(61)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CHF	438 708	CAD	669 836	0,65	(1 790)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	DKK	5 127 940	CAD	1 008 048	5,09	376
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	DKK	109 155	CAD	21 597	5,05	(131)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	DKK	116 398	CAD	23 150	5,03	(260)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	686 148	CAD	1 006 349	0,68	(92)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	19 634	CAD	28 974	0,68	(181)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	EUR	18 989	CAD	28 223	0,67	(375)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	GBP	14 705	CAD	25 528	0,58	(93)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	GBP	463 779	CAD	802 764	0,58	(550)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	276 590	CAD	48 235	5,73	241
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	11 332	CAD	1 975	5,74	11
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	5 571	CAD	975	5,72	2
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	14 111	CAD	2 474	5,70	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	HKD	253 711	CAD	44 481	5,70	(15)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	2 491 622	CAD	21 694	114,86	(499)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	109 134 334	CAD	930 270	117,31	(1 923)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	JPY	84 133 099	CAD	737 135	114,14	(21 460)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	NOK	34 538	CAD	4 433	7,79	5
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	NOK	1 249 867	CAD	160 733	7,78	(108)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	NZD	31 157	CAD	25 978	1,20	1
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	NZD	743	CAD	625	1,19	(6)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	NZD	958	CAD	806	1,19	(8)

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme (suite)

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	SEK	1 959 724	CAD	252 904	7,75	310
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	SEK	55 927	CAD	7 349	7,61	(123)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	SGD	205 863	CAD	207 515	0,99	338
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	SGD	4 853	CAD	4 909	0,99	(10)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	103 244	CAD	141 019	0,73	255
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	4 508 120	CAD	6 169 978	0,73	(1 291)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	215 911	AUD	236 930	0,91	(635)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	664 499	CHF	433 958	1,53	1 689
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	1 022 381	DKK	5 195 757	0,20	(469)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	1 009 529	EUR	687 828	1,47	55
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	811 676	GBP	469 181	1,73	545
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	44 896	HKD	256 032	0,18	12
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	967 729	JPY	113 093 199	0,01	1 843
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	157 094	NOK	1 221 493	0,13	102
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	26 049	NZD	31 265	0,83	(1)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	253 480	SEK	1 962 682	0,13	(324)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	210 321	SGD	208 513	1,01	(370)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	6 042 716	USD	4 418 221	1,37	1 329
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	NZD	655	CAD	546	1,20	-
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>45 541</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	92	(46)	-	46
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	92	(46)	-	46
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(46)	46	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(46)	46	-	-

au 31 décembre 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	258	(44)	-	214
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	258	(44)	-	214
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(44)	44	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(44)	44	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	49	28
Paielements indirects†	18	10

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	350 000	550 000	2 000 000	2 350 000
Parts rachetables émises	-	-	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(150 000)	-	(100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	350 000	400 000	2 100 000	2 250 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,350
Parts ordinaires non couvertes	0,350

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	7 304	13
Garanties (hors trésorerie)	7 701	13

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	523	6
Charges	(265)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	258	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>50,7</b>	<b>30,1</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - É.-U.	54,9
Actions - Japon	11,3
Actions - Danemark	8,4
Actions - Suisse	6,6
Actions - France	5,9
Actions - Allemagne	2,1
Actions - Suède	1,7
Actions - Australie	1,2
Actions - R.-U.	1,2
Actions - Singapour	1,2
Actions - Norvège	1,1
Actions - Finlande	0,9
Actions - Hong Kong	0,9
Actions - Canada	0,4
Actions - Espagne	0,4
Actions - Autriche	0,4
Actions - Belgique	0,4
Contrat(s) de change à terme	0,3
Actions - Irlande	0,2
Actions - Nouvelle-Zélande	0,2
Actions - Pays-Bas	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice MSCI mondial de rendement total de la sélection d'impact ESG hors combustibles fossiles (couvert en \$ CA)	7 685 240

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice MSCI mondial de rendement total de la sélection d'impact ESG hors combustibles fossiles (couvert en \$ CA)	7 193 284

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	40 673	(6 041)	34 632	44,7
Euro	6 837	(1 009)	5 828	7,5
Couronne danoise	6 800	(1 023)	5 777	7,5
Yen japonais	6 519	(966)	5 553	7,2
Livre sterling	5 480	(811)	4 669	6,0
Franc suisse	4 495	(663)	3 832	4,9
Couronne suédoise	1 718	(254)	1 464	1,9
Dollar australien	1 478	(217)	1 261	1,6
Dollar de Singapour	1 436	(211)	1 225	1,6
Couronne norvégienne	1 056	(157)	899	1,2
Dollar de Hong Kong	316	(45)	271	0,3
Dollar néo-zélandais	175	(26)	149	0,2
<b>Total</b>	<b>76 983</b>	<b>(11 423)</b>	<b>65 560</b>	<b>84,6</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	40 023	(6 160)	33 863	46,7
Yen japonais	8 188	(1 244)	6 944	9,6
Euro	7 454	(1 161)	6 293	8,7
Couronne danoise	6 106	(931)	5 175	7,1
Franc suisse	4 745	(718)	4 027	5,6
Couronne suédoise	1 239	(191)	1 048	1,4
Dollar australien	886	(135)	751	1,0
Livre sterling	886	(138)	748	1,0
Dollar de Singapour	842	(127)	715	1,0
Couronne norvégienne	807	(123)	684	0,9
Dollar de Hong Kong	623	(94)	529	0,7
Dollar néo-zélandais	133	(20)	113	0,2
<b>Total</b>	<b>71 932</b>	<b>(11 042)</b>	<b>60 890</b>	<b>83,9</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 6 556 000 \$ (6 089 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	77 231	-	-	77 231
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	46	-	46
<b>Total</b>	<b>77 231</b>	<b>46</b>	<b>-</b>	<b>77 277</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	72 149	-	-	72 149
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	214	-	214
<b>Total</b>	<b>72 149</b>	<b>214</b>	<b>-</b>	<b>72 363</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB d'actions privilégiées CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	51 941	52 554
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	876	1 488
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	2	97
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	11
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	96	100
Intérêts à recevoir	11	31
Rabais sur frais à recevoir	15	15
	52 941	54 296
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	11	9
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	29	30
Frais d'administration à payer	4	5
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	22
Montant à payer pour le rachat de parts	-	92
Comptes créditeurs et charges à payer	15	17
	59	175
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>52 882</b>	<b>54 121</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
	Parts ordinaires	52 882	54 121	21,63	19,72	2 445 078

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 653	1 759
Intérêts aux fins des distributions	71	187
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	277	(160)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4 546	(1 810)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>6 547</b>	<b>(24)</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	5
Profit (perte) de change sur la trésorerie	7	(10)
Rabais sur frais	91	88
Autres revenus	1	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>99</b>	<b>84</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>6 646</b>	<b>60</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	173	188
Frais d'administration (note 5)	26	28
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	20	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	-	4
Taxe de vente harmonisée	9	13
<b>Total des charges</b>	<b>229</b>	<b>236</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>6 417</b>	<b>(176)</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	6 417	(176)	2,52	(0,06)	2 545 353	2 865 520

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB d'actions privilégiées CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	54 121	62 496	54 121	62 496
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 417	(176)	6 417	(176)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1 441)	(1 520)	(1 441)	(1 520)
Profits nets réalisés	-	(73)	-	(73)
Remboursement de capital	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 441)	(1 593)	(1 441)	(1 593)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 051	-	1 051
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(6 215)	(7 240)	(6 215)	(7 240)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(6 215)	(6 189)	(6 215)	(6 189)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(1 239)	(7 958)	(1 239)	(7 958)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	52 882	54 538	52 882	54 538

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 417	(176)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(277)	160
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4 546)	1 810
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(5)	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	20	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	10 365	3 361
Achat de placements et de dérivés	(10 583)	(3 257)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	4	7
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	20	33
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(5)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(1)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(2)	(1)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>1 412</b>	<b>1 934</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 441)	(1 593)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	110
Montant versé au rachat de parts rachetables	(588)	(871)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2 029)</b>	<b>(2 354)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	5	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(617)	(420)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	1 488	1 161
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>876</b>	<b>740</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	91	217
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 658	1 767
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.

# FNB d'actions privilégiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>ACTIONS ORDINAIRES</b>			
	29 621	AltaGas Ltd., privilégiées, série G, taux variable, perpétuelles	558 163	715 347	
	10 432	Artis REIT, privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	207 667	181 621	
	31 291	Banque de Montréal, privilégiées, série 29, taux variable, perpétuelles	630 388	778 520	
	22 609	Banque de Montréal, privilégiées, série 31, taux variable, perpétuelles	447 526	550 755	
	21 773	Banque de Montréal, privilégiées, série 33, taux variable, perpétuelles	490 408	520 375	
	45 552	BCE Inc., privilégiées, catégorie A, série 19, taux variable, perpétuelles	826 614	706 056	
	12 123	BCE Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	204 936	190 937	
	13 762	BCE Inc., privilégiées, série Z, taux variable, perpétuelles	237 629	240 835	
	86 243	BCE Inc., privilégiées, série AB, taux flottant, perpétuelles	1 451 407	1 485 967	
	72 662	BCE Inc., privilégiées, série AD, taux flottant, perpétuelles	1 224 820	1 236 707	
	20 197	BCE Inc., privilégiées, série AF, taux variable, perpétuelles	338 040	335 270	
	16 858	Brookfield Corp., 4,75%, privilégiées, série 17, perpétuelles	355 189	298 892	
	14 878	Brookfield Corp., 4,9%, privilégiées, série 37, perpétuelles	315 849	266 019	
	20 094	Brookfield Corp., privilégiées, série 2, taux flottant, perpétuelles	262 359	226 459	
	24 342	Brookfield Corp., privilégiées, série 13, taux flottant, perpétuelles	278 645	272 387	
	7 210	Brookfield Corp., privilégiées, série 28-A, taux variable, perpétuelles	111 059	121 777	
	19 134	Brookfield Corp., privilégiées, série 32, taux variable, perpétuelles	398 992	427 454	
	14 755	Brookfield Infrastructure Partners LP, privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	350 188	357 514	
	10 827	Brookfield Infrastructure Partners LP, privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	233 496	225 202	
	64 358	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série P, taux variable, perpétuelles	947 200	733 681	
	43 938	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	689 705	529 892	
	22 097	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série AA, taux variable, perpétuelles	333 499	296 321	
	24 561	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série CC, taux variable, perpétuelles	587 951	374 555	
	35 172	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série EE, taux variable, perpétuelles	727 977	450 553	
	13 052	Brookfield Office Properties Inc., privilégiées, série GG, taux variable, perpétuelles	270 922	192 909	
	41 248	Brookfield Renewable Partners LP, privilégiées, série 13, taux variable, perpétuelles	899 159	845 172	
	31 631	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, catégorie A, série « 41 », taux variable, perpétuelles	736 072	763 889	
	23 640	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, série 39, taux variable, perpétuelles	526 515	589 582	
	22 892	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, série 43, taux variable, perpétuelles	537 699	548 034	
	9 018	Banque Canadienne Impériale de Commerce, privilégiées, série 47, taux variable, perpétuelles	203 189	217 334	
	21 001	Canadian Utilities Ltd., 4,75 %, privilégiées, série HH, perpétuelles	486 890	395 449	
	21 471	Canadian Utilities Ltd., 4,9 %, privilégiées, série BB, perpétuelles	427 810	412 243	
	34 567	Capital Power Corp., privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	649 655	797 115	
	23 413	Capital Power Corp., privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	436 761	521 173	
	18 201	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	302 562	326 708	
	29 828	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	698 985	720 048	
	15 606	Cenovus Energy Inc., privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	318 030	370 799	
USD	16 415	Citigroup Capital XIII, privilégiées, taux variable	590 945	657 303	
	19 909	CU Inc., 4,6 %, privilégiées, série 1, perpétuelles	408 384	350 597	
	10 268	E-L Financial Corp., Ltd., 5,5 %, privilégiées, série 3, perpétuelles	251 700	215 525	
	20 014	Element Fleet Management Corp., privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	501 225	500 150	
	40 651	Emera Inc., 4,6 %, privilégiées, série L, perpétuelles	930 530	728 059	
USD	67 048	Enbridge Inc., privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	1 813 119	1 944 570	
	18 958	Enbridge Inc., privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	293 496	335 367	
	10 069	Enbridge Inc., privilégiées, série 9, taux variable, perpétuelles	170 040	181 141	
	20 955	Enbridge Inc., privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	400 254	368 598	
	41 062	Enbridge Inc., privilégiées, série D, taux variable, perpétuelles	650 896	718 174	
	31 400	Enbridge Inc., privilégiées, série G, taux flottant, perpétuelles	545 376	618 580	
USD	3 190	Enbridge Inc., privilégiées, série L, taux variable, perpétuelles	77 340	90 336	
	31 264	Enbridge Inc., privilégiées, série P, taux variable, perpétuelles	501 635	583 074	
	6 984	Enbridge Inc., privilégiées, série R, taux variable, perpétuelles	108 266	134 442	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'actions privilégiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>			
	13 943	Fortis Inc., 4,9 %, privilégiées, série F, perpétuelles	321 844	277 117	
	26 361	Fortis Inc., privilégiées, série M, taux variable, perpétuelles	517 501	522 739	
	10 141	George Weston Limitée, 5,2 %, privilégiées, série IV, perpétuelles	233 111	209 614	
	25 611	George Weston Limitée, 5,8 %, privilégiées, série I, perpétuelles	640 052	585 724	
	7 343	Great-West Lifeco Inc. 4,5 %, actions privilégiées, série Y, perpétuelles	175 020	130 779	
	19 009	Great-West Lifeco Inc., 4,85 %, privilégiées, série H, perpétuelles	424 677	366 874	
	22 787	Great-West Lifeco Inc., 5,15 %, privilégiées, série T, perpétuelles	525 921	452 550	
	33 132	Great-West Lifeco Inc., 5,2 %, privilégiées, série G, perpétuelles	772 422	673 905	
	15 424	Great-West Lifeco Inc., 5,25 %, privilégiées, série S, perpétuelles	366 455	311 565	
	16 287	Great-West Lifeco Inc., 5,4 %, privilégiées, série P, perpétuelles	355 152	345 284	
	11 401	Great-West Lifeco Inc., privilégiées, série N, taux variable, perpétuelles	164 019	168 735	
	8 697	Intact Corporation financière, 5,2 %, privilégiées, série 5, perpétuelles	203 653	186 551	
	6 993	Intact Corporation financière, 5,3 %, privilégiées, série 6, perpétuelles	174 347	152 797	
	10 944	Intact Corporation financière, 5,4 %, privilégiées, série 9, perpétuelles	267 292	245 966	
	34 221	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,3 %, privilégiées, série B, perpétuelles	846 777	749 440	
	40 864	Société Financière Manuvie, 4,65 %, privilégiées, série 2, perpétuelles	882 106	807 881	
	27 370	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 3, taux variable, perpétuelles	384 180	438 467	
	2 050	Société Financière Manuvie, privilégiées, catégorie 1, série 15, taux variable, perpétuelles	43 442	45 223	
	1 817	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 11, taux variable, perpétuelles	43 121	43 390	
	9 408	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 13, taux variable, perpétuelles	211 304	223 722	
	6 896	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 17, taux variable, perpétuelles	152 468	149 367	
	16 097	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 19, taux variable, perpétuelles	342 504	343 188	
	11 199	Société Financière Manuvie, privilégiées, série 25, taux variable, perpétuelles	242 873	263 400	
	14 179	Banque Nationale du Canada, privilégiées, série 32, taux variable, perpétuelles	258 688	314 065	
	23 338	Banque Nationale du Canada, privilégiées, série 42, taux variable, perpétuelles	493 669	599 553	
	33 454	Pembina Pipeline Corp., privilégiées, série 22, taux flottant, perpétuelles	765 661	778 140	
	36 784	Power Corporation du Canada, 5,6 %, privilégiées, série A, perpétuelles	898 134	786 810	
	8 575	Corporation Financière Power, 4,95 %, privilégiées, série K, perpétuelles	153 321	166 355	
	13 996	Corporation Financière Power, 5,15 %, privilégiées, série V, perpétuelles	315 431	277 541	
	23 708	Corporation Financière Power, 5,25 %, privilégiées, série E, perpétuelles	558 456	483 169	
	16 047	Corporation Financière Power, 5,75 %, privilégiées, série H, perpétuelles	395 177	352 553	
	32 108	Corporation Financière Power, privilégiées, série A, taux flottant, perpétuelles	422 147	422 060	
	19 596	Corporation Financière Power, privilégiées, série T, taux variable, perpétuelles	391 899	432 680	
	17 683	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BB, taux variable, perpétuelles	335 896	443 843	
	33 549	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BD, taux variable, perpétuelles	717 196	812 557	
	29 254	Banque Royale du Canada, privilégiées, série BF, taux variable, perpétuelles	587 553	686 884	
	16 805	Sagen MI Canada Inc., 5,4 %, privilégiées, série 1, perpétuelles	396 319	324 673	
	8 955	Financière Sun Life Inc., 4,45 %, privilégiées, catégorie A, série 3, perpétuelles	208 540	172 384	
	35 514	Financière Sun Life Inc., 4,45 %, privilégiées, série 4, perpétuelles	711 667	681 869	
	15 035	Financière Sun Life Inc., 4,5 %, privilégiées, catégorie A, série 5, perpétuelles	313 444	289 424	
	30 960	Financière Sun Life Inc., privilégiées, catégorie A, série 8R, taux variable, perpétuelles	440 953	533 750	
	31 081	Financière Sun Life Inc., privilégiées, catégorie A, série 10R, taux variable, perpétuelles	526 694	625 971	
	49 943	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	766 626	817 067	
	38 682	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	449 085	515 631	
	30 825	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	541 725	599 546	
	19 050	Corporation TC Énergie, privilégiées, série 9, taux variable, perpétuelles	313 948	348 044	
	32 463	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 1, taux variable, perpétuelles	704 504	796 967	
	29 776	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 3, taux variable, perpétuelles	591 141	749 164	
	35 160	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 5, taux variable, perpétuelles	787 719	843 840	
	25 432	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 7, taux variable, perpétuelles	562 089	617 998	
	21 754	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 18, taux variable, perpétuelles	474 189	535 366	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'actions privilégiées CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ACTIONS ORDINAIRES (suite)</b>					
	19 860	Banque Toronto-Dominion (La), privilégiées, série 24, taux variable, perpétuelles	484 319	501 465	
	45 061	TransAlta Corp., privilégiées, série C, taux variable, perpétuelles	703 173	829 122	
	36 369	TransAlta Corp., privilégiées, série E, taux variable, perpétuelles	657 841	777 206	
	9 914	TransAlta Corp., privilégiées, série G, taux variable, perpétuelles	191 364	225 643	
			50 355 971	50 685 085	95,8
<b>OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS</b>					
	358 000	Banque de Montréal, convertibles, taux variable, 26 avril 2028	358 019	362 775	
	300 000	Banque Royale du Canada, série BT, convertibles, taux variable, 24 février 2027	300 000	251 109	
	400 000	Banque Toronto-Dominion (La), série 27, convertibles, taux variable, 1er octobre 2027	400 000	371 416	
			1 058 019	985 300	1,9
<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>					
	26 628	FINB BMO échelonné actions privilégiées	264 679	270 940	0,5
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>51 678 669</b>	<b>51 941 325</b>	<b>98,2</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(71 104)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>51 607 565</b>	<b>51 941 325</b>	<b>98,2</b>
		Contrat(s) de change à terme		(9 080)	0,0
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>51 607 565</b>	<b>51 932 245</b>	<b>98,2</b>
		Autres actifs (passifs) nets		949 548	1,8
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>52 881 793</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque de Montréal	A-1	17 juillet 2024	CAD	134 920	USD	99 443	1,36	(1 078)
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	CAD	141 424	USD	103 328	1,37	205
Banque de Montréal	A-1	13 août 2024	USD	92 200	CAD	125 263	0,74	748
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	311 492	USD	227 122	1,37	1 081
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	13 août 2024	CAD	235 026	USD	172 213	1,36	(338)
Citibank N.A., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	134 930	USD	99 443	1,36	(1 068)
Citibank N.A., New York	A-1	13 août 2024	CAD	187 832	USD	137 770	1,36	(460)
Goldman Sachs & Co., New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	133 896	USD	99 443	1,35	(2 102)
Goldman Sachs International	A-1	13 août 2024	CAD	235 080	USD	172 213	1,37	(285)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	17 juillet 2024	CAD	67 374	USD	49 721	1,36	(625)
Morgan Stanley & Co., International PLC	A-1	17 juillet 2024	CAD	53 849	USD	39 777	1,35	(550)
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	141 382	USD	103 328	1,37	163
Morgan Stanley & Co. LLC, New York	A-1	13 août 2024	CAD	188 061	USD	137 770	1,37	(231)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	67 384	USD	49 721	1,36	(615)
Banque Royale du Canada	A-1+	17 juillet 2024	CAD	97 821	USD	72 224	1,35	(953)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 juillet 2024	CAD	133 851	USD	99 443	1,35	(2 147)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	13 août 2024	CAD	187 830	USD	137 770	1,36	(462)
Banque Toronto-Dominion (La)	A-1+	17 septembre 2024	USD	72 100	CAD	98 818	0,73	(363)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(9 080)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2</b>	<b>(1)</b>	<b>-</b>	<b>1</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(11)	1	-	(10)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(11)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>(10)</b>

au 31 décembre 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	97	(9)	-	88
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>97</b>	<b>(9)</b>	<b>-</b>	<b>88</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(9)	9	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(9)</b>	<b>9</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2024

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) (%)
FINB BMO échelonné actions privilégiées	1 442 581	271	-

au 31 décembre 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) (%)
FINB BMO échelonné actions privilégiées	1 503 222	557	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	20	1
Paielements indirects†	7	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	2 745 078	3 095 078
Parts rachetables émises	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(300 000)	(350 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	2 445 078	2 795 078

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Parts ordinaires	0,650	0,10

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	9
Charges	-	(4)
Revenu tiré des prêts de titres	-	5
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	44,0

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions ordinaires	91,2
Obligations de sociétés	4,9
Autres actifs (passifs) nets	2,7
Fonds négocié(s) en bourse	1,0
Contrat(s) de change à terme	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
A	14,0
BBB/Baa/B++	57,3
BB/Ba/B+	23,4
Aucune	3,0
<b>Total</b>	<b>97,7</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,1
AA/Aa/A+	0,1
A	13,6
BBB/Baa/B++	52,7
BB/Ba/B+	26,8
Aucune	3,0
<b>Total</b>	<b>96,3</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 5 096 000 \$ (4 992 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	2 893	(2 237)	656	1,2
<b>Total</b>	<b>2 893</b>	<b>(2 237)</b>	<b>656</b>	<b>1,2</b>

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	3 347	(2 520)	827	1,5
<b>Total</b>	<b>3 347</b>	<b>(2 520)</b>	<b>827</b>	<b>1,5</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 66 000 \$ (83 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an	1 - 3 ans	3 - 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	-	-	985	985

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an	1 - 3 ans	3 - 5 ans	Plus de 5 ans	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	-	-	2 633	2 633

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 32 000 \$ (83 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Actions	50 685	-	-	50 685
Obligations	-	985	-	985
Fonds négocié(s) en bourse	271	-	-	271
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(9)	-	(9)
<b>Total</b>	<b>50 956</b>	<b>976</b>	<b>-</b>	<b>51 932</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB d'actions privilégiées CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	49 364	-	-	49 364
Obligations	-	2 633	-	2 633
Fonds négocié(s) en bourse	-	-	-	557
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	88	-	88
<b>Total</b>	<b>49 921</b>	<b>2 721</b>	<b>-</b>	<b>52 642</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	17 032	20 607
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	11	12
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription d'actions	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	97	95
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	17 140	20 714
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	3	4
Frais d'administration à payer	1	1
Dividendes à payer aux porteurs d'actions rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat d'actions	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	6	9
	10	14
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	17 130	20 700

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par action et les actions en circulation)

	Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre d'actions rachetables en circulation :	
	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
	Actions FNB	17 130	20 700	18,03	18,00	950 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par action et le nombre d'actions)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	190	184
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	(161)	(441)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	147	455
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>176</b>	<b>198</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	3
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	4	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>6</b>	<b>4</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>182</b>	<b>202</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	19	21
Frais d'administration (note 5)	5	5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	2	3
<b>Total des charges</b>	<b>27</b>	<b>31</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	<b>155</b>	<b>171</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par action et le nombre d'actions)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables, par action :		Nombre moyen pondéré d'actions :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
	Actions FNB	155	171	0,18	0,18	844 231

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Actions FNB		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	20 700	19 466	20 700	19 466
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	155	171	155	171
<b>Dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>				
Revenu net de placement	-	-	-	-
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(140)	(174)	(140)	(174)
<b>Total des dividendes aux porteurs d'actions rachetables</b>	(140)	(174)	(140)	(174)
<b>Transactions sur actions rachetables</b>				
Produit de l'émission d'actions rachetables	3 582	-	3 582	-
Réinvestissement des dividendes aux porteurs d'actions rachetables	-	-	-	-
Rachat d'actions rachetables	(7 167)	(5 384)	(7 167)	(5 384)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur actions rachetables</b>	(3 585)	(5 384)	(3 585)	(5 384)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>	(3 570)	(5 387)	(3 570)	(5 387)
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	17 130	14 079	17 130	14 079

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables	155	171
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	161	441
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(147)	(455)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	1
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 688	5 287
Achat de placements et de dérivés	(4 582)	(4 899)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(2)	5
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(1)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(3)	4
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>269</b>	<b>554</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Dividendes versés aux porteurs d'actions rachetables, déduction faite des dividendes réinvestis	(140)	(174)
Produit de l'émission d'actions rachetables	241	-
Montant versé au rachat d'actions rachetables	(371)	(372)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(270)</b>	<b>(546)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	8
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	12	2
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>11</b>	<b>10</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	188	189
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.



# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES</b>				
200 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,1 %, 15 décembre 2026	189 448	186 996	
304 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,25 %, 15 juin 2026	289 390	288 362	
70 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,55 %, 15 décembre 2026	66 268	66 179	
233 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,9 %, 15 septembre 2026	231 189	222 940	
347 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 1,95 %, 15 décembre 2025	348 377	336 056	
334 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 2,35 %, 15 juin 2027	314 938	320 358	
310 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,6 %, 15 décembre 2027	311 467	308 095	
275 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,7 %, 15 juin 2029	276 944	274 876	
147 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,8 %, 15 juin 2027	146 838	146 898	
455 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 3,95 %, 15 juin 2028	456 528	458 370	
495 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, 4,25 %, 15 décembre 2028	509 746	505 670	
195 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	195 065	189 668	
205 000	Fiducie du Canada pour l'habitation no 1, série FEV., 2,65 %, 15 mars 2028	198 114	197 211	
780 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er mars 2026	728 918	733 429	
855 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1er septembre 2025	821 916	819 267	
730 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1er septembre 2026	696 120	687 382	
24 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1er juin 2027	21 944	22 291	
637 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1er mars 2027	603 349	597 773	
452 800	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er juin 2026	432 960	433 082	
261 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1er juin 2028	245 456	246 779	
312 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1er juin 2029	293 280	295 854	
506 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er septembre 2027	491 925	492 817	
915 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1er octobre 2025	892 732	901 385	
105 000	Gouvernement du Canada, 3 %, 1er avril 2026	103 048	103 245	
73 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 24 août 2027	71 810	72 163	
528 000	Gouvernement du Canada, 3,25 %, 1er septembre 2028	518 914	522 121	
320 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1er août 2025	316 427	317 205	
490 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1er mars 2028	489 515	488 571	
496 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mai 2026	493 954	496 033	
843 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1er mars 2029	859 049	860 501	
652 000	Gouvernement du Canada, 4,5 %, 1er février 2026	657 171	655 766	
		12 272 800	12 247 343	71,5
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES</b>				
107 000	Province de l'Alberta, 2,2 %, 1er juin 2026	106 801	103 390	
179 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 1er juin 2027	171 689	172 478	
82 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 1er décembre 2028	78 658	78 973	
50 000	Province de l'Alberta, 4,10 %, 1er juin 2029	51 098	50 625	
43 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,3 %, 18 juin 2026	42 350	41 609	
135 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	129 370	130 047	
286 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 décembre 2028	277 495	275 971	
59 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	59 546	57 370	
58 000	Province du Manitoba, 2,6 %, 2 juin 2027	55 710	55 941	
40 000	Province du Manitoba, 2,75 %, 2 juin 2029	37 696	38 060	
78 000	Province du Manitoba, 3 %, 2 juin 2028	75 177	75 590	
5 000	Province du Manitoba, 4,4 %, 5 septembre 2025	5 311	5 003	
32 000	Province du Nouveau-Brunswick, 1,8 %, 14 août 2025	30 419	31 116	
40 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	37 639	38 191	
44 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,6 %, 14 août 2026	44 699	42 726	
143 000	Province de l'Ontario, 1,05 %, 8 septembre 2027	128 776	131 099	
10 000	Province de l'Ontario, 1,35 %, 8 septembre 2026	9 372	9 450	
306 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	300 276	296 975	
127 000	Province de l'Ontario, 1,85 %, 1er février 2027	120 523	120 652	
353 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	344 495	342 393	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables du Fonds.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS PROVINCIALES (suite)</b>				
384 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2027	368 660	370 582	
268 000	Province de l'Ontario, 2,7 %, 2 juin 2029	252 263	254 675	
227 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2028	217 918	219 332	
232 000	Province de l'Ontario, 3,4 %, 8 septembre 2028	226 551	228 337	
176 000	Province de l'Ontario, 3,6 %, 8 mars 2028	175 795	174 509	
180 000	Province de l'Ontario, 4 %, 8 mars 2029	178 843	181 436	
211 000	Province de Québec, 2,5 %, 1er septembre 2026	208 463	204 508	
17 000	Province de Québec, 2,6 %, 6 juillet 2025	16 478	16 702	
241 000	Province de Québec, 2,75 %, 1er septembre 2025	246 744	236 754	
191 000	Province de Québec, 2,75 %, 1er septembre 2027	183 082	184 781	
312 000	Province de Québec, 2,75 %, 1er septembre 2028	295 566	299 356	
62 000	Province de Québec, 8,5 %, 1er avril 2026	74 503	66 494	
61 000	Province de Québec, série QY, 1,85 %, 13 février 2027	57 232	57 921	
41 000	Province de la Saskatchewan, 0,8 %, 2 septembre 2025	38 280	39 371	
59 000	Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	56 603	57 376	
40 000	Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	38 356	38 648	
		4 742 437	4 728 441	27,6
<b>OBLIGATIONS MUNICIPALES</b>				
58 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	58 385	56 358	0,3
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>		<b>17 073 622</b>	<b>17 032 142</b>	<b>99,4</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille		-	-	
<b>Total du portefeuille de placements</b>		<b>17 073 622</b>	<b>17 032 142</b>	<b>99,4</b>
Autres actifs (passifs) nets			97 708	0,6
<b>Actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables</b>			<b>17 129 850</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables du Fonds.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paielements indirects†	-	-

## Transactions sur actions rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Actions FNB	
	2024	2023
<b>Nombre d'actions rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 150 000	1 100 000
Actions rachetables émises	200 000	-
Actions rachetables émises aux fins du réinvestissement des dividendes	-	-
Actions rachetables rachetées	(400 000)	(300 000)
<b>Nombre d'actions rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	950 000	800 000

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Actions FNB	0,250	0,06

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	7 906	-
Garanties (hors trésorerie)	8 308	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	3	4
Charges	(1)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	2	3
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>29,9</b>	<b>30,1</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations d'état canadiennes	70,0
Obligations provinciales	29,2
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Obligations municipales	0,3
Total	100,0

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	71,8
AA/Aa/A+	27,6
Total	99,4

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	70,3
AA/Aa/A+	29,2
Total	99,5

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

### Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	10 078	6 954	-	17 032

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de taux d'intérêt (suite)

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	12 162	8 445	-	20 607

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs d'actions rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 114 000 \$ (135 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	17 032	-	17 032
Total	-	17 032	-	17 032

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	20 607	-	20 607
Total	-	20 607	-	20 607

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	558 974	517 615
Placements donnés en garantie	186 652	172 680
Trésorerie	420	884
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 699	9 008
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	39	98
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	3	2
	747 787	700 287
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	24	20
Swaps, options sur swaps et options	4 511	4 795
Frais de gestion à payer	401	380
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	-	12
Comptes créditeurs et charges à payer	45	76
	4 981	5 283
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>742 806</b>	<b>695 004</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires couvertes	645 425	618 848	21,99	19,31	29 350 997	32 050 997
Parts ordinaires couvertes en \$ US	14 191	11 369	11,53*	10,09*	900 000	850 000
Parts ordinaires non couvertes	83 190	64 787	27,28	23,14	3 050 000	2 800 000

\*L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, pour les parts ordinaires couvertes en \$ US est présenté en dollars américains.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 382	3 361
Intérêts aux fins des distributions	56	55
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	13 429	7 035
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	86 874	12 787
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	29 584	164 803
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>133 325</b>	<b>188 041</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	3	4
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(36)	(23)
Rabais sur frais	14	1
Autres revenus	27	1
<b>Total des autres revenus</b>	<b>8</b>	<b>(17)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>133 333</b>	<b>188 024</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	2 361	1 887
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	192	255
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	467	480
Taxe de vente harmonisée	212	177
<b>Total des charges</b>	<b>3 233</b>	<b>2 800</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>130 100</b>	<b>185 224</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	112 157	167 642	3,63	4,85	30 883 689	34 600 721
Parts ordinaires couvertes en \$ US	2 663	2 321	3,04	3,20	876 374	724 309
Parts ordinaires non couvertes	15 280	15 261	5,25	5,47	2 908 516	2 790 331

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	618 848	478 117	11 369	5 516	64 787	38 963	695 004	522 596
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	112 157	167 642	2 663	2 321	15 280	15 261	130 100	185 224
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>								
Revenu net de placement	(596)	(807)	(23)	(32)	(118)	(13)	(737)	(852)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(27 990)	(24 087)	(568)	(364)	(3 368)	(2 433)	(31 926)	(26 884)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(28 586)</b>	<b>(24 894)</b>	<b>(591)</b>	<b>(396)</b>	<b>(3 486)</b>	<b>(2 446)</b>	<b>(32 663)</b>	<b>(27 736)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>								
Produit de l'émission de parts rachetables	31 667	39 281	750	2 032	10 310	10 373	42 727	51 686
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(88 661)	(85 406)	-	(572)	(3 701)	(5 655)	(92 362)	(91 633)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>(56 994)</b>	<b>(46 125)</b>	<b>750</b>	<b>1 460</b>	<b>6 609</b>	<b>4 718</b>	<b>(49 635)</b>	<b>(39 947)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>26 577</b>	<b>96 623</b>	<b>2 822</b>	<b>3 385</b>	<b>18 403</b>	<b>17 533</b>	<b>47 802</b>	<b>117 541</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>645 425</b>	<b>574 740</b>	<b>14 191</b>	<b>8 901</b>	<b>83 190</b>	<b>56 496</b>	<b>742 806</b>	<b>640 137</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	130 100	185 224
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(86 874)	(12 787)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(29 584)	(164 803)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	192	255
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	256 550	283 685
Achat de placements et de dérivés	(238 912)	(264 000)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	59	59
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	20	35
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(31)	14
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>31 518</b>	<b>27 682</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(32 663)	(27 737)
Produit de l'émission de parts rachetables	288	108
Montant versé au rachat de parts rachetables	391	(131)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(31 984)</b>	<b>(27 760)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	2	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(466)	(78)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	884	851
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>420</b>	<b>773</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	56	55
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 974	2 940
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.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	70 230	Accenture PLC, catégorie A	28 956 626	29 151 072	
USD	40 834	Adobe Inc.	23 692 988	31 034 105	
USD	135 382	Advanced Micro Devices Inc.	19 384 333	30 042 808	
USD	94 374	Analog Devices Inc.	22 617 549	29 470 272	
USD	103 465	Apple Inc.	20 202 334	29 812 270	
USD	92 496	Applied Materials Inc.	13 702 262	29 861 975	
USD	64 837	Arista Networks Inc.	29 921 552	31 087 666	
USD	12 907	Broadcom Inc.	9 709 895	28 349 520	
USD	456 074	Cisco Systems Inc.	29 546 774	29 543 011	
USD	148 745	Dell Technologies Inc., catégorie C	29 551 446	28 063 388	
USD	698 027	Intel Corp.	35 249 062	29 574 363	
USD	126 571	International Business Machines Corp.	26 442 675	29 947 236	
USD	34 741	Intuit Inc.	21 040 513	31 235 499	
USD	26 578	KLA Corp.	20 772 569	29 979 211	
USD	20 770	Lam Research Corp.	18 362 838	30 257 072	
USD	156 683	Micron Technology Inc.	15 107 525	28 193 479	
USD	48 476	Microsoft Corp.	20 410 622	29 640 648	
USD	172 309	NVIDIA Corp.	5 619 128	29 121 754	
USD	154 321	Oracle Corp.	18 402 094	29 809 981	
USD	290	Palo Alto Networks Inc.	125 399	134 497	
USD	102 469	QUALCOMM Inc.	16 964 020	27 921 593	
USD	89 180	Salesforce Inc.	23 915 569	31 366 894	
USD	29 245	ServiceNow Inc.	19 543 993	31 473 582	
USD	55	Synopsys Inc.	45 618	44 774	
USD	110 797	Texas Instruments Inc.	25 285 526	29 486 047	
			494 572 910	684 702 717	92,2
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	121 023	Alphabet Inc., catégorie A	17 631 423	30 157 759	
USD	44 065	Meta Platforms Inc., catégorie A	13 617 033	30 395 957	
			31 248 456	60 553 716	8,2
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	125 159	Altaba Inc., entiercés	558 321	369 843	0,0
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>526 379 687</b>	<b>745 626 276</b>	<b>100,4</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(155 710)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>526 223 977</b>	<b>745 626 276</b>	<b>100,4</b>
		Contrat(s) de change à terme		1 675 381	0,2
		Position(s) vendeur sur option(s)		(4 511 448)	(0,6)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>526 223 977</b>	<b>742 790 209</b>	<b>100,0</b>
		Autres actifs (passifs) nets		16 219	0,0
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>742 806 428</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	684 384 590	USD	499 275 171	1,37	1 657 913
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 124 701	USD	821 696	1,37	1 084
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 090 270	USD	796 677	1,37	865
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	10 971 666	USD	8 040 927	1,36	(23 784)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	15 079 540	CAD	20 589 042	0,73	31 259
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	19 817 226	CAD	27 090 437	0,73	8 345
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	1 658 041	CAD	2 267 566	0,73	(301)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>1 675 381</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(176)	Accenture PLC, catégorie A, (option d'achat) – 310,00	100	19 juillet 2024	310,00	USD	(149 069)	(77 651)
(102)	Adobe Inc., (option d'achat) – 535,00	100	19 juillet 2024	535,00	USD	(191 824)	(364 202)
(340)	Advanced Micro Devices Inc., (option d'achat) – 165,00	100	19 juillet 2024	165,00	USD	(261 145)	(232 568)
(303)	Alphabet Inc., catégorie A, (option d'achat) – 185,00	100	19 juillet 2024	185,00	USD	(101 682)	(107 775)
(236)	Analog Devices Inc., (option d'achat) – 240,00	100	19 juillet 2024	240,00	USD	(81 784)	(35 515)
(259)	Apple Inc., (option d'achat) – 215,00	100	19 juillet 2024	215,00	USD	(104 654)	(91 239)
(232)	Applied Materials Inc., (option d'achat) – 240,00	100	19 juillet 2024	240,00	USD	(212 274)	(184 085)
(163)	Arista Networks Inc., (option d'achat) – 350,00	100	19 juillet 2024	350,00	USD	(157 525)	(257 556)
(32)	Broadcom Inc., (option d'achat) – 1 700,00	100	19 juillet 2024	1 700,00	USD	(295 992)	(137 462)
(1 145)	Cisco Systems Inc., (option d'achat) – 50,00	100	19 juillet 2024	50,00	USD	(23 525)	(10 182)
(379)	Dell Technologies Inc., catégorie C, (option d'achat) – 145,00	100	19 juillet 2024	145,00	USD	(388 306)	(160 732)
(1 753)	Intel Corp., (option d'achat) – 32,00	100	19 juillet 2024	32,00	USD	(194 491)	(133 100)
(317)	International Business Machines Corp., (option d'achat) – 175,00	100	19 juillet 2024	175,00	USD	(101 899)	(114 273)
(87)	Intuit Inc., (option d'achat) – 630,00	100	19 juillet 2024	630,00	USD	(169 964)	(372 533)
(66)	KLA Corp., (option d'achat) – 820,00	100	19 juillet 2024	820,00	USD	(274 641)	(274 937)
(52)	Lam Research Corp., (option d'achat) – 1 060,00	100	19 juillet 2024	1 060,00	USD	(260 187)	(279 930)
(110)	Meta Platforms Inc., catégorie A, (option d'achat) – 500,00	100	19 juillet 2024	500,00	USD	(196 909)	(256 202)
(393)	Micron Technology Inc., (option d'achat) – 140,00	100	19 juillet 2024	140,00	USD	(593 746)	(120 432)
(121)	Microsoft Corp., (option d'achat) – 450,00	100	19 juillet 2024	450,00	USD	(148 003)	(102 631)
(432)	NVIDIA Corp., (option d'achat) – 127,00	100	19 juillet 2024	127,00	USD	(440 223)	(248 219)
(387)	Oracle Corp., (option d'achat) – 145,00	100	19 juillet 2024	145,00	USD	(72 621)	(63 268)
(257)	Qualcomm Inc., (option d'achat) – 220,00	100	19 juillet 2024	220,00	USD	(145 384)	(36 565)
(224)	Salesforce Inc., (option d'achat) – 250,00	100	19 juillet 2024	250,00	USD	(123 648)	(317 935)
(73)	ServiceNow Inc., (option d'achat) – 750,00	100	19 juillet 2024	750,00	USD	(197 191)	(452 399)
(278)	Texas Instruments Inc., (option d'achat) – 200,00	100	19 juillet 2024	200,00	USD	(126 032)	(80 057)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(5 012 719)</b>	<b>(4 511 448)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	1 699	(24)	-	1 675
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1 699</b>	<b>(24)</b>	<b>-</b>	<b>1 675</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(24)	24	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(24)</b>	<b>24</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	9 008	(20)	-	8 988
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>9 008</b>	<b>(20)</b>	<b>-</b>	<b>8 988</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(20)	20	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(20)</b>	<b>20</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	192	242
Paielements indirects†	72	85

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires couvertes en \$ US		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	32 050 997	36 550 997	850 000	600 000	2 800 000	2 450 000
Parts rachetables émises	1 500 000	2 650 000	50 000	200 000	400 000	600 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(4 200 000)	(5 800 000)	-	(50 000)	(150 000)	(300 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>29 350 997</b>	<b>33 400 997</b>	<b>900 000</b>	<b>750 000</b>	<b>3 050 000</b>	<b>2 750 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires couvertes en \$ US	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	4	6
Charges	(1)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres	3	4
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>30,0</b>	<b>30,0</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Technologies de l'information	91,0
Services de communication	8,3
Contrat(s) de change à terme	1,3
Services financiers	0,1
Autres actifs (passifs) nets	0,0
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,7</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,7)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,7)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,3
<b>Total</b>	<b>1,3</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 74 563 000 \$ (69 030 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	762 201	(650 460)	111 741	15,0
<b>Total</b>	<b>762 201</b>	<b>(650 460)</b>	<b>111 741</b>	<b>15,0</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.



# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux	Dérivés	Exposition	Actif
	instruments financiers			
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	690 337	(608 951)	81 386	11,7
<b>Total</b>	<b>690 337</b>	<b>(608 951)</b>	<b>81 386</b>	<b>11,7</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 11 174 000 \$ (8 139 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Actions	745 256	-	370	745 626
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	1 675	-	1 675
<b>Total</b>	<b>745 256</b>	<b>1 675</b>	<b>370</b>	<b>747 301</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Option(s)	(4 511)	-	-	(4 511)
<b>Total</b>	<b>(4 511)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(4 511)</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Actions	689 937	-	358	690 295
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	8 988	-	8 988
<b>Total</b>	<b>689 937</b>	<b>8 988</b>	<b>358</b>	<b>699 283</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)
Option(s)	(4 795)	-	-	(4 795)
<b>Total</b>	<b>(4 795)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(4 795)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Niveau 3 - Rapprochement

Le ou les tableaux ci-dessous résument le mouvement des instruments financiers classés au niveau 3.

pour la période close le 30 juin 2024

	Solde au 31 décembre 2023 (en k\$)	Achats (en k\$)	Ventes (en k\$)	Transferts entrants (en k\$)	Transferts (sortants) (en k\$)	Profit (perte) latent(e) (en k\$)	Profit (perte) latent(e)* (en k\$)	Solde au 30 juin 2024 (en k\$)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Actions	358	-	-	-	-	-	12	370
<b>Total</b>	<b>358</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12</b>	<b>370</b>

\*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 30 juin 2024 s'est établie à 11 625 \$.

pour l'exercice clos le 31 décembre 2023

	Solde au 31 décembre 2022 (en k\$)	Achats (en k\$)	Ventes (en k\$)	Transferts entrants (en k\$)	Transferts (sortants) (en k\$)	Profit (perte) latent(e) (en k\$)	Profit (perte) latent(e)** (en k\$)	Solde au 31 décembre 2023 (en k\$)
<b>Position(s) acheteur/actifs :</b>								
Actions	644	-	(277)	-	-	8	(17)	358
<b>Total</b>	<b>644</b>	<b>-</b>	<b>(277)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8</b>	<b>(17)</b>	<b>358</b>

\*\*La variation des profits (pertes) latents des placements détenus au 31 décembre 2023 s'est établie à (16 912 \$).

Les placements classés au niveau 3 sont évalués à la juste valeur selon des hypothèses et des données non observables, qui peuvent comprendre des écarts de taux, des multiples sectoriels et des taux d'actualisation. Selon la direction, le fait de remplacer ces données par d'autres raisonnablement possibles n'aurait pas une incidence importante sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	72 855	60 091
Placements donnés en garantie	12 994	12 895
Trésorerie	349	323
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	147	772
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	86 345	74 081
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	13
Swaps, options sur swaps et options	215	224
Frais de gestion à payer	54	49
Frais d'administration à payer	8	8
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	-	15
	277	309
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>86 068</b>	<b>73 772</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	86 068	73 772	9,92	9,87	8 675 890	7 475 890

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 496	1 787
Intérêts aux fins des distributions	10	11
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	948	889
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	548	2 396
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	200	(6 700)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>3 202</b>	<b>(1 617)</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	1
Profit (perte) de change sur la trésorerie	15	3
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	15	15
<b>Total des autres revenus</b>	<b>31</b>	<b>19</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>3 233</b>	<b>(1 598)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	304	349
Frais d'administration (note 5)	48	55
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	50	78
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	135	155
Taxe de vente harmonisée	35	43
<b>Total des charges</b>	<b>573</b>	<b>681</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>2 660</b>	<b>(2 279)</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires						
Parts couvertes	2 660	(2 279)	0,33	(0,23)	8 069 022	9 810 420

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	73 772	99 620	73 772	99 620
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 660	(2 279)	2 660	(2 279)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(1 006)	(1 178)	(1 006)	(1 178)
Profits nets réalisés	(282)	(518)	(282)	(518)
Remboursement de capital	(1 570)	(1 790)	(1 570)	(1 790)
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>(2 858)</b>	<b>(3 486)</b>	<b>(2 858)</b>	<b>(3 486)</b>
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	22 491	4 639	22 491	4 639
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(9 997)	(9 484)	(9 997)	(9 484)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	<b>12 494</b>	<b>(4 845)</b>	<b>12 494</b>	<b>(4 845)</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>12 296</b>	<b>(10 610)</b>	<b>12 296</b>	<b>(10 610)</b>
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>86 068</b>	<b>89 010</b>	<b>86 068</b>	<b>89 010</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 660	(2 279)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(548)	(2 396)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(200)	6 700
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	50	78
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	16 502	24 048
Achat de placements et de dérivés	(15 654)	(22 564)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	5	(11)
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(14)	(11)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>2 801</b>	<b>3 563</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 858)	(3 486)
Produit de l'émission de parts rachetables	81	15
Montant versé au rachat de parts rachetables	2	(48)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(2 775)</b>	<b>(3 519)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	26	44
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	323	356
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>349</b>	<b>400</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	10	11
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 361	1 632
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.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		É.-U.			
USD	72 802	Aflac Inc.	7 147 313	8 894 988	
USD	51 089	Globe Life Inc.	6 639 554	5 750 739	
USD	220 602	Lincoln National Corp.	10 307 118	9 385 811	
USD	89 406	MetLife Inc.	7 916 082	8 585 071	
USD	77 885	Principal Financial Group Inc.	7 920 751	8 358 893	
USD	59 569	Prudential Financial Inc.	8 283 505	9 550 208	
USD	133 149	Unum Group	6 566 631	9 309 916	
			54 780 954	59 835 626	69,6
		<b>CANADA</b>			
	194 178	Great-West Lifeco Inc.	7 393 037	7 749 644	
	281 082	Société Financière Manuvie	7 777 464	10 239 817	
	119 613	Financière Sun Life inc.	7 923 086	8 023 640	
			23 093 587	26 013 101	30,2
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>77 874 541</b>	<b>85 848 727</b>	<b>99,8</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(93 374)		
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>77 781 167</b>	<b>85 848 727</b>	<b>99,8</b>
		Contrat(s) de change à terme		146 793	0,2
		Position(s) vendeur sur option(s)		(215 410)	(0,3)
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>77 781 167</b>	<b>85 780 110</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		287 472	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>86 067 582</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	60 737 075	USD	44 309 171	1,37	147 135
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	258 953	CAD	354 444	0,73	(342)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>146 793</b>

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Date d'expiration	Taille du lot par contrat	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste du contrat (\$)
(184)	Aflac Inc., (option d'achat) – 92,50	19 juillet 2024	100	92,50	USD	(12 097)	(18 250)
(129)	Globe Life Inc., (option d'achat) – 85,00	19 juillet 2024	100	85,00	USD	(44 532)	(30 001)
(490)	Great-West Lifeco Inc., (option d'achat) – 40,00	19 juillet 2024	100	40,00	CAD	(15 190)	(27 685)
(557)	Lincoln National Corp., (option d'achat) – 32,50	19 juillet 2024	100	32,50	USD	(41 198)	(17 145)
(710)	Société Financière Manuvie, (option d'achat) – 36,00	19 juillet 2024	100	36,00	CAD	(24 850)	(61 060)
(226)	MetLife Inc., (option d'achat) – 72,50	19 juillet 2024	100	72,50	USD	(24 771)	(12 367)
(150)	Prudential Financial Inc., (option d'achat) – 120,00	19 juillet 2024	100	120,00	USD	(24 449)	(18 469)
(302)	Financière Sun Life Inc., (option d'achat) – 68,00	19 juillet 2024	100	68,00	CAD	(11 174)	(14 345)
(336)	Unum Group, (option d'achat) – 52,50	19 juillet 2024	100	52,50	USD	(11 045)	(16 088)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(209 306)</b>	<b>(215 410)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	147	-	-	147
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>147</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>147</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	772	(13)	-	759
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>772</b>	<b>(13)</b>	<b>-</b>	<b>759</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(13)	13	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(13)</b>	<b>13</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	50	74
Paielements indirects†	19	26

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	7 475 890	9 975 890
Parts rachetables émises	2 200 000	500 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 000 000)	(1 000 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	8 675 890	9 475 890

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Frais de gestion et d'administration (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :	Taux des frais d'administration annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,750	0,12

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	7 052	-
Garanties (hors trésorerie)	7 468	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	1
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	1
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>31,7</b>	<b>35,7</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
É.-U.	66,2
Canada	32,8
Contrat(s) de change à terme	1,0
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,3</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,3)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,3)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	1,0
<b>Total</b>	<b>1,0</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis et au Canada.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 8 585 000 \$ (7 299 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	59 837	(60 348)	(511)	(0,6)
<b>Total</b>	<b>59 837</b>	<b>(60 348)</b>	<b>(511)</b>	<b>(0,6)</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite) au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	48 779	(48 237)	542	0,7
<b>Total</b>	<b>48 779</b>	<b>(48 237)</b>	<b>542</b>	<b>0,7</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 51 000 \$ (54 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	85 849	-	-	85 849
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	147	-	147
<b>Total</b>	<b>85 849</b>	<b>147</b>	<b>-</b>	<b>85 996</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(215)	-	-	(215)
<b>Total</b>	<b>(215)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(215)</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	72 986	-	-	72 986
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	759	-	759
<b>Total</b>	<b>72 986</b>	<b>759</b>	<b>-</b>	<b>73 745</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(224)	-	-	(224)
<b>Total</b>	<b>(224)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(224)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	126 213	89 609
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	453	224
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	7	7
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	8	6
	126 681	89 846
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	17	12
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	4	23
	21	35
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>126 660</b>	<b>89 811</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires non couvertes	126 660	89 811	26,12	22,18	4 850 000	4 050 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	968	176
Intérêts aux fins des distributions	4	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	4 146	58
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	12 418	1 263
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>17 536</b>	<b>1 497</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	1	-
Rabais sur frais	44	3
Autres revenus	18	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>64</b>	<b>3</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>17 600</b>	<b>1 500</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	90	6
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	3
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	10	1
Taxe de vente harmonisée	4	1
<b>Total des charges</b>	<b>106</b>	<b>12</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>17 494</b>	<b>1 488</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires non couvertes	17 494	1 488	3,77	3,38	4 635 440	440 055

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	89 811	2 696	89 811	2 696
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	17 494	1 488	17 494	1 488
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(365)	(1)	(365)	(1)
Profits nets réalisés	(73)	(2)	(73)	(2)
Remboursement de capital	(18)	-	(18)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(456)	(3)	(456)	(3)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	50 116	72 948	50 116	72 948
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(30 305)	-	(30 305)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	19 811	72 948	19 811	72 948
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	36 849	74 433	36 849	74 433
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	126 660	77 129	126 660	77 129

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	17 494	1 488
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(4 146)	(58)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(12 418)	(1 263)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	3
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	907	263
Achat de placements et de dérivés	(1 194)	(743)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	(3)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	5	4
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(20)	2
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>629</b>	<b>(307)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(456)	(4)
Produit de l'émission de parts rachetables	528	558
Montant versé au rachat de parts rachetables	(472)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(400)</b>	<b>554</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	229	247
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	224	14
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>453</b>	<b>261</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	958	172
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.



# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE</b>			
	4 461 456	FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	98 396 360	117 202 449	92,6
		<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>			
USD	223	A. O. Smith Corp.	22 771	24 955	
USD	115	AAON Inc.	14 145	13 728	
USD	57	Acuity Brands Inc.	14 559	18 831	
USD	123	Advanced Drainage Systems Inc.	21 524	26 995	
USD	250	AECOM	29 628	30 152	
USD	115	AGCO Corp.	19 234	15 402	
USD	196	Air Lease Corp.	11 530	12 747	
USD	237	Alaska Air Group Inc.	14 882	13 102	
USD	162	Allegion PLC	26 398	26 191	
USD	161	Allison Transmission Holdings Inc.	16 486	16 721	
USD	1 201	American Airlines Group Inc.	25 486	18 620	
USD	322	Groupe API Corp.	13 686	16 580	
USD	70	Applied Industrial Technologies Inc.	14 464	18 582	
USD	82	ASGN Inc.	8 937	9 893	
USD	68	Atkore Inc.	14 958	12 555	
USD	32	Avis Budget Group Inc.	8 239	4 577	
USD	264	AZEK Co., Inc. (The)	16 585	15 219	
USD	169	BWX Technologies Inc.	17 872	21 969	
USD	213	C.H. Robinson Worldwide Inc.	25 322	25 683	
USD	41	CACI International Inc., catégorie A	18 771	24 131	
USD	77	Chart Industries Inc.	15 582	15 208	
USD	637	Clarivate Analytics PLC	7 105	4 960	
USD	98	Clean Harbors Inc.	22 597	30 326	
USD	1 527	CNH Industrial NV	24 473	21 166	
USD	65	Comfort Systems USA Inc.	19 809	27 049	
USD	84	Concentrix Corp.	8 817	7 273	
USD	197	Core & Main Inc., catégorie A	11 011	13 193	
USD	89	Crane Co.	15 439	17 656	
USD	70	Curtiss-Wright Corp.	18 455	25 956	
USD	222	Donaldson Co., Inc.	19 631	21 738	
USD	512	Dun & Bradstreet Holdings Inc.	7 452	6 488	
USD	86	EMCOR Group Inc.	26 045	42 963	
USD	105	Esab Corp.	14 883	13 567	
USD	295	Exlservice Holdings Inc.	12 045	12 659	
USD	98	Exponent Inc.	12 285	12 755	
USD	242	Flowserve Corp.	12 959	15 928	
USD	311	Fluor Corp.	17 076	18 533	
USD	232	Fortune Brands Home & Security Inc.	22 317	20 616	
USD	184	FTAI Aviation Ltd.	19 959	25 991	
USD	64	FTI Consulting Inc.	16 709	18 875	
USD	63	GATX Corp.	10 486	11 410	
USD	111	Generac Holdings Inc.	18 512	20 082	
USD	309	Genpact Ltd.	15 189	13 611	
USD	309	Graco Inc.	35 692	33 521	
USD	216	GXO Logistics Inc.	16 672	14 926	
USD	155	Hexcel Corp.	14 888	13 245	
USD	72	Huntington Ingalls Industries Inc.	22 928	24 269	
USD	65	Insperty Inc.	9 851	8 112	
USD	151	ITT Inc.	21 107	26 691	
USD	620	Joby Aviation Inc.	5 936	4 327	
USD	247	KBR Inc.	20 954	21 678	
USD	292	Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	20 952	19 946	
USD	65	Landstar System Inc.	16 181	16 408	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>					
USD	252	Leidos Holdings Inc.	34 605	50 304	
USD	105	Lincoln Electric Holdings Inc.	29 280	27 103	
USD	660	Lyft Inc., catégorie A	11 971	12 734	
USD	87	ManpowerGroup Inc.	8 980	8 309	
USD	402	Masco Corp.	33 513	36 674	
USD	116	MasTec Inc.	16 277	16 982	
USD	112	Maximus Inc.	12 583	13 134	
USD	354	MDU Resources Group Inc.	10 262	12 158	
USD	98	Middleby Corp. (The)	19 008	16 442	
USD	68	MSA Safety Inc.	15 473	17 464	
USD	80	MSC Industrial Direct Co., Inc., catégorie A	10 383	8 682	
USD	212	Nextracker Inc.	13 564	13 599	
USD	305	nVent Electric PLC	23 756	31 973	
USD	121	Oshkosh Corp.	15 723	17 915	
USD	160	Owens Corning	29 400	38 034	
USD	75	Parsons Corp.	5 758	8 396	
USD	98	Paycom Software Inc.	23 246	19 181	
USD	80	Paylocity Holding Corp.	19 196	14 433	
USD	305	Pentair PLC	28 367	31 997	
USD	48	RBC Bearings Inc.	14 531	17 719	
USD	122	Regal Rexnord Corp.	25 685	22 573	
USD	196	Robert Half International Inc.	19 606	17 159	
USD	48	Saia Inc.	25 374	31 152	
USD	98	Science Applications International Corp.	15 176	15 763	
USD	277	Sensata Technologies Holding PLC	15 634	14 172	
USD	78	Simpson Manufacturing Co., Inc.	16 665	17 987	
USD	81	SiteOne Landscape Supply Inc.	17 922	13 457	
USD	92	Snap-On Inc.	34 022	32 906	
USD	171	Stericycle Inc.	10 925	13 602	
USD	65	Symbotic Inc.	4 008	3 127	
USD	99	Tetra Tech Inc.	22 891	27 700	
USD	350	Textron Inc.	35 713	41 121	
USD	117	Timken Co. (The)	13 355	12 829	
USD	196	Toro Co. (The)	25 006	25 079	
USD	201	Trex Co., Inc.	19 849	20 386	
USD	58	TriNet Group Inc.	8 124	7 936	
USD	112	UFP Industries Inc.	15 070	17 165	
USD	185	U-Haul Holding Co.	13 537	15 194	
USD	16	U-Haul Holding Co.	1 220	1 351	
USD	37	Valmont Industries Inc.	13 284	13 895	
USD	63	Watsco Inc.	32 283	39 934	
USD	49	Watts Water Technologies Inc., catégorie A	12 632	12 295	
USD	81	WESCO International Inc.	17 938	17 570	
USD	343	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	20 791	17 666	
USD	112	Woodward Governor Co.	19 833	26 725	
USD	210	XPO Logistics Inc.	21 591	30 503	
			1 763 484	1 890 239	1,5

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	662	ADT Inc.	5 822	6 884	
USD	108	Amer Sports Inc.	2 151	1 858	
USD	458	Aramark	22 785	21 320	
USD	38	Asbury Automotive Group Inc.	11 467	11 849	
USD	136	Autoliv Inc.	18 066	19 910	
USD	48	AutoNation Inc.	9 812	10 468	
USD	418	Bath & Body Works Inc.	23 336	22 335	
USD	56	Birkenstock Holding PLC	3 462	4 169	
USD	422	BorgWarner Inc.	23 955	18 617	
USD	128	Boyd Gaming Corp.	11 152	9 651	
USD	107	Bright Horizons Family Solutions Inc.	14 305	16 117	
USD	127	Brunswick Corp.	14 707	12 646	
USD	120	Burlington Stores Inc.	28 545	39 408	
USD	380	Caesars Entertainment Inc.	23 285	20 664	
USD	210	Capri Holdings Ltd.	11 197	9 506	
USD	292	CarMax Inc.	31 182	29 304	
USD	180	Carvana Co.	12 796	31 704	
USD	88	Groupe CAVA Inc.	8 230	11 168	
USD	248	Chewy Inc.	6 231	9 244	
USD	56	Choice Hotels International Inc.	8 820	9 119	
USD	128	Churchill Downs Inc.	22 221	24 451	
USD	63	Columbia Sportswear Co.	6 508	6 817	
USD	111	Crocs Inc.	17 957	22 166	
USD	105	Dick's Sporting Goods Inc.	20 858	30 869	
USD	15	Dillard's Inc., catégorie A	7 212	9 039	
USD	65	Domino's Pizza Inc.	32 151	45 925	
USD	67	Duolingo Inc.	15 912	19 131	
USD	152	Dutch Bros Inc., catégorie A	5 924	8 611	
USD	220	Etsy Inc.	22 968	17 755	
USD	101	Five Below Inc.	24 458	15 060	
USD	195	Floor & Decor Holdings Inc., catégorie A	27 871	26 525	
USD	497	GameStop Corp., catégorie A	13 949	16 791	
USD	365	The Gap Inc.	10 853	11 932	
USD	431	Gentex Corp.	17 913	19 881	
USD	255	H&R Block Inc.	13 112	18 922	
USD	235	Harley-Davidson Inc.	11 566	10 785	
USD	237	Hasbro Inc.	19 401	18 972	
USD	80	Hyatt Hotels Corp., catégorie A	13 343	16 630	
USD	44	Installed Building Products Inc.	14 760	12 383	
USD	195	International Game Technology PLC	7 404	5 459	
USD	105	Lear Corp.	19 786	16 409	
USD	183	Levi Strauss & Co., catégorie A	4 068	4 828	
USD	166	Light & Wonder Inc.	17 255	23 823	
USD	49	Lithia Motors Inc., catégorie A	18 653	16 927	
USD	468	LKQ Corp.	33 113	26 634	
USD	1 553	Lucid Group Inc.	6 372	5 546	
USD	453	Macy's Inc.	10 429	11 901	
USD	631	Mattel Inc.	16 010	14 039	
USD	66	Meritage Homes Corp.	14 037	14 617	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRETIONNAIRE (suite)</b>					
USD	98	Mohawk Industries Inc.	14 501	15 232	
USD	35	Murphy USA Inc.	15 279	22 484	
USD	783	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	20 110	20 132	
USD	34	Penske Automotive Group Inc.	7 209	6 933	
USD	161	Planet Fitness Inc., catégorie A	14 282	16 212	
USD	99	Polaris Inc.	14 570	10 608	
USD	107	PVH Corp.	14 270	15 501	
USD	72	Ralph Lauren Corp.	13 342	17 247	
USD	28	RH	11 073	9 365	
USD	1 244	Rivian Automotive Inc., catégorie A	17 482	22 844	
USD	265	Service Corp., International	24 073	25 793	
USD	91	SharkNinja Inc.	6 095	9 358	
USD	78	Signet Jewelers Ltd.	10 269	9 561	
USD	245	Skechers USA Inc., catégorie A	18 096	23 172	
USD	420	Tapestry Inc.	24 423	24 592	
USD	303	Tempur Sealy International Inc.	17 984	19 628	
USD	123	Texas Roadhouse Inc., catégorie A	20 625	28 900	
USD	99	Thor Industries Inc.	13 236	12 659	
USD	196	Toll Brothers Inc.	23 963	30 891	
USD	58	TopBuild Corp.	22 875	30 577	
USD	680	VF Corp.	15 953	12 561	
USD	70	Vail Resorts Inc.	22 272	17 254	
USD	169	Wayfair Inc., catégorie A	13 348	12 194	
USD	317	Wendy's Co. (The)	8 773	7 357	
USD	99	Whirlpool Corp.	17 423	13 845	
USD	54	Wingstop Inc.	18 095	31 231	
USD	145	Wyndham Hotels & Resorts Inc.	13 741	14 682	
USD	177	Wynn Resorts Ltd.	24 145	21 677	
			1 214 877	1 311 259	1,0
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	60	Affiliated Managers Group Inc.	12 102	12 827	
USD	453	Affirm Holdings Inc.	24 945	18 726	
USD	1 280	AGNC Investment Corp.	17 067	16 709	
USD	500	Ally Financial Inc.	21 655	27 141	
USD	132	American Financial Group Inc.	21 522	22 220	
USD	907	Annaly Capital Management Inc.	24 590	23 655	
USD	92	Assurant Inc.	17 988	20 929	
USD	142	Axis Capital Holdings Ltd.	11 020	13 728	
USD	196	Bank OZK	10 827	10 996	
USD	43	BOK Financial Corp.	4 844	5 392	
USD	402	Carlyle Group Inc. (The)	20 108	22 086	
USD	41	CNA Financial Corp.	2 205	2 585	
USD	242	Comerica Inc.	15 021	16 901	
USD	220	Commerce Bancshares Inc.	14 905	16 792	
USD	434	Corebridge Financial Inc.	13 308	17 293	
USD	15	Credit Acceptance Corp.	9 684	10 564	
USD	110	Cullen/Frost Bankers Inc.	15 812	15 297	
USD	156	DLocal Ltd. of Uruguay	2 977	1 727	
USD	259	East West Bancorp Inc.	21 200	25 953	
USD	608	Equitable Holdings Inc.	24 871	33 994	
USD	198	Essent Group Ltd.	13 179	15 224	
USD	80	Euronet Worldwide Inc.	11 805	11 330	
USD	66	Evercore Inc., catégorie A	12 466	18 824	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>SERVICES FINANCIERS (suite)</b>			
USD	479	Fidelity National Financial Inc.	26 289	32 392	
USD	183	First American Financial Corp.	14 054	13 510	
USD	221	First Financial Bankshares Inc.	8 959	8 930	
USD	1 026	First Horizon National Corp.	17 882	22 140	
USD	209	Glacier Bancorp Inc.	9 893	10 673	
USD	172	Globe Life Inc.	24 795	19 365	
USD	65	Hanover Insurance Group Inc.	10 298	11 157	
USD	92	Houlihan Lokey Inc.	12 829	16 977	
USD	606	Invesco Ltd.	13 348	12 405	
USD	134	Jack Henry & Associates Inc.	29 446	30 441	
USD	239	Janus Henderson Group PLC	9 367	11 024	
USD	331	Jefferies Financial Group Inc.	16 370	22 538	
USD	1 724	KeyCorp	29 869	33 522	
USD	41	Kinsale Capital Group Inc.	21 724	21 615	
USD	202	Lazard Inc.	9 490	10 553	
USD	310	Lincoln National Corp.	11 387	13 192	
USD	69	MarketAxess Holdings Inc.	23 351	18 933	
USD	48	Morningstar Inc.	14 539	19 432	
USD	575	Old National Bancorp	11 677	13 525	
USD	479	Old Republic International Corp.	17 226	20 253	
USD	221	OneMain Holdings Inc.	13 325	14 664	
USD	141	Pinnacle Financial Partners Inc.	12 555	15 443	
USD	131	Popular Inc.	12 355	15 851	
USD	65	Primerica Inc.	17 859	21 042	
USD	167	Prosperity Bancshares Inc.	13 463	13 971	
USD	122	Reinsurance Group of America Inc.	26 071	34 268	
USD	92	RenaissanceRe Holdings Ltd.	24 749	28 136	
USD	890	Rithm Capital Corp.	11 813	13 287	
USD	76	RLI Corp.	13 785	14 631	
USD	906	Robinhood Markets Inc., catégorie A	16 080	28 154	
USD	178	Ryan Specialty Holdings Inc.	11 265	14 105	
USD	184	SEI Investments Co.	15 446	16 287	
USD	112	Selective Insurance Group Inc.	14 784	14 380	
USD	112	Shift4 Payments Inc., catégorie A	9 596	11 241	
USD	1 729	SoFi Technologies Inc.	18 594	15 639	
USD	139	South State Corp.	13 601	14 535	
USD	549	Starwood Property Trust Inc.	14 437	14 228	
USD	181	Stifel Financial Corp.	15 839	20 842	
USD	269	Synovus Financial Corp.	12 108	14 793	
USD	99	TFS Financial Corp.	1 689	1 710	
USD	704	Toast Inc., catégorie A	21 083	24 825	
USD	152	TPG Inc.	7 388	8 621	
USD	240	United Bankshares Inc.	10 261	10 653	
USD	358	Unum Group	22 994	25 037	
USD	158	UWM Holdings Corp.	1 311	1 498	
USD	792	Valley National Bancorp	8 586	7 565	
USD	197	Voya Financial Inc.	18 834	19 180	
USD	315	Webster Financial Corp.	17 867	18 789	
USD	200	Western Alliance Bancorp	12 887	17 192	
USD	630	Western Union Co. (The)	10 510	10 534	
USD	73	WEX Inc.	19 223	17 694	
USD	113	Wintrust Financial Corp.	12 275	15 240	
USD	267	Zions Bancorporation NA	11 974	15 845	
			1 141 501	1 273 350	1,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	109	Allegro Microsystems Inc.	5 204	4 212	
USD	103	Altair Engineering Inc.	10 764	13 823	
USD	210	Amkor Technology Inc.	8 011	11 500	
USD	35	Appfolio Inc., catégorie A	9 047	11 713	
USD	100	Arrow Electronics Inc.	17 761	16 524	
USD	186	Bill.com Holdings Inc.	23 812	13 392	
USD	354	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc.	5 302	5 382	
USD	275	Ceridian HCM Holding Inc.	24 626	18 664	
USD	266	Ciena Corp.	16 341	17 537	
USD	317	Cognex Corp.	21 670	20 283	
USD	242	Coherent Corp.	17 169	23 994	
USD	412	Confluent Inc., catégorie A	17 132	16 648	
USD	370	DocuSign Inc.	26 956	27 086	
USD	110	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	12 259	11 926	
USD	215	DoubleVerify Holdings Inc.	9 380	5 728	
USD	472	Dropbox Inc., catégorie A	16 030	14 512	
USD	335	DXC Technology Co.	10 970	8 751	
USD	487	Dynatrace Inc.	32 603	29 814	
USD	152	Elastic N.V.	16 420	23 692	
USD	109	F5 Inc.	23 589	25 688	
USD	66	Fabrinet	14 944	22 107	
USD	133	Five9 Inc.	12 871	8 026	
USD	779	Flex Ltd.	28 688	31 435	
USD	325	Freshworks Inc., catégorie A	7 924	5 643	
USD	1 146	Gen Digital Inc.	30 785	39 172	
USD	200	Gitlab Inc., catégorie A	14 324	13 607	
USD	77	Globant SA	19 054	18 782	
USD	245	GoDaddy Inc., catégorie A	30 024	46 838	
USD	142	Guidewire Software Inc.	16 844	26 793	
USD	227	HashiCorp Inc., catégorie A	8 379	10 465	
USD	88	Informatica Inc., catégorie A	2 759	3 718	
USD	53	IPG Photonics Corp.	8 480	6 120	
USD	585	Juniper Networks Inc.	26 026	29 186	
USD	118	Klaviyo Inc., série A	4 023	4 019	
USD	252	Lattice Semiconductor Corp.	28 402	19 996	
USD	46	Littelfuse Inc.	16 166	16 088	
USD	104	MACOM Technology Solutions Holdings Inc.	11 686	15 863	
USD	113	Manhattan Associates Inc.	31 289	38 143	
USD	114	MKS Instruments Inc.	16 913	20 369	
USD	66	Novanta Inc.	14 958	14 731	
USD	449	Nutanix Inc., catégorie A	25 172	34 928	
USD	90	Onto Innovation Inc.	16 796	27 039	
USD	150	Procure Technologies Inc.	14 003	13 610	
USD	566	Pure Storage Inc., catégorie A	32 477	49 731	
USD	178	Qorvo Inc.	24 931	28 263	
USD	67	Qualys Inc.	12 535	13 073	
USD	201	Rambus Inc.	15 083	16 161	
USD	474	SentinelOne Inc., catégorie A	12 091	13 653	
USD	58	Silicon Laboratories Inc.	11 400	8 780	
USD	244	Smartsheet Inc., catégorie A	13 460	14 717	
USD	106	SolarEdge Technologies Inc.	9 749	3 664	
USD	68	SPS Commerce Inc.	16 532	17 508	
USD	71	Synaptics Inc.	8 579	8 569	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)</b>					
USD	137	TD SYNnex Corp.	19 804	21 633	
USD	215	Tenable Holdings Inc.	12 538	12 821	
USD	334	Twilio Inc.	28 430	25 964	
USD	719	UiPath Inc., catégorie A	17 920	12 475	
USD	456	Unity Software Inc.	21 455	10 146	
USD	80	Universal Display Corp.	15 942	23 016	
USD	283	Vontier Corp.	15 648	14 793	
			1 014 130	1 082 514	0,8
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	181	10X Genomics Inc., catégorie A	11 483	4 817	
USD	165	Acadia Healthcare Co., Inc.	16 346	15 249	
USD	188	Apellis Pharmaceuticals Inc.	18 310	9 868	
USD	75	Bausch + Lomb Corp.	1 834	1 490	
USD	37	Bio-Rad Laboratories Inc., catégorie A	17 023	13 827	
USD	293	Bio-Techne Corp.	30 348	28 726	
USD	199	Bridgebio Pharma Inc.	8 645	6 897	
USD	166	Bruker Corp.	17 571	14 494	
USD	333	Catalent Inc.	21 531	25 622	
USD	139	Cerevel Therapeutics Holdings Inc.	7 845	7 777	
USD	99	Charles River Laboratories International Inc.	29 539	27 985	
USD	28	Chemed Corp.	20 544	20 788	
USD	16	CorVel Corp.	4 525	5 567	
USD	189	Cytokinetics Inc.	18 676	14 012	
USD	101	DaVita Inc.	15 189	19 151	
USD	382	Dentsply Sirona Inc.	18 954	13 021	
USD	221	Doximity Inc., catégorie A	8 839	8 458	
USD	906	Elanco Animal Health Inc.	15 052	17 889	
USD	182	Encompass Health Corp.	17 035	21 365	
USD	101	Ensign Group Inc. (The)	14 043	17 094	
USD	317	Envista Holdings Corp.	12 186	7 214	
USD	332	Exact Sciences Corp.	35 577	19 194	
USD	502	Exelixis Inc.	13 771	15 435	
USD	249	Globus Medical Inc., catégorie A	18 610	23 336	
USD	233	Halozyne Therapeutics Inc.	11 796	16 694	
USD	156	HealthEquity Inc.	14 323	18 401	
USD	240	Henry Schein Inc.	24 426	21 051	
USD	104	Immunovant Inc.	4 734	3 757	
USD	53	Inspire Medical Systems Inc.	19 501	9 706	
USD	129	Insulet Corp.	31 196	35 621	
USD	164	Intra-Cellular Therapies Inc.	14 068	15 370	
USD	263	Ionis Pharmaceuticals Inc.	14 532	17 152	
USD	113	Jazz Pharmaceuticals PLC	18 948	16 503	
USD	125	Lantheus Holdings Inc.	13 108	13 733	
USD	81	Masimo Corp.	16 255	13 959	
USD	43	Medpace Holdings Inc.	15 638	24 233	
USD	203	Natera Inc.	18 366	30 080	
USD	179	Neurocrine Biosciences Inc.	26 761	33 720	
USD	321	Option Care Health Inc.	13 422	12 167	
USD	472	Organon & Co.	12 857	13 369	
USD	67	Penumbra Inc.	26 370	16 500	
USD	249	Perrigo Co., PLC	11 054	8 750	
USD	409	QIAGEN NV	25 193	22 996	
USD	270	R1 RCM Inc.	5 392	4 640	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SOINS DE SANTÉ (suite)</b>					
USD	92	Repligen Corp.	20 441	15 869	
USD	820	Roivant Sciences Ltd.	11 015	11 860	
USD	162	Sarepta Therapeutics Inc.	27 256	35 024	
USD	86	Teleflex Inc.	24 751	24 751	
USD	185	Tenet Healthcare Corp.	21 608	33 676	
USD	85	United Therapeutics Corp.	26 257	37 051	
USD	100	Universal Health Services Inc., catégorie B	21 184	25 305	
USD	197	Vaxcyte Inc.	17 567	20 355	
USD	172	Viking Therapeutics Inc.	18 588	12 476	
			920 083	924 045	0,7
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	182	Agree Realty Corp.	15 205	15 426	
USD	615	American Homes 4 Rent, catégorie A	29 381	31 271	
USD	524	Americold Realty Trust Inc.	20 617	18 313	
USD	266	Boston Properties Inc.	20 637	22 407	
USD	552	Brixmor Property Group Inc.	16 223	17 441	
USD	200	Camden Property Trust	26 343	29 860	
USD	413	CubeSmart	24 388	25 527	
USD	87	EastGroup Properties Inc.	20 188	20 250	
USD	328	Equity Lifestyle Properties Inc.	29 236	29 232	
USD	137	Federal Realty Investment Trust	17 926	18 928	
USD	242	First Industrial Realty Trust Inc.	16 764	15 732	
USD	486	Gaming and Leisure Properties Inc.	30 899	30 065	
USD	701	Healthcare Realty Trust Inc.	16 402	15 808	
USD	1 300	Host Hotels & Resorts Inc.	31 316	31 984	
USD	85	Jones Lang LaSalle Inc.	18 735	23 876	
USD	215	Kilroy Realty Corp.	9 482	9 170	
USD	1 212	Kimco Realty Corp.	31 357	32 273	
USD	161	Lamar Advertising Co., catégorie A	22 239	26 333	
USD	337	National Retail Properties Inc.	19 067	19 644	
USD	132	National Storage Affiliates Trust	6 455	7 445	
USD	452	Omega Healthcare Investors Inc.	18 856	21 183	
USD	226	Rayonier Inc.	9 419	8 996	
USD	307	Regency Centers Corp.	24 929	26 129	
USD	398	Rexford Industrial Realty Inc.	27 440	24 284	
USD	109	Ryman Hospitality Properties Inc.	16 753	14 894	
USD	332	STAG Industrial Inc.	16 300	16 382	
USD	565	UDR Inc.	30 219	31 814	
USD	86	Zillow Group Inc., catégorie A	5 479	5 300	
USD	292	Zillow Group Inc., catégorie C	18 379	18 536	
			590 634	608 503	0,5
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	327	Alcoa Corp.	15 379	17 800	
USD	777	AngloGold Ashanti PLC	20 386	26 718	
USD	120	AptarGroup Inc.	20 328	23 121	
USD	1 902	Arcadium Lithium PLC	15 805	8 745	
USD	92	Ashland Inc.	10 859	11 895	
USD	409	Axalta Coating Systems Ltd.	17 837	19 123	
USD	213	Berry Global Group Inc.	17 774	17 152	
USD	864	Cleveland-Cliffs Inc.	20 577	18 195	
USD	213	Commercial Metals Co.	14 849	16 027	
USD	222	Crown Holdings Inc.	25 296	22 598	
USD	63	Eagle Materials Inc.	16 412	18 746	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.



# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>MATERIAUX (suite)</b>					
USD	219	Eastman Chemical Co.	25 947	29 359	
USD	229	FMC Corp.	18 001	18 033	
USD	561	Graphic Packaging Holding Co.	19 632	20 120	
USD	305	Huntsman Corp.	10 462	9 503	
USD	635	International Paper Co.	32 569	37 493	
USD	119	Louisiana Pacific Corp.	11 362	13 406	
USD	595	Mosaic Co. (The)	24 376	23 529	
USD	221	Olin Corp.	15 901	14 258	
USD	164	Packaging Corp. of America	32 970	40 969	
USD	121	Royal Gold Inc.	18 922	20 723	
USD	235	RPM International Inc.	30 365	34 626	
USD	264	Sealed Air Corp.	13 819	12 568	
USD	146	Silgan Holdings Inc.	9 168	8 457	
USD	178	Sonoco Products Co.	13 975	12 354	
USD	220	Summit Materials Inc., catégorie A	11 784	11 021	
USD	410	United States Steel Corp.	16 027	21 207	
USD	240	Valvoline Inc.	12 394	14 187	
USD	471	WestRock Co.	23 126	32 392	
			536 302	574 325	0,4
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	625	Antero Midstream Corp.	10 234	12 606	
USD	521	Antero Resources Corp.	18 075	23 262	
USD	658	APA Corp.	29 450	26 507	
USD	352	ChampionX Corp.	14 624	15 996	
USD	219	Chesapeake Energy Corp.	24 546	24 630	
USD	76	Chord Energy Corp.	16 001	17 438	
USD	155	Civitas Resources Inc.	14 941	14 634	
USD	178	DT Midstream Inc.	12 629	17 300	
USD	451	EnLink Midstream LLC	6 947	8 492	
USD	145	Hess Midstream LP, catégorie A	6 329	7 230	
USD	278	HF Sinclair Corp.	19 085	20 291	
USD	324	Magnolia Oil & Gas Corp., catégorie A	9 689	11 234	
USD	208	Matador Resources Co.	15 639	16 963	
USD	268	Murphy Oil Corp.	14 589	15 123	
USD	152	New Fortress Energy Inc.	5 821	4 571	
USD	211	Noble Corp., PLC	12 173	12 891	
USD	724	NOV Inc.	16 534	18 833	
USD	446	Ovintiv Inc.	25 256	28 604	
USD	196	PBF Energy Inc.	11 949	12 342	
USD	784	Permian Resources Corp.	14 431	17 325	
USD	440	Range Resources Corp.	18 150	20 187	
USD	89	Scorpio Tankers Inc.	6 405	9 900	
USD	212	SM Energy Co.	10 486	12 541	
USD	2 000	Southwestern Energy Co.	17 181	18 418	
USD	810	TechnipFMC PLC	26 010	28 985	
USD	43	Texas Pacific Land Corp.	31 012	43 205	
USD	1 396	Transocean Ltd.	13 934	10 220	
USD	148	Viper Energy Inc.	6 517	7 600	
USD	130	Weatherford International PLC	18 709	21 782	
			447 346	499 110	0,4

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	240	BellRing Brands Inc.	19 176	18 765	
USD	244	BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	22 026	29 328	
USD	17	Boston Beer Co., Inc. (The), catégorie A	7 369	7 096	
USD	68	Casey's General Stores Inc.	22 697	35 503	
USD	10	Coca-Cola Consolidated Inc.	9 349	14 847	
USD	661	Coty Inc., catégorie A	10 504	9 063	
USD	292	Darling Ingredients Inc.	22 318	14 684	
USD	100	e.l.f. Beauty, Inc.	20 600	28 834	
USD	344	Flowers Foods Inc.	11 181	10 450	
USD	122	Ingredion Inc.	17 934	19 148	
USD	33	Inter Parfums Inc.	5 986	5 239	
USD	266	Lamb Weston Holdings Inc.	38 078	30 604	
USD	36	Lancaster Colony Corp.	9 319	9 309	
USD	266	Maplebear Inc.	10 344	11 698	
USD	324	Molson Coors Beverage Co.	27 935	22 535	
USD	283	Performance Food Group Co.	23 763	25 601	
USD	76	Pilgrim's Pride Corp.	2 598	4 003	
USD	90	Post Holdings Inc.	11 016	12 827	
USD	101	Reynolds Consumer Products Inc.	3 814	3 867	
USD	421	US Foods Holding Corp.	25 765	30 520	
			321 772	343 921	0,3
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	407	Frontier Communications Parent Inc.	10 922	14 580	
USD	128	IAC/InterActive Corp.	10 223	8 206	
USD	707	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	34 628	28 142	
USD	31	Liberty Broadband Corp., catégorie A	2 825	2 316	
USD	213	Liberty Broadband Corp., catégorie C	19 964	15 978	
USD	43	Liberty Media Corp. - Liberty Formula One, série A	3 678	3 779	
USD	357	Liberty Media Corp. - Liberty Formula One, série C	34 311	35 094	
USD	136	Liberty Media Corp. - Liberty SiriusXM, catégorie A	4 515	4 122	
USD	273	Liberty Media Corp. - Liberty SiriusXM, catégorie C	9 311	8 278	
USD	501	Match Group Inc.	26 017	20 827	
USD	280	New York Times Co., (The), catégorie A	15 217	19 621	
USD	704	News Corp., catégorie A	20 647	26 559	
USD	195	News Corp., catégorie B	5 827	7 575	
USD	59	Nexstar Media Group Inc.	12 953	13 402	
USD	902	Paramount Global, catégorie B	16 736	12 824	
USD	231	Roku Inc.	20 744	18 943	
USD	100	TKO Group Holdings Inc.	13 041	14 777	
USD	74	Trump Media & Technology Group Corp.	4 940	3 316	
USD	475	ZoomInfo Technologies Inc.	13 730	8 300	
			280 229	266 639	0,2
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	1 309	AES Corp. (The)	29 382	31 471	
USD	322	Brookfield Renewable Corp., catégorie A	13 064	12 504	
USD	60	Clearway Energy Inc.	2 073	1 860	
USD	151	Clearway Energy Inc., catégorie C	5 493	5 101	
USD	504	Essential Utilities Inc.	26 462	25 745	
USD	98	IDACORP Inc.	13 112	12 491	
USD	164	National Fuel Gas Co.	11 389	12 161	
USD	825	NiSource Inc.	30 305	32 523	
USD	382	NRG Energy Inc.	24 068	40 698	
USD	369	OGE Energy Corp.	17 598	18 026	
USD	210	Pinnacle West Capital Corp.	22 279	21 948	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
		<b>SERVICES PUBLICS (suite)</b>			
USD	104	Southwest Gas Corp.	9 351	10 016	
USD	391	UGI Corp.	13 858	12 252	
			218 434	236 796	0,2
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>106 845 152</b>	<b>126 213 150</b>	<b>99,6</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(66 351)		
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>106 778 801</b>	<b>126 213 150</b>	<b>99,6</b>
		Autres actifs (passifs) nets		446 388	0,4
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>126 659 538</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Le ou les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2024

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice 500 É.-U. CI	189 876	117 202	61,7

au 31 décembre 2023

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice 500 É.-U. CI	149 199	82 432	55,2

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	1	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	2024	Parts ordinaires non couvertes	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	4 050 000		150 000
Parts rachetables émises	2 000 000		3 600 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-		-
Parts rachetables rachetées	(1 200 000)		-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>4 850 000</b>		<b>3 750 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires non couvertes	0,160

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	786	-
Garanties (hors trésorerie)	827	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>34,5</b>	<b>-</b>

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2024
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	117 202

## Placements dans des parties liées (note 9)

au 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2023
FNB Indice 500 É.-U. CI (parts ordinaires non couvertes)	70 547

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Fonds négocié(s) en bourse	91,8
Actions - Produits industriels	1,6
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	1,2
Actions - Services financiers	1,1
Actions - Technologies de l'information	1,1
Actions - Soins de santé	0,8
Actions - Immobilier	0,5
Actions - Matériaux	0,5
Actions - Énergie	0,4
Actions - Biens de consommation de base	0,3
Actions - Services de communication	0,3
Actions - Services publics	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des Fonds négociés en bourse.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 1000	12 513 087

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 1000	8 845 619

### Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024-

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	9 037	-	9 037	7,1
<b>Total</b>	<b>9 037</b>	<b>-</b>	<b>9 037</b>	<b>7,1</b>

-Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.



# FNB Indice 1000 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en k\$)	Dérivés (en k\$)	Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
Dollar américain	7 193	-	7 193	8,0
<b>Total</b>	<b>7 193</b>	<b>-</b>	<b>7 193</b>	<b>8,0</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 904 000 \$ (719 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des Fonds négociés en bourse.

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	9 011	-	-	9 011
Fonds négocié(s) en bourse	117 202	-	-	117 202
<b>Total</b>	<b>126 213</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>126 213</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	7 177	-	-	7 177
Fonds négocié(s) en bourse	82 432	-	-	82 432
<b>Total</b>	<b>89 609</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>89 609</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	189 771	148 885
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	44	227
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	-	-
Dividendes à recevoir	81	118
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	7	6
	189 904	149 236
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	13	10
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	12	27
	28	37
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	189 876	149 199

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	1 044	-	20,89	-	50 000	-
Parts ordinaires non couvertes	188 832	149 199	26,23	22,10	7 200 000	6 750 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 461	1 075
Intérêts aux fins des distributions	4	5
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	8 265	1 952
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	20 407	15 509
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>30 137</b>	<b>18 541</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	13	2
Profit (perte) de change sur la trésorerie	7	(2)
Rabais sur frais	41	3
Autres revenus	15	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>76</b>	<b>3</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>30 213</b>	<b>18 544</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	71	52
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	4
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	182	158
Taxe de vente harmonisée	2	5
<b>Total des charges</b>	<b>257</b>	<b>220</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>29 956</b>	<b>18 324</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	46	-	0,93	-	50 000	-
Parts ordinaires non couvertes	29 910	18 324	4,11	2,70	7 268 681	6 778 177

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds
	2024	2023	2024	2023	2024 2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	-	-	149 199	124 865	149 199 124 865
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	46	-	29 910	18 324	29 956 18 324
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>					
Revenu net de placement	(2)	-	(1 146)	(657)	(1 148) (657)
Profits nets réalisés	-	-	-	(235)	- (235)
Remboursement de capital	-	-	(46)	-	(46) -
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(2)	-	(1 192)	(892)	(1 194) (892)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>					
Produit de l'émission de parts rachetables	1 000	-	50 220	37 500	51 220 37 500
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	- -
Rachat de parts rachetables	-	-	(39 305)	(40 782)	(39 305) (40 782)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	1 000	-	10 915	(3 282)	11 915 (3 282)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	1 044	-	39 633	14 150	40 677 14 150
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 044	-	188 832	139 015	189 876 139 015

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	29 956	18 324
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(8 265)	(1 952)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(20 407)	(15 509)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	1	4
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	3 786	2 811
Achat de placements et de dérivés	(4 644)	(3 412)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	37	16
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(16)	3
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>450</b>	<b>285</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 194)	(892)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 103	489
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 543)	(500)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(634)</b>	<b>(903)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(184)	(618)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	227	716
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>44</b>	<b>98</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4	5
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 316	933
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.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	1 882	Accenture PLC, catégorie A	751 232	781 352	
USD	1 363	Adobe Inc.	744 159	1 036 116	
USD	4 789	Advanced Micro Devices Inc.	680 592	1 062 967	
USD	446	Akamai Technologies Inc.	55 929	54 974	
USD	345	Amdocs Ltd.	41 385	37 257	
USD	3 538	Amphenol Corp., catégorie A	207 564	326 153	
USD	1 511	Analog Devices Inc.	356 454	471 945	
USD	260	ANSYS Inc.	98 690	114 380	
USD	44 365	Apple Inc.	9 604 952	12 786 076	
USD	2 510	Applied Materials Inc.	448 649	810 521	
USD	542	AppLovin Corp., catégorie A	54 194	61 720	
USD	709	Arista Networks Inc.	164 221	340 022	
USD	81	Aspen Technology Inc.	23 778	22 015	
USD	463	Atlassian Corp.	108 585	112 062	
USD	640	Autodesk Inc.	183 683	216 703	
USD	649	Bentley Systems Inc., catégorie B	37 738	43 835	
USD	1 375	Broadcom Inc.	1 545 333	3 020 775	
USD	809	Cadence Design Systems Inc.	230 567	340 678	
USD	404	CDW Corp. of Delaware	106 343	123 742	
USD	12 208	Cisco Systems Inc.	784 262	793 646	
USD	857	CloudFlare Inc., catégorie A	73 871	97 133	
USD	1 519	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	132 213	141 340	
USD	2 302	Corning Inc.	103 269	122 375	
USD	663	CrowdStrike Holdings Inc., catégorie A	174 819	347 636	
USD	783	Datadog Inc., catégorie A	99 528	138 952	
USD	889	Dell Technologies Inc., catégorie C	88 468	167 762	
USD	398	Enphase Energy Inc.	115 918	54 302	
USD	448	Enterpris Inc.	75 176	83 003	
USD	168	EPAM Systems Inc.	70 343	43 243	
USD	74	Fair Isaac Corp.	84 340	150 739	
USD	303	First Solar Inc.	70 356	93 478	
USD	1 837	Fortinet Inc.	147 513	151 498	
USD	230	Gartner Inc.	108 830	141 328	
USD	228	GlobalFoundries Inc.	17 518	15 774	
USD	3 855	Hewlett Packard Enterprise Co.	81 038	111 672	
USD	2 950	HP Inc.	117 858	141 363	
USD	145	HubSpot Inc.	82 912	117 021	
USD	12 491	Intel Corp.	559 399	529 341	
USD	2 720	International Business Machines Corp.	540 709	643 705	
USD	816	Intuit Inc.	519 978	733 823	
USD	373	Jabil Inc.	46 805	55 526	
USD	522	Keysight Technologies Inc.	112 425	97 678	
USD	411	KLA Corp.	250 853	463 698	
USD	393	Lam Research Corp.	310 880	572 635	
USD	2 566	Marvell Technology Inc.	179 451	245 432	
USD	1 601	Microchip Technology Inc.	166 284	200 452	
USD	3 268	Micron Technology Inc.	321 943	588 172	
USD	21 962	Microsoft Corp.	9 056 665	13 431 609	
USD	45	MicroStrategy Inc., catégorie A	69 837	84 819	
USD	209	MongoDB Inc.	75 438	71 485	
USD	142	Monolithic Power Systems Inc.	93 872	159 657	
USD	501	Motorola Solutions Inc.	189 005	264 654	
USD	615	NetApp Inc.	65 289	108 390	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)</b>					
USD	71 046	NVIDIA Corp.	3 853 395	12 010 039	
USD	478	Okta Inc.	51 268	61 228	
USD	1 290	ON Semiconductor Corp.	126 106	121 002	
USD	4 656	Oracle Corp.	598 392	899 590	
USD	5 902	Palantir Technologies Inc.	110 109	204 565	
USD	959	Palo Alto Networks Inc.	278 314	444 865	
USD	354	PTC Inc.	73 454	88 000	
USD	3 333	QUALCOMM Inc.	612 062	908 402	
USD	319	Roper Technologies Inc.	195 955	246 040	
USD	2 818	Salesforce Inc.	767 378	991 380	
USD	586	Samsara Inc.	27 027	27 022	
USD	578	Seagate Technology Holdings PLC	53 330	81 677	
USD	609	ServiceNow Inc.	431 305	655 552	
USD	476	Skyworks Solutions Inc.	64 672	69 419	
USD	946	Snowflake Inc., catégorie A	202 634	174 868	
USD	150	Super Micro Computer Inc.	152 492	168 174	
USD	453	Synopsys Inc.	246 566	368 855	
USD	924	TE Connectivity Ltd.	161 263	190 197	
USD	141	Teledyne Technologies Inc.	76 586	74 856	
USD	463	Teradyne Inc.	61 978	93 949	
USD	2 708	Texas Instruments Inc.	625 758	720 829	
USD	740	Trimble Inc.	57 502	56 623	
USD	126	Tyler Technologies Inc.	62 608	86 685	
USD	262	VeriSign Inc.	68 563	63 743	
USD	958	Western Digital Corp.	58 933	99 325	
USD	621	Workday Inc., catégorie A	163 845	189 969	
USD	153	Zebra Technologies Corp., catégorie A	60 383	64 677	
USD	761	Zoom Video Communications Inc.	79 458	61 635	
USD	264	Zscaler Inc.	55 271	69 428	
			<b>39 807 720</b>	<b>62 219 228</b>	<b>32,8</b>
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	1 556	Aflac Inc.	147 233	190 155	
USD	784	Allstate Corp. (The)	143 104	171 281	
USD	1 722	American Express Co.	400 042	545 601	
USD	2 036	American International Group Inc.	167 591	206 830	
USD	300	Ameriprise Financial Inc.	134 471	175 364	
USD	587	Aon PLC	241 364	235 810	
USD	1 212	Apollo Global Management Inc.	122 541	195 812	
USD	1 069	Arch Capital Group Ltd.	96 014	147 579	
USD	522	Ares Management Corp., catégorie A	69 213	95 199	
USD	635	Arthur J. Gallagher & Co.	175 645	225 315	
USD	20 753	Bank of America Corp.	956 783	1 129 363	
USD	2 255	Bank of New York Mellon Corp. (The)	143 238	184 798	
USD	3 870	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	1 728 249	2 154 215	
USD	444	BlackRock Inc.	423 433	478 334	
USD	2 104	Blackstone Inc.	282 066	356 421	
USD	1 650	Block Inc.	156 319	145 604	
USD	1 395	Blue Owl Capital Inc.	24 549	33 882	
USD	716	Brown & Brown Inc.	65 256	87 599	
USD	1 130	Capital One Financial Corp.	171 236	214 076	
USD	315	CBOE Global Markets, Inc.	73 614	73 301	
USD	4 135	The Charles Schwab Corp.	389 502	416 947	
USD	1 211	Chubb Ltd.	349 298	422 686	
USD	463	Cincinnati Financial Corp.	67 951	74 822	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES FINANCIERS (suite)</b>					
USD	5 664	Citigroup Inc.	388 394	491 836	
USD	1 391	Citizens Financial Group Inc.	66 927	68 579	
USD	1 075	CME Group Inc.	277 412	289 194	
USD	513	Coinbase Global Inc., catégorie A	94 931	155 997	
USD	209	Corpay Inc.	64 377	76 189	
USD	746	Discover Financial Services	109 853	133 529	
USD	76	Erie Indemnity Co., catégorie A	40 107	37 688	
USD	100	Everest Re Group Ltd.	50 852	52 137	
USD	115	FactSet Research Systems Inc.	66 378	64 246	
USD	1 724	Fidelity National Information Services Inc.	167 438	177 777	
USD	2 033	Fifth Third Bancorp	91 761	101 510	
USD	35	First Citizens BancShares Inc.	68 461	80 632	
USD	1 759	Fiserv Inc.	281 060	358 729	
USD	945	Franklin Resources Inc.	32 774	28 901	
USD	768	Global Payments Inc.	117 624	101 621	
USD	971	Goldman Sachs Group Inc. (The)	470 058	600 983	
USD	887	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	92 905	122 028	
USD	4 305	Huntington Bancshares Inc.	76 884	77 640	
USD	304	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	34 489	50 999	
USD	1 697	Intercontinental Exchange Inc.	256 245	317 871	
USD	8 685	JPMorgan Chase & Co.	1 709 385	2 403 682	
USD	2 004	KKR & Co., Inc.	174 477	288 586	
USD	550	Loews Corp.	45 587	56 249	
USD	226	LPL Financial Holdings Inc.	70 711	86 373	
USD	495	M&T Bank Corp.	102 954	102 521	
USD	40	Markel Corp.	72 728	86 242	
USD	1 479	Marsh & McLennan Cos., Inc.	351 971	426 453	
USD	2 511	Mastercard Inc., catégorie A	1 274 345	1 515 793	
USD	1 813	MetLife Inc.	162 502	174 129	
USD	475	Moody's Corp.	204 922	273 590	
USD	3 792	Morgan Stanley	449 020	504 298	
USD	233	MSCI Inc.	154 970	153 594	
USD	1 022	Nasdaq Inc.	81 957	84 271	
USD	612	Northern Trust Corp.	72 241	70 327	
USD	3 286	Paypal Holdings Inc.	348 462	260 926	
USD	1 192	PNC Financial Services Group Inc.	244 236	253 599	
USD	706	Principal Financial Group Inc.	76 159	75 787	
USD	1 749	Progressive Corp. (The)	345 969	497 101	
USD	1 093	Prudential Financial Inc.	148 864	175 270	
USD	566	Raymond James Financial Inc.	83 892	95 734	
USD	2 748	Regions Financial Corp.	75 414	75 355	
USD	389	Rocket Cos. Inc., catégorie A	5 192	7 292	
USD	940	S&P Global Inc.	470 025	573 667	
USD	901	State Street Corp.	88 759	91 233	
USD	1 211	Synchrony Financial	58 126	78 197	
USD	661	T. Rowe Price Group Inc.	104 603	104 296	
USD	347	Tradeweb Markets Inc., catégorie A	35 520	50 331	
USD	690	Travelers Cos., Inc. (The)	171 732	191 986	
USD	3 980	Truist Financial Corp.	220 052	211 578	
USD	4 431	U.S. Bancorp	246 361	240 708	
USD	4 734	Visa Inc., catégorie A	1 460 671	1 700 220	
USD	606	W.R. Berkley Corp.	58 021	65 160	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.



# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES FINANCIERS (suite)</b>					
USD	10 710	Wells Fargo & Co.	678 155	870 362	
USD	309	Willis Towers Watson PLC	97 549	110 838	
			19 323 174	23 304 828	12,3
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	5 184	Abbott Laboratories	744 435	737 088	
USD	5 286	AbbVie Inc.	1 101 349	1 240 621	
USD	883	Agilent Technologies Inc.	165 058	156 626	
USD	215	Align Technology Inc.	79 515	71 028	
USD	372	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	94 331	123 693	
USD	1 595	Amgen Inc.	560 084	681 928	
USD	1 952	Avantor Inc.	60 889	56 626	
USD	1 511	Baxter International Inc.	101 817	69 160	
USD	868	Becton, Dickinson and Co.	286 270	277 584	
USD	432	Biogen Inc.	148 948	137 035	
USD	556	BioMarin Pharmaceutical Inc.	67 962	62 637	
USD	4 369	Boston Scientific Corp.	300 495	460 390	
USD	6 092	Bristol-Myers Squibb Co.	543 826	346 194	
USD	728	Cardinal Health Inc.	84 922	97 942	
USD	504	Cencora Inc.	120 747	155 378	
USD	1 596	Centene Corp.	166 573	144 792	
USD	881	Cigna Corp.	360 773	398 508	
USD	592	Cooper Cos. Inc. (The)	68 506	70 719	
USD	3 836	CVS Health Corp.	440 033	310 005	
USD	1 975	Danaher Corp.	623 204	675 217	
USD	1 156	DexCom Inc.	175 472	179 346	
USD	1 802	Edwards Lifesciences Corp.	210 364	227 763	
USD	709	Elevance Health Inc.	464 003	525 691	
USD	2 533	Eli Lilly and Co.	1 597 132	3 138 075	
USD	1 092	GE HealthCare Technologies Inc.	94 127	116 431	
USD	3 732	Gilead Sciences Inc.	373 612	350 369	
USD	78	GRAIL Inc.	1 985	1 640	
USD	588	HCA Healthcare Inc.	204 139	258 499	
USD	699	Hologic Inc.	69 780	71 018	
USD	361	Humana Inc.	223 709	184 574	
USD	247	IDEXX Laboratories Inc.	148 221	164 665	
USD	473	Illumina Inc.	121 522	67 558	
USD	559	Incyte Corp.	51 814	46 369	
USD	1 043	Intuitive Surgical Inc.	405 505	634 885	
USD	534	IQVIA Holdings Inc.	156 407	154 499	
USD	7 212	Johnson & Johnson	1 603 363	1 442 386	
USD	254	Labcorp Holdings Inc.	79 253	70 732	
USD	394	McKesson Corp.	215 402	314 873	
USD	3 985	Medtronic PLC	451 697	429 196	
USD	7 598	Merck & Co., Inc.	1 106 215	1 287 114	
USD	64	Mettler-Toledo International Inc.	114 968	122 393	
USD	993	Moderna Inc.	198 092	161 354	
USD	173	Molina Healthcare Inc.	77 570	70 378	
USD	16 909	Pfizer Inc.	927 800	647 385	
USD	334	Quest Diagnostics Inc.	61 677	62 558	
USD	310	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	325 990	445 835	
USD	435	ResMed Inc.	125 835	113 939	
USD	369	Revvity Inc.	62 504	52 946	
USD	1 125	Royalty Pharma PLC, catégorie A	55 769	40 594	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SOINS DE SANTÉ (suite)</b>					
USD	295	STERIS PLC	80 053	88 620	
USD	948	Stryker Corp.	341 017	441 371	
USD	1 154	Thermo Fisher Scientific Inc.	855 708	873 229	
USD	2 778	UnitedHealth Group Inc.	1 881 225	1 935 838	
USD	441	Veeva Systems Inc., catégorie A	116 199	110 436	
USD	771	Vertex Pharmaceuticals Inc.	349 146	494 499	
USD	3 584	Viatis Inc.	51 530	52 131	
USD	176	Waters Corp.	75 300	69 869	
USD	222	West Pharmaceutical Services Inc.	93 224	100 060	
USD	625	Zimmer Biomet Holdings Inc.	102 207	92 817	
USD	1 384	Zoetis Inc.	304 065	328 309	
			20 073 338	22 243 415	11,7
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	1 290	Airbnb Inc., catégorie A	216 185	267 653	
USD	26 959	Amazon.com Inc.	4 660 440	7 128 866	
USD	815	Aptiv PLC	104 863	78 533	
USD	52	AutoZone Inc.	177 128	210 908	
USD	582	Best Buy Co., Inc.	61 180	67 127	
USD	102	Booking Holdings Inc.	334 456	552 913	
USD	2 982	Carnival Corp.	49 734	76 385	
USD	4 150	Chipotle Mexican Grill Inc.	212 978	355 768	
USD	3 271	Coupang Inc.	79 109	93 770	
USD	898	D.R. Horton Inc.	127 192	173 172	
USD	361	Darden Restaurants Inc.	71 148	74 748	
USD	77	Deckers Outdoor Corp.	88 358	101 986	
USD	920	DoorDash Inc., catégorie A	105 796	136 941	
USD	1 389	DraftKings Inc., catégorie A	64 462	72 547	
USD	1 549	eBay Inc.	96 001	113 864	
USD	398	Expedia Group Inc.	58 066	68 615	
USD	11 753	Ford Motor Co.	208 089	201 671	
USD	456	Garmin Ltd.	67 168	101 657	
USD	3 450	General Motors Co.	181 069	219 329	
USD	413	Genuine Parts Co.	89 709	78 169	
USD	754	Hilton Worldwide Holdings Inc.	154 725	225 125	
USD	3 008	Home Depot Inc. (The)	1 292 893	1 416 891	
USD	1 096	Las Vegas Sands Corp.	69 288	66 362	
USD	723	Lennar Corp., catégorie A	106 740	148 269	
USD	22	Lennar Corp., catégorie B	3 032	4 197	
USD	1 714	Lowe's Cos., Inc.	492 699	517 056	
USD	333	Lululemon Athletica Inc.	156 563	136 106	
USD	756	Marriott International Inc., catégorie A	184 918	250 104	
USD	2 184	McDonald's Corp.	791 492	761 583	
USD	135	MercadoLibre Inc.	201 364	303 581	
USD	737	MGM Resorts International	38 021	44 817	
USD	268	Mobileye Global Inc., catégorie A	13 210	10 299	
USD	3 652	Nike Inc., catégorie B	517 005	376 640	
USD	9	NVR Inc.	63 849	93 454	
USD	177	O'Reilly Automotive Inc.	208 751	255 776	
USD	116	Pool Corp.	55 340	48 782	
USD	632	PulteGroup Inc.	77 078	95 214	
USD	1 001	Ross Stores Inc.	151 794	199 047	
USD	661	Royal Caribbean Cruises Ltd.	100 554	144 201	
USD	3 367	Starbucks Corp.	425 248	358 673	
USD	8 230	Tesla Inc.	2 318 870	2 228 430	
USD	3 441	The TJX Cos. Inc.	374 470	518 405	
USD	328	Tractor Supply Co.	99 814	121 181	
USD	145	Ulta Beauty Inc.	88 265	76 561	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRETIONNAIRE (suite)</b>					
USD	181	Williams-Sonoma Inc.	72 513	69 935	
USD	1 141	Yum China Holdings Inc.	75 860	48 150	
USD	839	Yum! Brands Inc.	143 493	152 070	
			15 330 980	18 845 531	9,9
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	17 797	Alphabet Inc., catégorie A	2 854 335	4 435 812	
USD	14 695	Alphabet Inc., catégorie C	2 371 047	3 688 192	
USD	21 407	AT&T Inc.	509 090	559 775	
USD	288	Charter Communications Inc., catégorie A	140 281	117 816	
USD	11 915	Comcast Corp., catégorie A	617 267	638 460	
USD	811	Electronic Arts Inc.	139 179	154 619	
USD	259	Endeavor Group Holdings Inc., catégorie A	8 299	9 579	
USD	711	Fox Corp., catégorie A	30 793	33 438	
USD	388	Fox Corp., catégorie B	15 594	17 000	
USD	437	Live Nation Entertainment Inc.	49 779	56 054	
USD	6 597	Meta Platforms Inc., catégorie A	2 256 853	4 551 596	
USD	1 266	Netflix Inc.	648 517	1 169 116	
USD	587	Omnicom Group Inc.	65 037	72 049	
USD	1 777	Pinterest Inc., catégorie A	67 996	107 159	
USD	1 437	ROBLOX Corp., catégorie A	70 744	73 167	
USD	1 909	Sirius XM Holdings Inc.	13 093	7 392	
USD	3 099	Snap Inc., catégorie A	52 013	70 435	
USD	412	Spotify Technology SA	84 607	176 902	
USD	503	Take-Two Interactive Software Inc.	86 195	107 021	
USD	1 547	T-Mobile US Inc.	311 048	372 944	
USD	1 325	Trade Desk Inc. (The)	116 805	177 082	
USD	12 592	Verizon Communications Inc.	679 215	710 576	
USD	5 474	Walt Disney Co. (The)	757 620	743 717	
USD	6 689	Warner Bros Discovery Inc.	105 591	68 098	
USD	373	Warner Music Group Corp., catégorie A	15 075	15 644	
			12 066 073	18 133 643	9,5
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	1 654	3M Co.	256 226	231 282	
USD	689	AMETEK Inc.	135 027	157 173	
USD	1 238	Automatic Data Processing Inc.	396 925	404 345	
USD	213	Axon Enterprise Inc.	69 550	85 759	
USD	1 670	Boeing Co. (The)	405 451	415 919	
USD	384	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	68 644	80 866	
USD	351	Broadridge Financial Solutions Inc.	77 207	94 617	
USD	359	Builders FirstSource Inc.	76 930	67 992	
USD	145	Carlisle Cos. Inc.	54 884	80 398	
USD	2 386	Carrier Global Corp.	150 994	205 949	
USD	1 524	Caterpillar Inc.	512 911	694 635	
USD	260	Cintas Corp.	170 119	249 132	
USD	2 539	Copart Inc.	135 230	188 165	
USD	5 853	CSX Corp.	253 851	267 899	
USD	409	Cummins Inc.	134 637	154 985	
USD	768	Deere & Co.	404 164	392 645	
USD	1 919	Delta Air Lines Inc.	98 662	124 571	
USD	418	Dover Corp.	82 092	103 212	
USD	1 188	Eaton Corp. PLC	320 016	509 707	
USD	1 707	Emerson Electric Co.	215 682	257 309	
USD	365	Equifax Inc.	103 932	121 096	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>PRODUITS INDUSTRIELS (suite)</b>					
USD	429	Expeditors International of Washington Inc.	63 603	73 254	
USD	1 709	Fastenal Co.	131 092	146 952	
USD	678	FedEx Corp.	199 806	278 174	
USD	579	Ferguson PLC	127 045	153 424	
USD	1 051	Fortive Corp.	98 592	106 566	
USD	677	General Dynamics Corp.	222 398	268 778	
USD	3 265	General Electric Co.	420 837	710 224	
USD	124	HEICO Corp.	27 320	37 941	
USD	226	HEICO Corp., catégorie A	40 426	54 898	
USD	1 953	Honeywell International Inc.	520 629	570 662	
USD	1 219	Howmet Aerospace Inc.	80 998	129 488	
USD	160	Hubbell Inc.	72 434	80 017	
USD	227	Ilex Corp.	67 417	62 496	
USD	908	Illinois Tool Works Inc.	279 872	294 414	
USD	1 210	Ingersoll Rand Inc.	102 921	150 404	
USD	247	J.B. Hunt Transport Services Inc.	59 141	54 077	
USD	375	Jacobs Solutions Inc.	64 383	71 690	
USD	2 041	Johnson Controls International PLC	169 389	185 638	
USD	566	L3Harris Technologies Inc.	164 309	173 934	
USD	95	Lennox International Inc.	41 923	69 544	
USD	720	Lockheed Martin Corp.	435 601	460 192	
USD	161	Nordson Corp.	50 326	51 097	
USD	676	Norfolk Southern Corp.	214 889	198 589	
USD	443	Northrop Grumman Corp.	284 085	264 264	
USD	572	Old Dominion Freight Line Inc.	125 950	138 224	
USD	1 238	Otis Worldwide Corp.	136 856	163 065	
USD	1 545	PACCAR Inc.	166 874	217 626	
USD	383	Parker-Hannifin Corp.	185 779	265 084	
USD	965	Paychex Inc.	153 610	156 553	
USD	431	Quanta Services Inc.	103 504	149 852	
USD	3 974	Raytheon Technologies Corp.	506 327	545 903	
USD	618	Republic Services Inc.	124 628	164 342	
USD	344	Rockwell Automation Inc.	123 677	129 578	
USD	889	Rollins Inc.	48 244	59 351	
USD	1 777	Southwest Airlines Co.	81 865	69 567	
USD	652	SS&C Technologies Holdings Inc.	50 139	55 912	
USD	454	Stanley Black & Decker Inc.	55 033	49 630	
USD	682	Trane Technologies PLC	185 901	306 962	
USD	155	TransDigm Group Inc.	168 982	270 974	
USD	578	TransUnion	55 232	58 654	
USD	5 991	Uber Technologies Inc.	345 407	595 815	
USD	1 824	Union Pacific Corp.	532 031	564 716	
USD	979	United Airlines Holdings Inc.	57 892	65 186	
USD	2 171	United Parcel Service Inc., catégorie B	505 208	406 539	
USD	201	United Rentals Inc.	115 785	177 876	
USD	659	Veralto Corp.	74 487	86 089	
USD	432	Verisk Analytics Inc.	117 182	159 338	
USD	1 031	Vertiv Holdings Co.	93 509	122 130	
USD	120	W.W. Grainger Inc.	109 099	148 150	
USD	534	Wabtec Corp.	78 197	115 487	
USD	1 217	Waste Management Inc.	285 133	355 271	
USD	712	Xylem Inc.	106 464	132 140	
			12 755 565	15 264 387	8,0

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	1 243	Albertsons Cos. Inc., catégorie A	36 577	33 592	
USD	5 344	Altria Group Inc.	318 879	333 083	
USD	1 519	Archer-Daniels-Midland Co.	161 878	125 647	
USD	146	Brown-Forman Corp., catégorie A	11 289	8 816	
USD	916	Brown-Forman Corp., catégorie B	78 895	54 135	
USD	432	Bunge Global SA	61 967	63 115	
USD	573	Campbell Soup Co.	37 598	35 432	
USD	450	Celsius Holdings Inc.	46 422	35 154	
USD	731	Church & Dwight Co., Inc.	88 040	103 707	
USD	371	Clorox Co. (The)	73 820	69 280	
USD	11 653	Coca-Cola Co. (The)	956 822	1 014 924	
USD	2 484	Colgate-Palmolive Co.	266 140	329 837	
USD	1 423	Conagra Brands Inc.	64 737	55 338	
USD	471	Constellation Brands Inc., catégorie A	155 816	165 815	
USD	1 325	Costco Wholesale Corp.	1 014 942	1 541 086	
USD	654	Dollar General Corp.	185 143	118 333	
USD	622	Dollar Tree Inc.	117 698	90 874	
USD	642	Estée Lauder Cos. Inc. (The), catégorie A	177 478	93 470	
USD	1 700	General Mills Inc.	174 805	147 155	
USD	440	Hershey Co. (The)	131 969	110 679	
USD	865	Hormel Foods Corp.	49 540	36 089	
USD	309	J.M. Smucker Co. (The)	59 648	46 104	
USD	776	Kellanova	69 985	61 247	
USD	5 192	Kenvue Inc.	140 791	129 159	
USD	2 710	Keurig Dr Pepper Inc.	127 184	123 855	
USD	1 009	Kimberly-Clark Corp.	176 689	190 808	
USD	2 360	Kraft Heinz Co. (The)	117 978	104 048	
USD	2 124	Kroger Co. (The)	140 824	145 115	
USD	752	McCormick & Co., Inc.	81 153	72 997	
USD	4 068	Mondelēz International Inc., catégorie A	365 692	364 268	
USD	1 511	Monster Beverage Corp.	105 834	103 276	
USD	4 124	PepsiCo Inc.	982 418	930 713	
USD	4 644	Philip Morris International Inc.	595 212	643 913	
USD	7 054	Procter & Gamble Co. (The)	1 409 760	1 591 864	
USD	1 516	Sysco Corp.	161 777	148 093	
USD	1 381	Target Corp.	296 516	279 750	
USD	843	Tyson Foods Inc., catégorie A	72 674	65 912	
USD	2 134	Walgreens Boots Alliance Inc.	92 037	35 318	
USD	12 755	Walmart Inc.	884 994	1 181 763	
			<b>10 091 621</b>	<b>10 783 764</b>	<b>5,7</b>
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	3 031	Baker Hughes Co.	118 868	145 867	
USD	696	Cheniere Energy Inc.	148 402	166 503	
USD	5 149	Chevron Corp.	1 116 450	1 102 078	
USD	3 522	ConocoPhillips Co.	536 446	551 235	
USD	2 232	Coterra Energy Inc.	82 176	81 454	
USD	1 908	Devon Energy Corp.	147 076	123 753	
USD	510	Diamondback Energy Inc.	103 267	139 704	
USD	1 748	EOG Resources Inc.	290 104	301 065	
USD	1 227	EQT Corp.	65 146	62 088	
USD	13 611	Exxon Mobil Corp.	1 922 670	2 144 065	
USD	2 694	Halliburton Co.	123 279	124 524	
USD	830	Hess Corp.	150 770	167 543	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>ÉNERGIE (suite)</b>					
USD	5 868	Kinder Morgan Inc.	141 514	159 546	
USD	1 726	Marathon Oil Corp.	61 515	67 712	
USD	1 082	Marathon Petroleum Corp.	191 116	256 847	
USD	2 091	Occidental Petroleum Corp.	178 833	180 343	
USD	1 740	ONEOK Inc.	156 873	194 165	
USD	1 280	Phillips 66	191 100	247 258	
USD	4 262	Schlumberger Ltd.	272 493	275 149	
USD	659	Targa Resources Corp.	74 286	116 126	
USD	992	Valero Energy Corp.	175 444	212 787	
USD	3 643	Williams Cos., Inc. (The)	165 163	211 858	
			6 412 991	7 031 670	3,7
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	656	Air Products and Chemicals Inc.	237 037	231 635	
USD	351	Albemarle Corp.	102 684	45 877	
USD	4 325	Amcor PLC	63 738	57 879	
USD	240	Avery Dennison Corp.	58 804	71 806	
USD	928	Ball Corp.	74 174	76 215	
USD	333	Celanese Corp.	54 661	61 464	
USD	571	CF Industries Holdings Inc.	68 696	57 912	
USD	2 101	Corteva Inc.	165 956	155 072	
USD	2 073	CRH PLC	181 483	212 688	
USD	2 118	Dow Inc.	150 564	153 748	
USD	1 134	DuPont de Nemours Inc.	103 826	124 897	
USD	756	Ecolab Inc.	180 332	246 205	
USD	4 275	Freeport-McMoRan Inc.	219 279	284 295	
USD	763	International Flavors & Fragrances Inc.	98 193	99 404	
USD	1 464	Linde PLC	701 815	879 053	
USD	763	LyondellBasell Industries NV, catégorie A	92 650	99 874	
USD	185	Martin Marietta Materials Inc.	103 897	137 154	
USD	3 450	Newmont Corp.	190 153	197 660	
USD	720	Nucor Corp.	146 458	155 742	
USD	705	PPG Industries Inc.	125 630	121 445	
USD	170	Reliance Steel & Aluminum Co.	67 895	66 436	
USD	710	Sherwin-Williams Co. (The)	249 814	289 933	
USD	259	Southern Copper Corp.	24 353	38 183	
USD	443	Steel Dynamics Inc.	74 145	78 500	
USD	398	Vulcan Materials Co.	106 970	135 432	
USD	99	Westlake Corp.	16 822	19 618	
			3 660 029	4 098 127	2,2
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	752	Alliant Energy Corp.	54 571	52 376	
USD	784	Ameren Corp.	87 470	76 286	
USD	1 576	American Electric Power Co., Inc.	191 224	189 213	
USD	582	American Water Works Co., Inc.	110 508	102 860	
USD	450	Atmos Energy Corp.	69 921	71 828	
USD	212	Avangrid Inc.	11 713	10 307	
USD	1 889	CenterPoint Energy Inc.	75 120	80 077	
USD	890	CMS Energy Corp.	73 267	72 498	
USD	1 033	Consolidated Edison Inc.	128 956	126 396	
USD	948	Constellation Energy Corp.	141 556	259 789	
USD	2 503	Dominion Energy Inc.	204 358	167 824	
USD	614	DTE Energy Co.	94 830	93 267	
USD	2 307	Duke Energy Corp.	304 834	316 404	
USD	1 148	Edison International	102 900	112 804	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES PUBLICS (suite)</b>					
USD	631	Entergy Corp.	91 021	92 387	
USD	680	Eversource Energy	54 049	49 287	
USD	1 043	Exelon Corp.	104 688	80 936	
USD	2 975	FirstEnergy Corp.	160 237	140 892	
USD	1 629	NextEra Energy Inc.	85 571	85 305	
USD	6 058	PG&E Corp.	622 921	586 977	
USD	6 099	PPL Corp.	131 527	145 714	
USD	2 208	Public Service Enterprise Group Inc.	82 713	83 539	
USD	1 494	Sempra Energy	125 980	150 666	
USD	1 885	Southern Co. (The)	192 934	196 185	
USD	3 259	Vistra Corp.	308 321	345 920	
USD	1 027	WEC Energy Group Inc.	113 946	120 827	
USD	944	Xcel Energy Inc.	116 301	101 349	
USD	1 648		142 263	120 442	
			3 983 700	4 032 355	2,1
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	466	Alexandria Real Estate Equities Inc.	85 485	74 586	
USD	1 395	AvalonBay Communities Inc.	398 730	371 042	
USD	425	CBRE Group Inc., catégorie A	104 388	120 316	
USD	927	CoStar Group Inc.	101 140	113 032	
USD	1 214	Crown Castle Inc.	130 269	123 160	
USD	1 294	Digital Realty Trust Inc.	229 301	172 992	
USD	934	Equinix Inc.	149 374	194 326	
USD	280	Equity Residential	264 712	289 882	
USD	1 023	Essex Property Trust Inc.	89 766	97 064	
USD	191	Extra Space Storage Inc.	60 805	71 141	
USD	626	Healthpeak Properties Inc.	126 317	133 122	
USD	2 114	Invitation Homes Inc.	62 708	56 697	
USD	1 714	Iron Mountain Inc.	78 121	84 175	
USD	866	Mid-America Apartment Communities Inc.	77 036	106 199	
USD	348	Prologis Inc.	71 441	67 909	
USD	2 760	Public Storage	440 474	424 155	
USD	474	Realty Income Corp.	187 176	186 569	
USD	2 577	SBA Communications Corp.	205 424	186 256	
USD	321	Simon Property Group Inc.	114 332	86 223	
USD	971	Sun Communities Inc.	156 662	201 692	
USD	370	Ventas Inc.	69 194	60 927	
USD	1 202	VICI Properties Inc.	73 530	84 310	
USD	3 093	Welltower Inc.	130 873	121 213	
USD	1 770	Weyerhaeuser Co.	192 164	252 491	
USD	2 190	WP Carey Inc.	95 748	85 076	
USD	652		62 796	49 114	
			3 757 966	3 813 669	2,0
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>147 263 157</b>	<b>189 770 617</b>	<b>99,9</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(17 744)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>147 245 413</b>	<b>189 770 617</b>	<b>99,9</b>
Contrat(s) de change à terme				(1 962)	0,0
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>147 245 413</b>	<b>189 768 655</b>	<b>99,9</b>
Autres actifs (passifs) nets				107 630	0,1
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>189 876 285</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	26 444	USD	19 210	1,38	158
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	22 011	USD	16 042	1,37	60
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	1 000 000	USD	732 402	1,37	(2 182)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	767 654	CAD	1 051 432	0,73	(1 014)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	07 août 2024	CAD	1 048 455	USD	766 112	1,37	1 016
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(1 962)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB Indice 500 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	1	(1)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	1	-	(2)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(3)	1	-	(2)

au 31 décembre 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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	1	1
Paievements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	-	-	6 750 000	6 900 000
Parts rachetables émises	50 000	-	2 000 000	1 950 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	(1 550 000)	(2 100 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>50 000</b>	<b>-</b>	<b>7 200 000</b>	<b>6 750 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,080
Parts ordinaires non couvertes	0,080

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	1 510	-
Garanties (hors trésorerie)	1 591	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	24	3
Charges	(11)	(1)
Revenu tiré des prêts de titres	13	2
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	<b>47,6</b>	<b>38,4</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Actions - Technologies de l'information	29,3
Actions - Services financiers	12,8
Actions - Soins de santé	12,6
Actions - Biens de consommation discrétionnaire	10,8
Actions - Services de communication	8,8
Actions - Produits industriels	8,6
Actions - Biens de consommation de base	6,0
Actions - Énergie	3,9
Actions - Immobilier	2,4
Actions - Matériaux	2,4
Actions - Services publics	2,2
Autres actifs (passifs) nets	0,2
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Les tableaux ci-après indiquent dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 500	18 949 303

#### Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive GBS United States 500	14 865 280

### Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	189 907	(1 047)	188 860	99,5
<b>Total</b>	<b>189 907</b>	<b>(1 047)</b>	<b>188 860</b>	<b>99,5</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Indice 500 É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	149 079	-	149 079	99,9
<b>Total</b>	<b>149 079</b>	<b>-</b>	<b>149 079</b>	<b>99,9</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 18 886 000 \$ (14 908 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	189 771	-	-	189 771
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(2)	-	(2)
<b>Total</b>	<b>189 771</b>	<b>(2)</b>	<b>-</b>	<b>189 769</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	148 885	-	-	148 885
<b>Total</b>	<b>148 885</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>148 885</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	8 517	9 069
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	23	9
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	12
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	6	6
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	8 546	9 096
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	6	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	2	2
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	-	-
	8	2
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>8 538</b>	<b>9 094</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	7 449	8 099	21,28	20,25	350 000	400 000
Parts ordinaires non couvertes	1 089	995	21,78	19,91	50 000	50 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	107	43
Intérêts aux fins des distributions	-	-
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	(279)	29
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	756	(16)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>584</b>	<b>56</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	2
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>584</b>	<b>58</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	12	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	15	6
Taxe de vente harmonisée	2	1
<b>Total des charges</b>	<b>30</b>	<b>13</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>554</b>	<b>45</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	452	48	1,25	0,33	361 538	146 835
Parts ordinaires non couvertes	102	(3)	2,05	(0,06)	50 000	50 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	8 099	-	995	-	9 094	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	452	48	102	(3)	554	45
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(57)	(24)	(5)	(5)	(62)	(29)
Profits nets réalisés	(6)	-	(3)	-	(9)	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(63)	(24)	(8)	(5)	(71)	(29)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	7 047	-	1 000	-	8 047
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 039)	-	-	-	(1 039)	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(1 039)	7 047	-	1 000	(1 039)	8 047
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(650)	7 071	94	992	(556)	8 063
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	7 449	7 071	1 089	992	8 538	8 063

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	554	45
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	279	(29)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(756)	16
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 028	445
Achat de placements et de dérivés	(994)	(2 564)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	(4)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-	2
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>111</b>	<b>(2 089)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(72)	(29)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 127
Montant versé au rachat de parts rachetables	(25)	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(97)</b>	<b>2 098</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	14	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	9	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>23</b>	<b>9</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	91	32
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.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES FINANCIERS</b>					
USD	25	Allstate Corp. (The)	3 909	5 462	
USD	19	American Express Co.	4 056	6 020	
USD	83	Bank of America Corp.	3 281	4 517	
USD	740	Berkshire Hathaway Inc., catégorie B	370 395	411 917	
USD	4	BlackRock Inc.	3 601	4 309	
USD	28	Cincinnati Financial Corp.	3 870	4 525	
USD	50	Citigroup Inc.	4 219	4 342	
USD	29	Fiserv Inc.	4 528	5 914	
USD	9	Goldman Sachs Group Inc. (The)	4 046	5 570	
USD	2 544	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	338 375	349 988	
USD	31	Intercontinental Exchange Inc.	4 567	5 807	
USD	26	JPMorgan Chase & Co.	4 832	7 196	
USD	55	Loews Corp.	4 333	5 625	
USD	22	M&T Bank Corp.	3 773	4 557	
USD	1 087	Marsh & McLennan Cos., Inc.	259 291	313 424	
USD	58	Nasdaq Inc.	4 371	4 782	
USD	36	Northern Trust Corp.	3 740	4 137	
USD	20	PNC Financial Services Group Inc.	3 391	4 255	
USD	853	Progressive Corp. (The)	152 010	242 440	
USD	72	U.S. Bancorp	3 372	3 911	
USD	15	Visa Inc., catégorie A	4 630	5 387	
USD	72	Wells Fargo & Co.	3 990	5 851	
			1 192 580	1 409 936	16,5
<b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>					
USD	60	Brown-Forman Corp., catégorie B	4 940	3 546	
USD	2 786	Coca-Cola Co. (The)	230 624	242 648	
USD	6	Costco Wholesale Corp.	4 104	6 979	
USD	19	Dollar General Corp.	3 573	3 438	
USD	16	Hershey Co. (The)	4 185	4 025	
USD	757	PepsiCo Inc.	186 216	170 841	
USD	34	Philip Morris International Inc.	4 431	4 714	
USD	1 792	Procter & Gamble Co. (The)	359 703	404 398	
USD	58	Tyson Foods Inc., catégorie A	4 315	4 535	
USD	5 168	Walmart Inc.	347 091	478 821	
			1 149 182	1 323 945	15,5
<b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>					
USD	20	Alphabet Inc., catégorie C	3 077	5 020	
USD	9 265	AT&T Inc.	214 337	242 272	
USD	79	Comcast Corp., catégorie A	4 198	4 233	
USD	2 239	Electronic Arts Inc.	384 366	426 870	
USD	6	Meta Platforms Inc., catégorie A	1 983	4 140	
USD	866	Sirius XM Holdings Inc.	4 999	3 354	
USD	674	T-Mobile US Inc.	135 983	162 485	
USD	7 244	Verizon Communications Inc.	364 322	408 784	
			1 113 265	1 257 158	14,7
<b>SOINS DE SANTÉ</b>					
USD	279	Bristol-Myers Squibb Co.	25 213	15 855	
USD	52	Cardinal Health Inc.	5 900	6 996	
USD	1 271	Cencora Inc.	389 708	391 836	
USD	42	CVS Health Corp.	4 181	3 394	
USD	34	Edwards Lifesciences Corp.	3 822	4 297	
USD	35	GE HealthCare Technologies Inc.	3 622	3 732	

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SOINS DE SANTÉ (suite)</b>					
USD	589	Gilead Sciences Inc.	63 943	55 297	
USD	1 808	Johnson & Johnson	394 304	361 596	
USD	38	Medtronic PLC	4 322	4 093	
USD	115	Pfizer Inc.	5 611	4 403	
USD	17	ResMed Inc.	4 555	4 453	
USD	395	UnitedHealth Group Inc.	261 063	275 254	
USD	261	Viatris Inc.	3 512	3 796	
USD	19	Zoetis Inc.	4 544	4 507	
			1 174 300	1 139 509	13,4
<b>PRODUITS INDUSTRIELS</b>					
USD	545	Automatic Data Processing Inc.	161 590	178 003	
USD	11	Caterpillar Inc.	3 504	5 014	
USD	20	Dover Corp.	3 622	4 938	
USD	11	FedEx Corp.	3 324	4 513	
USD	17	Honeywell International Inc.	4 518	4 967	
USD	15	Illinois Tool Works Inc.	4 706	4 864	
USD	48	Johnson Controls International PLC	4 025	4 366	
USD	17	L3Harris Technologies Inc.	4 402	5 224	
USD	677	Lockheed Martin Corp.	418 069	432 709	
USD	12	Norfolk Southern Corp.	3 597	3 525	
USD	38	Otis Worldwide Corp.	4 406	5 005	
USD	32	PACCAR Inc.	3 736	4 507	
USD	40	Raytheon Technologies Corp.	5 109	5 495	
USD	69	Rollins Inc.	3 856	4 607	
USD	18	Union Pacific Corp.	4 944	5 573	
USD	21	United Parcel Service Inc., catégorie B	4 799	3 932	
USD	1 485	Waste Management Inc.	326 439	433 508	
			964 646	1 110 750	13,0
<b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>					
USD	3 338	Amdocs Ltd.	407 356	360 471	
USD	972	Apple Inc.	235 714	280 132	
USD	11	Arista Networks Inc.	3 233	5 275	
USD	2	Broadcom Inc.	2 588	4 394	
USD	10	Cadence Design Systems Inc.	2 847	4 211	
USD	49	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	4 139	4 559	
USD	140	Gen Digital Inc.	3 303	4 785	
USD	1 636	International Business Machines Corp.	292 660	387 169	
USD	25	Micron Technology Inc.	3 850	4 499	
USD	11	Microsoft Corp.	4 352	6 727	
USD	12	Palo Alto Networks Inc.	3 374	5 567	
USD	26	QUALCOMM Inc.	4 081	7 086	
USD	16	Salesforce Inc.	4 206	5 629	
USD	18	Texas Instruments Inc.	4 115	4 791	
USD	11	Workday Inc., catégorie A	3 276	3 365	
			979 094	1 088 660	12,8

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>					
USD	17	Amazon.com Inc.	2 647	4 495	
USD	62	AutoZone Inc.	210 926	251 467	
USD	6	Domino's Pizza Inc.	2 699	4 239	
USD	21	Garmin Ltd.	4 760	4 682	
USD	10	Home Depot Inc. (The)	4 082	4 710	
USD	13	Lowe's Cos., Inc.	3 650	3 922	
USD	1 068	McDonald's Corp.	409 920	372 423	
USD	97	Mobileye Global Inc., catégorie A	4 624	3 728	
			643 308	649 666	7,6
<b>SERVICES PUBLICS</b>					
USD	85	Avangrid Inc.	3 629	4 132	
USD	109	CenterPoint Energy Inc.	4 347	4 621	
USD	63	Dominion Energy Inc.	4 448	4 224	
USD	28	DTE Energy Co.	4 195	4 253	
USD	2 155	Duke Energy Corp.	280 576	295 558	
USD	710	Southern Co. (The)	67 889	75 361	
			365 084	388 149	4,5
<b>MATÉRIAUX</b>					
USD	47	Ball Corp.	3 498	3 860	
USD	372	Corteva Inc.	28 993	27 457	
USD	146	Linde PLC	83 099	87 665	
USD	22	PPG Industries Inc.	3 815	3 790	
USD	13	Sherwin-Williams Co. (The)	4 216	5 309	
USD	28	Southern Copper Corp.	2 778	4 128	
			126 399	132 209	1,6
<b>ÉNERGIE</b>					
USD	46	ONEOK Inc.	3 998	5 133	
USD	17	Valero Energy Corp.	3 010	3 647	
			7 008	8 780	0,1
<b>IMMOBILIER</b>					
USD	33	CoStar Group Inc.	3 409	3 348	
USD	168	Healthpeak Properties Inc.	4 775	4 506	
			8 184	7 854	0,1
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>7 723 050</b>	<b>8 516 616</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(506)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>7 722 544</b>	<b>8 516 616</b>	<b>99,8</b>
Contrat(s) de change à terme				(5 517)	(0,1)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>7 722 544</b>	<b>8 511 099</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				26 722	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>8 537 821</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	05 juillet 2024	CAD	7 347 998	USD	5 374 255	1,37	(5 517)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>(5 517)</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(6)	-	-	(6)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	(6)	-	-	(6)

au 31 décembre 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	12	-	-	12
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	12	-	-	12
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paiements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	400 000	-	50 000	-
Parts rachetables émises	-	350 000	-	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	-	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>350 000</b>	<b>350 000</b>	<b>50 000</b>	<b>50 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,300
Parts ordinaires non couvertes	0,300

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	7	-
Garanties (hors trésorerie)	8	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	-

# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Soins de santé	14,7
Technologies de l'information	14,4
Biens de consommation de base	14,3
Services de communication	14,0
Produits industriels	14,0
Biens de consommation discrétionnaire	10,0
Services financiers	9,9
Services publics	7,4
Matériaux	0,8
Immobilier	0,2
Énergie	0,1
Contrat(s) de change à terme	0,1
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Le tableau ci-après indique dans quelle mesure l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait augmenté ou diminué si la valeur de l'indice ou des indices de référence du Fonds s'était raffermie ou affaiblie de 10 %. La variation est estimée d'après la corrélation historique entre le rendement des titres du Fonds et celui de l'indice ou des indices de référence à la fin de la période/l'exercice, toute autre variable demeurant constante. La corrélation historique n'est pas nécessairement représentative de la corrélation future; par conséquent, l'incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pourrait être différente.

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 30 juin 2024

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net de la volatilité minimale à la baisse des États-Unis (couvert en \$ CA)	845 986

Incidence sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables  
au 31 décembre 2023

Indice de référence	(\$)
Indice Solactive de rendement total net de la volatilité minimale à la baisse des États-Unis (couvert en \$ CA)	892 580

### Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	8 530	(7 354)	1 176	13,8
<b>Total</b>	<b>8 530</b>	<b>(7 354)</b>	<b>1 176</b>	<b>13,8</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.



# FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	9 081	(7 650)	1 431	15,7
<b>Total</b>	<b>9 081</b>	<b>(7 650)</b>	<b>1 431</b>	<b>15,7</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 118 000 \$ (143 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	8 517	-	-	8 517
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	(6)	-	(6)
<b>Total</b>	<b>8 517</b>	<b>(6)</b>	<b>-</b>	<b>8 511</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	9 069	-	-	9 069
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	12	-	12
<b>Total</b>	<b>9 069</b>	<b>12</b>	<b>-</b>	<b>9 081</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	3 995	2 002
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	9	1
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	4 004	2 003
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
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	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
	1	-
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>4 003</b>	<b>2 003</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Série FNB en \$ US	4 003	2 003	50,03	50,06	80 000	40 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## État du résultat global

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024
<b>Revenu</b>	
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés	
Dividendes	-
Intérêts aux fins des distributions	98
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	-
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	-
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>98</b>
Autres revenus	
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-
Rabais sur frais	-
Autres revenus	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>98</b>
<b>Charges</b>	
Frais de gestion (note 5)	2
Frais du comité d'examen indépendant	1
<b>Total des charges</b>	<b>3</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>95</b>

## État du résultat global (suite)

pour la période close le 30 juin

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie : 2024	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part : 2024	Nombre moyen pondéré de parts : 2024
Série FNB en \$ US	95	1,27	74 286

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## État de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	Série FNB en \$ US	Total du Fonds
	2024	2024
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	2 003	2 003
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	95	95
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>		
Revenu net de placement	(54)	(54)
Profits nets réalisés	(45)	(45)
Remboursement de capital	-	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(99)	(99)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>		
Produit de l'émission de parts rachetables	3 004	3 004
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 000)	(1 000)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	2 004	2 004
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	2 000	2 000
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période</b>	4 003	4 003

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

États financiers (non audité) (exprimés en \$ US)

## Tableau des flux de trésorerie

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	95
Ajustements au titre des éléments suivants :	
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	4 739
Achat de placements et de dérivés	(6 635)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-
Amortissement des produits d'intérêts	(97)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>(1 898)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(99)
Produit de l'émission de parts rachetables	3 005
Montant versé au rachat de parts rachetables	(1 000)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>1 906</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	8
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	1
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période</b>	<b>9</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>	
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-
Dividendes payés*	-
Intérêts payés*	-
Impôts à recouvrer (payés)	-

\*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.  
Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (exprimé en \$ US)

Valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>PLACEMENT(S) À COURT TERME</b>				
230 000	Obligation du Trésor américain, 4,21 %, 5 juillet 2024	229 866	229 866	
245 000	Obligation du Trésor américain, 4,711 %, 29 novembre 2024	240 126	240 126	
300 000	Obligation du Trésor américain, 4,776 %, 20 février 2025	290 648	290 648	
275 000	Obligation du Trésor américain, 4,789 %, 11 juillet 2024	274 598	274 598	
340 000	Obligation du Trésor américain, 4,849 %, 5 septembre 2024	336 932	336 932	
140 000	Obligation du Trésor américain, 4,876 %, 17 avril 2025	134 482	134 482	
310 000	Obligation du Trésor américain, 4,91 %, 8 août 2024	308 351	308 351	
250 000	Obligation du Trésor américain, 4,917 %, 20 mars 2025	241 019	241 019	
209 600	Obligation du Trésor américain, 4,942 %, 26 décembre 2024	204 449	204 449	
340 000	Obligation du Trésor américain, 5,006 %, 22 août 2024	337 493	337 493	
266 000	Obligation du Trésor américain, 5,091 %, 31 octobre 2024	261 373	261 373	
250 000	Obligation du Trésor américain, 5,123 %, 7 novembre 2024	245 375	245 375	
250 000	Obligation du Trésor américain, 5,127 %, 14 novembre 2024	245 122	245 122	
330 000	Obligation du Trésor américain, 5,135 %, 24 octobre 2024	324 539	324 539	
250 000	Obligation du Trésor américain, 5,161 %, 8 octobre 2024	246 416	246 416	
75 000	Obligation du Trésor américain, 5,165 %, 24 septembre 2024	74 075	74 075	
	<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>3 994 864</b>	<b>3 994 864</b>	<b>99,8</b>
	Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	(5 478)		
	<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>3 989 386</b>	<b>3 994 864</b>	<b>99,8</b>
	Autres actifs (passifs) nets		8 561	0,2
	<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>4 003 425</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## Commissions (note 2)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Commissions de courtage	-
Paiements indirects <sup>†</sup>	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la période close le 30 juin

	Série FNB en \$ US
	2024
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période</b>	40 000
Parts rachetables émises	60 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-
Parts rachetables rachetées	(20 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période</b>	80 000

<sup>†</sup> Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Série FNB en \$ US	0,140

## Prêts de titres (note 6)

au 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Titres prêtés	-
Garanties (hors trésorerie)	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la période close le 30 juin (en milliers de dollars)

	2024
Revenu brut tiré des prêts de titres	-
Charges	-
Revenu tiré des prêts de titres	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB marché monétaire É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Placement(s) à court terme	99,9
Autres actifs (passifs) nets	0,1
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit**	Actif net (%)
AA/Aa/A+	99,8
<b>Total</b>	<b>99,8</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit**	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	12,7
AA/Aa/A+	87,2
<b>Total</b>	<b>99,9</b>

\*Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, les placements du Fonds étaient libellés en dollars américains, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, le Fonds n'avait aucune exposition au risque de change.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB marché monétaire É.-U. CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité) (exprimé en \$ US)

## Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 an à 3 ans (en k\$)	3 à 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	3 995	-	-	-	3 995

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 an à 3 ans (en k\$)	3 à 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	2 002	-	-	-	2 002

## Hiérarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Placement(s) à court terme	-	3 995	-	3 995
Total	-	3 995	-	3 995

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Placement(s) à court terme	-	2 002	-	2 002
Total	-	2 002	-	2 002

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours des périodes closes les 30 juin 2024 et 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	17 371	23 539
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	10	13
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	56	733
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	49	56
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	17 486	24 341
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	3	142
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Frais de gestion à payer	2	3
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	-	-
Comptes créditeurs et charges à payer	3	9
	8	154
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	17 478	24 187

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires	17 478	24 187	16,07	16,26	1 087 500	1 487 500

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	421	562
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	(1 247)	(604)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	864	445
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>38</b>	<b>403</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(3)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	41	5
<b>Total des autres revenus</b>	<b>41</b>	<b>2</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>79</b>	<b>405</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	15	19
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	2
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Taxe de vente harmonisée	1	2
<b>Total des charges</b>	<b>17</b>	<b>24</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>62</b>	<b>381</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires	62	381	0,05	0,24	1 229 533	1 597 445

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	24 187	27 322	24 187	27 322
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	62	381	62	381
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>				
Revenu net de placement	(340)	(467)	(340)	(467)
Profits nets réalisés	-	-	-	-
Remboursement de capital	(5)	-	(5)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(345)	(467)	(345)	(467)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>				
Produit de l'émission de parts rachetables	16 106	1 680	16 106	1 680
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(22 532)	(3 720)	(22 532)	(3 720)
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	(6 426)	(2 040)	(6 426)	(2 040)
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	(6 709)	(2 126)	(6 709)	(2 126)
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	17 478	25 196	17 478	25 196

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	62	381
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 247	604
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(864)	(445)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	1
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	2
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	25 746	8 222
Achat de placements et de dérivés	(15 533)	(7 083)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	7	1
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	-
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(6)	2
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>10 657</b>	<b>1 685</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(345)	(467)
Produit de l'émission de parts rachetables	12 216	2 502
Montant versé au rachat de parts rachetables	(22 532)	(3 720)
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(10 661)</b>	<b>(1 685)</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	(1)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(4)	-
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	13	10
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>10</b>	<b>9</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	428	563
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
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.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>OBLIGATIONS D'ÉTAT ÉTRANGÈRES</b>					
USD	390 168	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 octobre 2025	516 150	516 261	
USD	301 175	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 avril 2026	394 298	393 666	
USD	370 042	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2026	485 408	483 522	
USD	417 508	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 octobre 2026	544 985	543 758	
USD	426 271	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 avril 2027	546 403	548 828	
USD	386 173	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2030	484 162	476 062	
USD	427 857	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2030	536 029	524 441	
USD	443 079	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2031	548 472	536 033	
USD	537 929	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 juillet 2031	659 565	647 346	
USD	494 107	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 janvier 2032	597 436	586 513	
USD	163 725	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 février 2051	153 574	130 916	
USD	189 153	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,13 %, 15 février 2052	163 772	148 550	
USD	341 861	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,25 %, 15 juillet 2029	436 592	429 772	
USD	162 142	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,25 %, 15 février 2050	158 720	136 789	
USD	440 116	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 juillet 2025	586 963	587 015	
USD	525 492	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 janvier 2027	682 090	683 526	
USD	379 262	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,38 %, 15 juillet 2027	495 155	492 395	
USD	740 789	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,5 %, 15 janvier 2028	963 908	955 026	
USD	552 690	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,63 %, 15 janvier 2026	733 864	731 596	
USD	512 401	Obligation du Trésor américain, indexées sur l'inflation, 0,63 %, 15 juillet 2032	634 458	630 054	
USD	164 953	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,63 %, 15 février 2043	187 292	170 687	
USD	337 130	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 juillet 2028	443 394	438 501	
USD	209 449	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 février 2042	245 846	225 385	
USD	250 228	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,75 %, 15 février 2045	286 338	258 390	
USD	667 809	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,88 %, 15 janvier 2029	869 759	866 043	
USD	157 108	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 0,88 %, 15 février 2047	182 303	162 698	
USD	128 310	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2046	153 344	138 033	
USD	114 391	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2048	136 141	120 817	
USD	107 118	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1 %, 15 février 2049	127 502	112 280	
USD	499 795	Obligation du Trésor américain, indexée à l'inflation, 1,13 %, 15 janvier 2033	638 964	633 968	
USD	422 152	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,25 %, 15 avril 2028	554 012	558 052	
USD	489 168	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,38 %, 15 juillet 2033	629 528	633 444	
USD	227 278	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,38 %, 15 février 2044	293 956	268 313	
USD	181 358	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,5 %, 15 février 2053	215 385	210 387	
USD	427 456	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 1,63 %, 15 octobre 2027	574 975	575 461	
USD	350 753	Obligation du Trésor américain, indexée à l'inflation, 1,75 %, 15 janvier 2034	464 460	466 951	
USD	236 103	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 avril 2029	320 851	323 627	
USD	88 457	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 février 2040	129 333	120 440	
USD	130 242	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 février 2041	190 943	177 636	
USD	92 934	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,13 %, 15 février 2054	125 891	124 769	
USD	434 898	Obligation du Trésor américain, indexée sur l'inflation, 2,38 %, 15 octobre 2028	600 915	603 069	
			17 693 136	17 371 020	99,4
		<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>	<b>17 693 136</b>	<b>17 371 020</b>	<b>99,4</b>
		Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	-	-	
		<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>	<b>17 693 136</b>	<b>17 371 020</b>	<b>99,4</b>
		Contrat(s) de change à terme		53 144	0,3
		<b>Total du portefeuille de placements</b>	<b>17 693 136</b>	<b>17 424 164</b>	<b>99,7</b>
		Autres actifs (passifs) nets		54 191	0,3
		<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>		<b>17 478 355</b>	<b>100,0</b>

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position	Position	Position	Position		
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	CAD	21 008 693	USD	15 320 331	1,37	49 715
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	2 334 306	CAD	3 189 719	0,73	3 728
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	12 569 491	CAD	17 192 923	0,73	2 769
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	126 347	CAD	172 515	0,73	334
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	03 juillet 2024	USD	290 186	CAD	397 883	0,73	(893)
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	02 août 2024	CAD	17 248 576	USD	12 618 929	1,37	(2 509)
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>53 144</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.



# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	(3)	-	53
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>56</b>	<b>(3)</b>	<b>-</b>	<b>53</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(3)	3	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(3)</b>	<b>3</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	733	(142)	-	591
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>733</b>	<b>(142)</b>	<b>-</b>	<b>591</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(142)	142	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>(142)</b>	<b>142</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	-	-
Paievements indirects†	-	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires	
	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	1 487 500	1 662 500
Parts rachetables émises	1 000 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 400 000)	(225 000)
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 087 500	1 537 500

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires	0,150

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	754	-
Garanties (hors trésorerie)	791	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
Obligations - Obligations d'état étrangères	97,3
Contrat(s) de change à terme	2,4
Autres actifs (passifs) nets	0,3
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 30 juin 2024

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	99,7
<b>Total</b>	<b>99,7</b>

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	100,3
<b>Total</b>	<b>100,3</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

### Risque de change

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2024-

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	17 422	(17 251)	171	1,0
<b>Total</b>	<b>17 422</b>	<b>(17 251)</b>	<b>171</b>	<b>1,0</b>

-Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite) au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	23 597	(23 621)	(24)	(0,1)
<b>Total</b>	<b>23 597</b>	<b>(23 621)</b>	<b>(24)</b>	<b>(0,1)</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 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 17 000 \$ (2 400 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Le ou les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, selon les dates d'échéance des contrats.

au 30 juin 2024

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	4 488	4 812	8 071	17 371

au 31 décembre 2023

	Moins de 1 an (en k\$)	1 - 3 ans (en k\$)	3 - 5 ans (en k\$)	Plus de 5 ans (en k\$)	Total (en k\$)
Exposition aux taux d'intérêt	-	6 144	6 458	10 937	23 539

Au 30 juin 2024, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2023), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 290 000 \$ (393 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	17 371	-	17 371
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	53	-	53
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>17 424</b>	<b>-</b>	<b>17 424</b>

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Obligations	-	23 539	-	23 539
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	591	-	591
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>24 130</b>	<b>-</b>	<b>24 130</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

États financiers (non audité)

## États de la situation financière

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023

(en milliers de dollars, sauf les montants par part et les parts en circulation)

	30 juin 2024	31 déc. 2023
<b>Actif</b>		
<b>Actifs courants</b>		
Placements	3 865	2 236
Placements donnés en garantie	1 021	559
Trésorerie	15	11
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	4	12
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
Dividendes à recevoir	6	4
Intérêts à recevoir	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
	4 911	2 822
<b>Passif</b>		
<b>Passifs courants</b>		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	12	8
Frais de gestion à payer	3	1
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	-	-
	15	9
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>4 896</b>	<b>2 813</b>

## États de la situation financière (suite)

au 30 juin 2024 et au 31 décembre 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 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023	30 juin 2024	31 déc. 2023
Parts ordinaires						
couvertes	1 923	939	19,23	18,78	100 000	50 000
Parts ordinaires non couvertes	2 973	1 874	19,82	18,75	150 000	100 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

États financiers (non audité)

## États du résultat global

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	2024	2023
<b>Revenu</b>		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	65	28
Intérêts aux fins des distributions	-	1
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	39	15
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(28)	7
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	195	(80)
<b>Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés</b>	<b>271</b>	<b>(29)</b>
<b>Autres revenus</b>		
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	(11)
Rabais sur frais	-	-
Autres revenus	-	-
<b>Total des autres revenus</b>	<b>-</b>	<b>(11)</b>
<b>Total des revenus</b>	<b>271</b>	<b>(40)</b>
<b>Charges</b>		
Frais de gestion (note 5)	12	5
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Retenues d'impôts	9	4
Taxe de vente harmonisée	1	1
<b>Total des charges</b>	<b>25</b>	<b>12</b>
Charges prises en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	<b>246</b>	<b>(52)</b>

## États du résultat global (suite)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin  
(en milliers de dollars, sauf les montants par part et le nombre de parts)

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par série ou par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
Parts ordinaires couvertes	140	(25)	1,59	(0,38)	87 912	67 308
Parts ordinaires non couvertes	106	(27)	0,95	(0,53)	110 989	50 000

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

États financiers (non audité)

## États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes		Total du Fonds	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	939	-	1 874	-	2 813	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	140	(25)	106	(27)	246	(52)
<b>Distributions aux porteurs de parts rachetables</b>						
Revenu net de placement	(12)	(20)	(41)	(13)	(53)	(33)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(38)	-	(24)	-	(62)	-
<b>Total des distributions aux porteurs de parts rachetables</b>	(50)	(20)	(65)	(13)	(115)	(33)
<b>Transactions sur parts rachetables</b>						
Produit de l'émission de parts rachetables	894	1 977	1 058	1 000	1 952	2 977
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
<b>Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables</b>	894	1 977	1 058	1 000	1 952	2 977
<b>Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>	984	1 932	1 099	960	2 083	2 892
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	1 923	1 932	2 973	960	4 896	2 892

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.



# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

États financiers (non audité)

## Tableaux des flux de trésorerie

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	246	(52)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	28	(7)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(195)	80
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	2	1
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 244	407
Achat de placements et de dérivés	(1 205)	(2 394)
Distributions hors trésorerie provenant des placements (Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(1)	(2)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	2
Augmentation (diminution) des frais d'administration à payer	-	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation</b>	<b>120</b>	<b>(1 965)</b>
<b>Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement</b>		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(116)	(33)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 004
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
<b>Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement</b>	<b>(116)</b>	<b>1 971</b>
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	4	6
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période ou de l'exercice	11	-
<b>Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>15</b>	<b>6</b>
<b>Informations supplémentaires :</b>		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	1
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	55	22
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.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité)

Devise	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
<b>SERVICES PUBLICS D'ÉLECTRICITÉ</b>					
USD	2 047	American Electric Power Co., Inc.	239 353	245 707	
USD	821	Constellation Energy Corp.	155 823	224 937	
USD	1 797	Duke Energy Corp.	237 767	246 404	
USD	2 502	Edison International	233 455	245 796	
USD	5 165	Exelon Corp.	267 918	244 553	
	4 668	Fortis Inc.	257 467	248 198	
USD	2 477	NextEra Energy Inc.	227 255	239 951	
USD	10 202	PG&E Corp.	236 478	243 687	
USD	2 287	Southern Co. (The)	225 378	242 696	
USD	3 363	Xcel Energy Inc.	273 729	245 726	
USD	1 688	Entergy Corp.	245 440	247 091	
	6 383	Hydro One Ltd.	244 692	254 362	
			2 844 755	2 929 108	59,8
<b>SERVICES PUBLICS DIVERSIFIÉS</b>					
USD	1 975	Consolidated Edison Inc.	248 851	241 604	
USD	3 628	Dominion Energy Inc.	251 931	243 201	
USD	1 615	DTE Energy Co.	241 269	245 266	
USD	2 449	Public Service Enterprise Group Inc.	215 521	246 921	
USD	2 378	Sempra Energy	239 370	247 439	
USD	2 280	WEC Energy Group Inc.	261 618	244 729	
			1 458 560	1 469 160	30,0
<b>WATER UTILITIES</b>					
USD	1 382	American Water Works Co., Inc.	249 840	244 196	5,0
<b>PRODUCTEURS D'ÉNERGIE INDÉPENDANTS ET NÉGOCIANTS D'ÉNERGIE</b>					
USD	2 070	Vistra Corp.	248 062	243 484	5,0
<b>Total du portefeuille de placements avant commissions et autres coûts de transaction de portefeuille</b>			<b>4 801 217</b>	<b>4 885 948</b>	<b>99,8</b>
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille			(2 734)		
<b>Total du portefeuille de placements avant les dérivés</b>			<b>4 798 483</b>	<b>4 885 948</b>	<b>99,8</b>
Contrat(s) de change à terme				4 309	0,1
Position(s) vendeur sur option(s)				(11 525)	(0,2)
<b>Total du portefeuille de placements</b>			<b>4 798 483</b>	<b>4 878 732</b>	<b>99,7</b>
Autres actifs (passifs) nets				17 044	0,3
<b>Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables</b>				<b>4 895 776</b>	<b>100,0</b>

## Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée		Devise vendue		Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
			Position		Position			
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	CAD	1 773 267	USD	1 293 641	1,37	4 296
Bank of New York Mellon (The), New York	A-1+	22 juillet 2024	USD	31 039	CAD	42 430	0,73	13
<b>Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme</b>								<b>4 309</b>

\*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

Les pourcentages indiqués représentent les placements à la juste valeur par rapport à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2024 (non audité) (suite)

## Position(s) vendeur sur option(s)

Contrat(s)	Participation sous-jacente	Taille du lot par contrat	Date d'expiration	Prix d'exercice (\$)	Devise	Prime payée (reçue) (\$)	Juste valeur (\$)
(5)	American Electric Power Co. Inc., (option d'achat) – 90,00	100	19 juillet 2024	90,00	USD	(438)	(359)
(3)	American Water Works Co., Inc., (option d'achat) – 135,00	100	19 juillet 2024	135,00	USD	(423)	(267)
(4)	Consolidated Edison Inc., (option d'achat) – 92,50	100	19 juillet 2024	92,50	USD	(433)	(123)
(2)	Constellation Energy Corp., (option d'achat) – 220,00	100	19 juillet 2024	220,00	USD	(2 652)	(581)
(9)	Dominion Energy Inc., (option d'achat) – 50,00	100	19 juillet 2024	50,00	USD	(986)	(493)
(4)	DTE Energy Co., (option d'achat) – 115,00	100	19 juillet 2024	115,00	USD	(460)	(287)
(4)	Duke Energy Corp., (option d'achat) – 105,00	100	19 juillet 2024	105,00	USD	(110)	(68)
(6)	Edison International, (option d'achat) – 72,50	100	19 juillet 2024	72,50	USD	(690)	(472)
(4)	Entergy Corp., (option d'achat) – 110,00	100	19 juillet 2024	110,00	USD	(323)	(315)
(12)	Exelon Corp., (option d'achat) – 35,00	100	19 juillet 2024	35,00	USD	(970)	(698)
(11)	Fortis Inc., (option d'achat) – 54,00	100	19 juillet 2024	54,00	CAD	(385)	(380)
(15)	Hydro One Ltd., (option d'achat) – 39,00	100	19 juillet 2024	39,00	CAD	(720)	(1 733)
(6)	NextEra Energy Inc., (option d'achat) – 75,00	100	19 juillet 2024	75,00	USD	(805)	(353)
(25)	PG&E Corp., (option d'achat) – 18,00	100	19 juillet 2024	18,00	USD	(651)	(308)
(6)	Public Service Enterprise Group Inc., (option d'achat) – 75,00	100	19 juillet 2024	75,00	USD	(608)	(1 375)
(5)	Sempra Energy, (option d'achat) – 80,00	100	19 juillet 2024	80,00	USD	(62)	(68)
(5)	Southern Co. (La), (option d'achat) – 80,00	100	19 juillet 2024	80,00	USD	(548)	(205)
(5)	Vitesse Energy Inc., (option d'achat) – 87,50	100	19 juillet 2024	87,50	USD	(3 753)	(2 565)
(5)	WEC Energy Group Inc., (option d'achat) – 80,00	100	19 juillet 2024	80,00	USD	(671)	(410)
(8)	Xcel Energy Inc., (option d'achat) – 55,00	100	19 juillet 2024	55,00	USD	(669)	(465)
<b>Valeur totale de la (des) position(s) vendeur sur option(s)</b>						<b>(16 357)</b>	<b>(11 525)</b>

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Compensation des instruments financiers (note 2)

Le ou les tableaux suivants montrent l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds de l'exercice de tous les droits à compensation.

au 30 juin 2024

	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	4	-	-	4
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>4</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

au 31 décembre 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	12	-	-	12
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>12</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12</b>
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Commissions (note 2)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Commissions de courtage	2	1
Paielements indirects†	1	-

## Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin

	Parts ordinaires couvertes		Parts ordinaires non couvertes	
	2024	2023	2024	2023
<b>Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période ou de l'exercice</b>	50 000	-	100 000	-
Parts rachetables émises	50 000	100 000	50 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-
<b>Nombre de parts rachetables à la clôture de la période ou de l'exercice</b>	<b>100 000</b>	<b>100 000</b>	<b>150 000</b>	<b>50 000</b>

†Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.

Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2024 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels (%) :
Parts ordinaires couvertes	0,650
Parts ordinaires non couvertes	0,650

## Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

## Rapprochement du revenu tiré des prêts de titres (note 6)

pour la ou les périodes ou l'exercice ou les exercices clos(es) le(s) 30 juin (en milliers de dollars)

	2024	2023
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
<b>Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres</b>	-	28,6

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risques liés aux instruments financiers (note 10)

### Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2024, consultez l'inventaire du portefeuille.

au 31 décembre 2023

Catégories	Actif net (%)
<b>Position(s) acheteur</b>	
Services Publics d'Électricité	64,6
Services publics diversifiés	29,8
Services publics d'aqueduc	5,0
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Contrat(s) de change à terme	0,4
<b>Total de la (des) position(s) acheteur</b>	<b>100,3</b>
<b>Position(s) vendeur</b>	
Option(s)	(0,3)
<b>Total de la (des) position(s) vendeur</b>	<b>(0,3)</b>
<b>Total</b>	<b>100,0</b>

### Risque de crédit

Au 30 juin 2024, l'exposition l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Le Fonds investissait dans des titres à revenu fixe, des actions privilégiées et des dérivés, le cas échéant, dont les notes de crédit sont présentées dans le ou les tableaux ci-dessous.

au 31 décembre 2023

Note de crédit <sup>A*</sup>	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	0,5
<b>Total</b>	<b>0,5</b>

<sup>A</sup>Les notes de crédit proviennent de S&P Global Ratings, lorsqu'elles sont disponibles, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement.

\*Veuillez consulter la note 10 qui contient un tableau des différentes notes de crédit.

### Autre risque de prix

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisqu'une partie de ses actifs était investie dans des actions.

Au 30 juin 2024, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 489 000 \$ (279 000 \$ au 31 décembre 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 juin 2024~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette (en k\$)	Actif net (%)
	(en k\$)	Dérivés (en k\$)		
Dollar américain	4 394	(1 736)	2 658	54,3
<b>Total</b>	<b>4 394</b>	<b>(1 736)</b>	<b>2 658</b>	<b>54,3</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

# FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI

Notes des états financiers propres au Fonds (non audité)

## Risque de change (suite)

au 31 décembre 2023~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net
	(en k\$)	(en k\$)	(en k\$)	(%)
Dollar américain	2 523	(835)	1 688	60,0
<b>Total</b>	<b>2 523</b>	<b>(835)</b>	<b>1 688</b>	<b>60,0</b>

~Comprend les instruments monétaires et non monétaires, le cas échéant.

Au 30 juin 2024, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10% au 31 décembre 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 266 000 \$ (168 000 \$ au 31 décembre 2023). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

## Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

## Hierarchie des justes valeurs

Le ou les tableaux ci-dessous résument les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds comptabilisés à la juste valeur.

### Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	4 886	-	-	4 886
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	4	-	4
<b>Total</b>	<b>4 886</b>	<b>4</b>	<b>-</b>	<b>4 890</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 30 juin 2024

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(12)	-	-	(12)
<b>Total</b>	<b>(12)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(12)</b>

### Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Actions	2 795	-	-	2 795
Contrat(s) de change à terme (montant net)	-	12	-	12
<b>Total</b>	<b>2 795</b>	<b>12</b>	<b>-</b>	<b>2 807</b>

### Positions vendeur à la juste valeur au 31 décembre 2023

	Niveau 1 (en k\$)	Niveau 2 (en k\$)	Niveau 3 (en k\$)	Total (en k\$)
Option(s)	(8)	-	-	(8)
<b>Total</b>	<b>(8)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(8)</b>

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2024 et de l'exercice clos le 31 décembre 2023.



# Notes des états financiers (non audité)

## 1. LES FONDS

Les Fonds énumérés sous le titre Catégorie de société dans le tableau ci-dessous sont des séries d'actions de fonds négociés en Bourse (FNB) de CI First Asset Fund Corp. (Fund Corporation) et ont été établis en vertu des lois de la province de l'Ontario en tant que société de fonds communs de placement le 28 juin 2010. Chaque série d'actions est désignée individuellement comme un « Fonds de catégorie de société » (le Fonds de catégorie de société, et collectivement les Fonds de catégorie de société). Les présents états financiers contiennent l'information financière de chacune des séries en tant qu'entité publiante distincte.

Les autres Fonds (individuellement, une Fiducie, et collectivement, les Fiducies) étaient établis comme des fonds de placement constitués sous le régime des lois de la province de l'Ontario et régis par une déclaration de fiducie.

Chaque FNB est désigné individuellement comme un Fonds et collectivement comme les Fonds.

CI Investments Inc. est le gestionnaire et le fiduciaire (le « gestionnaire » et le « fiduciaire ») des Fonds. Le gestionnaire est une filiale en propriété exclusive de CI Financial Corp. (Bourse de Toronto [TSX] : CIX). La Compagnie Trust CIBC Mellon est le dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds. Au nom du Fonds de lingots d'or CI, le dépositaire a conclu une convention de sous-dépositaire avec la Banque Canadienne Impériale de Commerce (le « sous-dépositaire »). Le sous-dépositaire a conclu un autre contrat de sous-dépositaire avec JPMorgan Chase Bank, N.A. (le « dépositaire de l'or ») pour assurer la garde physique des lingots d'or du Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, 2<sup>e</sup> étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 22 août 2024.

L'objectif de chaque Fonds est de mettre en commun et de gérer l'argent versé par des investisseurs, porteurs de parts ou actionnaires ayant des objectifs de placement semblables. Les Fonds peuvent investir dans des actions, des titres à revenu fixe, des dérivés, un ou des fonds sous-jacents ou une combinaison de ceux-ci en fonction de leurs objectifs et stratégies de placement. Les Fonds peuvent détenir des placements en vue d'obtenir un revenu ou une plus-value en capital ou les deux.

Le tableau ci-dessous présente les objectifs de placement de chaque Fonds :

Fonds	Objectifs de placement
<b>FIDUCIES</b>	
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnées 1-5 ans FTSE Canada <sup>MC</sup> , déduction faite des frais. Le Fonds investit principalement dans des obligations à coupons détachés, à la fois les coupons et les obligations résiduelles, provenant d'obligations du gouvernement fédéral et des gouvernements provinciaux canadiens émises sur le marché canadien et libellées en dollars canadiens.
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	Le Fonds cherche à procurer une combinaison de croissance du capital à long terme et un niveau modéré de revenu, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme ainsi qu'un potentiel de revenu modéré, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	Le Fonds cherche à procurer une combinaison de revenu et une croissance modérée du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres à revenu fixe et de titres de capitaux propres mondiaux.
FNB indiciel biorévolution CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice mondial du secteur de la biotechnologie et de la génomique, déduction faite des frais. Le Fonds tente actuellement de reproduire le rendement de l'indice Solactive Global Genomics Immunology and Medical Revolution CAD Hedged NTR (l'indice). L'indice suit le rendement de sociétés qui exercent leurs activités dans le secteur mondial de la biotechnologie et de la génomique au moyen du système de classification ARTIS <sup>MD</sup> . L'indice couvre l'exposition aux devises par rapport au dollar canadien.
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (i) des distributions en espèces trimestrielles; et (ii) la possibilité d'une plus-value du capital en investissant principalement dans un portefeuille à capitalisation pondérée d'obligations convertibles d'émetteurs canadiens.
FNB Indice d'actions canadiennes CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice d'actions canadiennes étendu, déduction faite des frais. À l'heure actuelle, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive Canada Broad Market Index, déduction faite des frais.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
<b>FIDUCIES (suite)</b>	
FNB de FPI canadiennes CI	Le Fonds cherche à obtenir des rendements totaux à long terme, composés de revenus réguliers et d'une appréciation du capital à long terme, à partir d'un portefeuille géré activement, composé principalement de titres de sociétés de placement immobilier canadiennes, de sociétés d'exploitation immobilière et d'entités participant à des services liés à l'immobilier.
FNB de répartition de l'actif prudent CI	Le Fonds cherche à procurer un revenu et un potentiel de croissance modérée du capital en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres à revenu fixe et de titres de capitaux propres mondiaux.
FNB indiciel sécurité numérique CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice mondial du secteur de la sécurité numérique, déduction faite des frais. Le Fonds tente actuellement de reproduire le rendement de l'indice Solactive Digital Security CAD Hedged Index NTR (l'indice). L'indice suivre le rendement de sociétés qui exercent leurs activités dans le secteur mondial de la sécurité numérique au moyen du système de classification ARTIS <sup>MD</sup> . L'indice couvre l'exposition aux devises par rapport au dollar canadien.
FNB alpha Marchés émergents CI	Le Fonds cherche à fournir une croissance maximale du capital à long terme à partir d'un portefeuille géré activement, en investissant principalement dans des actions et des titres liés à des actions de sociétés ayant un bon potentiel de croissance, situées sur des marchés émergents ou servant des clients sur des marchés émergents.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions trimestrielles en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres des 15 plus grandes sociétés énergétiques mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes.
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	Le Fonds cherche à procurer des rendements à long terme en réalisant un revenu d'intérêts et une plus-value du capital. Le Fonds investit principalement dans des titres de créance d'État, mais il peut aussi investir dans un vaste éventail de titres de créance, y compris des liquidités, des titres de créance de sociétés et des titres de créance et des dérivés de crédit.
FNB de répartition de l'actif en actions CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres mondiaux.
FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity couvert en \$ CA, déduction faite des frais.
FNB indiciel métavers CI Galaxy	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds couvert en \$ CA, déduction faite des frais.
FNB alpha Innovation mondiale CI	Le Fonds cherche à fournir une croissance maximale du capital à long terme à partir d'un portefeuille géré activement qui investit principalement dans des actions et des titres apparentés à des actions de sociétés du monde entier qui sont positionnées pour bénéficier d'innovations et de progrès dans la technologie, les produits, les processus ou les services.
FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise	L'objectif de placement du Fonds est de maximiser la plus-value du capital à long terme en investissant principalement dans des titres de capitaux propres mondiaux de sociétés qui participent activement à la recherche, au développement et à l'application de technologies d'intelligence artificielle.
FNB Secteur financier mondial CI	Le Fonds cherche à obtenir un rendement global à long terme qui consiste en une plus-value du capital à long terme et en un revenu de dividendes régulier à partir d'un portefeuille géré activement et composé principalement de titres de capitaux propres d'émetteurs du secteur des services financiers à l'échelle mondiale.
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	Le Fonds cherche à répliquer, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice mondial de la santé, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive Developed Markets Healthcare 150 CAD, déduction faite des frais.
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	L'objectif de placement du Fonds de procurer un revenu et le potentiel d'une plus-value du capital à long terme en investissant principalement dans un portefeuille diversifié de titres à revenu fixe de qualité supérieure émis par des sociétés ou des gouvernements de toute taille, situés n'importe où dans le monde.
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Solactive DM Minimum Downside Volatility Hedged to CAD Index NTR (l'indice couvert), déduction faite des frais. En ce qui concerne les parts ordinaires non couvertes, a été conçu afin de reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Solactive DM Minimum Downside Volatility CAD Index NTR (l'indice non couvert et, avec l'indice couvert, les indices), déduction faite des frais. Le Fonds investit et détient, dans la mesure du possible, les titres constitutifs des indices dans une proportion sensiblement la même que celle reflétée dans les indices.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

<b>Fonds (suite)</b>	<b>Objectifs de placement</b>
<b>FIDUCIES (suite)</b>	
Fonds de lingots d'or CI	L'objectif d'investissement du Fonds est de fournir aux porteurs de parts une exposition à l'or. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit et détient la quasi-totalité de ses actifs dans des lingots d'or à long terme afin d'offrir aux investisseurs un moyen rentable et pratique d'investir dans l'or.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions trimestrielles en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres des 15 plus grandes sociétés d'or et de métaux précieux mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes. Les émetteurs compris dans le portefeuille, sélectionnés en fonction de la capitalisation boursière, peuvent être remplacés en fonction de l'opinion du gestionnaire de portefeuille quant à la liquidité des titres de capitaux propres des émetteurs et de leurs options d'achat connexes.
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme, principalement en investissant dans des FNB qui offrent une exposition à un portefeuille de titres de capitaux propres et de titres à revenu fixe mondiaux.
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, par le biais d'un portefeuille géré activement, ce qui suit : (i) des distributions régulières en espèces; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital en investissant à parts égales dans un portefeuille de titres de participation d'au moins 20 des plus grandes sociétés de soins de santé mesurées en fonction de leur capitalisation boursière et cotées sur une Bourse nord-américaine; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille de titres de ces émetteurs, en utilisant un programme de vente d'options d'achat couvertes. Les émetteurs compris dans le portefeuille, sélectionnés en fonction de la capitalisation boursière, peuvent être remplacés en fonction de l'opinion du gestionnaire de portefeuille quant à la liquidité des titres de capitaux propres des émetteurs et de leurs options d'achat connexes.
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	Le Fonds cherche à optimiser le revenu mensuel pour les porteurs de parts tout en préservant le capital et les liquidités en investissant principalement dans des comptes de dépôt à intérêts élevés.
FNB marché monétaire CI	Le Fonds cherche à d'obtenir un revenu au taux de rendement le plus élevé possible tout en préservant le capital et la liquidité. Il investit surtout dans des instruments du marché monétaire échéant dans moins de 365 jours.
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	Le Fonds cherche à fournir aux porteurs de parts des distributions en espèces mensuelles et à maximiser les rendements totaux pour les porteurs de parts, composés principalement de distributions mensuelles, tout en réduisant le risque et en préservant le capital. Dans des conditions de marché normales, le Fonds investit principalement dans des obligations et des titres de créance de première qualité.
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Canada Target Momentum Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Canada Target Value Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Momentum Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® Developed Markets ex-North America Target Value Index™, déduction faite des frais.
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Morningstar® National Bank Québec Index™, déduction faite des frais.
FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels couvert en dollars canadiens, déduction faite des frais, et relativement aux parts ordinaires non couvertes, l'objectif de placement du Fonds est de reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice MSCI World ESG Select Impact ex Fossil Fuels, déduction faite des frais.
FNB d'actions privilégiées CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (a) des distributions régulières; et (b) un potentiel d'appréciation du capital résultant du rendement dégagé par un portefeuille composé principalement d'actions privilégiées émises par des sociétés nord-américaines.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
<b>FIDUCIES (suite)</b>	
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	Le Fonds cherche à offrir aux porteurs de parts, grâce à un portefeuille géré activement : (i) des distributions en espèces trimestrielles; (ii) la possibilité d'une plus-value du capital en investissant selon une pondération égale dans un portefeuille de titres d'au moins 25 des plus grandes sociétés de technologie mesurées en fonction de leur capitalisation boursière, dont les actions ordinaires sont inscrites à une Bourse nord-américaine dans la catégorie Technologie de l'information de la classification CIGS, ainsi que celles dans les sous-catégories Marketing de détail direct et en ligne, Divertissement à domicile interactif et Médias et services interactifs de la classification CIGS ou d'autres sous-catégories, si le gestionnaire le juge indiqué, mais qui ne font pas partie de la sous-catégorie Services de traitement de données et d'impartition de cette classification, et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que subirait un porteur qui serait propriétaire d'un portefeuille de titres de ces émetteurs directement, en ayant recours à un programme de vente d'options d'achat couvertes.
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	Le Fonds cherche à procurer aux porteurs de parts : (i) des distributions en espèces trimestrielles; (ii) la possibilité d'une plus-value du capital; et (iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que subirait un porteur qui serait propriétaire d'un portefeuille composé d'actions ordinaires de sociétés cotées en Bourse qui font partie des dix plus importantes sociétés canadiennes et américaines d'assurance-vie, selon leur capitalisation boursière.
FNB Indice 1000 É.-U. CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un large indice boursier américain, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive GBS United States 1000 CAD, déduction faite des frais.
FNB Indice 500 É.-U. CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un large indice boursier américain, déduction faite des frais. Actuellement, le Fonds cherche à reproduire le rendement de l'indice Solactive GBS United States 500 CAD, déduction faite des frais.
FNB indiciel momentum amélioré américain CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un portefeuille de titres de capitaux propres américains à partir du rendement des cours pondéré en fonction du temps et ajusté en fonction du risque au cours des périodes de mesure précisées qui présentent des caractéristiques de qualité supérieure, déduction faite des frais. Le Fonds tente actuellement de reproduire le rendement de l'indice VettaFi US Enhanced Momentum (couvert en \$ CA).
FNB indiciel valeur améliorée américain CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un portefeuille de titres de capitaux propres américains à grande et à moyenne capitalisation qui présentent des caractéristiques de valeur élevée, déduction faite des frais. Le Fonds tente actuellement de reproduire le rendement de l'indice VettaFi US Enhanced Value (couvert en \$ CA).
FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI	L'objectif de placement du Fonds est de reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Solactive US Minimum Downside Volatility Hedged to CAD Index NTR (l'indice couvert), déduction faite des frais. En ce qui concerne les parts ordinaires non couvertes, le Fonds a été conçu afin de reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice Solactive US Minimum Downside Volatility CAD Index NTR (l'indice non couvert et, avec l'indice couvert, les indices), déduction faite des frais. Le Fonds investit et détient, dans la mesure du possible, les titres constitutifs des indices dans une proportion sensiblement la même que celle reflétée dans les indices.
FNB marché monétaire É.-U. CI	Le Fonds cherche à d'obtenir un revenu au taux de rendement le plus élevé possible tout en préservant le capital et la liquidité. Il investit surtout dans des instruments du marché monétaire libellés en dollars américains échéant dans moins de 365 jours.
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement de l'indice des titres du Trésor américain protégés contre l'inflation et couverts en dollars canadiens, déduction faite des frais. Actuellement, le FNB cherche à reproduire l'indice TR des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) de Solactive.
FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI	L'objectif de placement du Fonds est de consiste à procurer aux porteurs de parts, grâce à un portefeuille géré activement, tel que décrit ci-dessous, i) des distributions au comptant régulières; ii) la possibilité d'une plus-value en capital en investissant selon une pondération égale dans un portefeuille de titres de capitaux propres comprenant au moins les 20 plus grandes sociétés du secteur des services publics, en fonction de la capitalisation boursière, inscrites à la cote d'une bourse nord-américaine; et iii) une volatilité globale des rendements du portefeuille inférieure à celle que subirait un porteur qui serait propriétaire d'un portefeuille de titres de ces émetteurs directement. Les émetteurs compris dans le portefeuille, sélectionnés en fonction de la capitalisation boursière, peuvent être remplacés en fonction de l'opinion du gestionnaire de portefeuille quant à la liquidité des titres de capitaux propres des émetteurs et de leurs options d'achat connexes.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Objectifs de placement
<b>FONDS DE CATÉGORIE DE SOCIÉTÉ</b>	
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	Le Fonds cherche à fournir aux actionnaires : (i) des distributions trimestrielles; (ii) la possibilité d'une appréciation du capital; et (iii) une volatilité globale du rendement du portefeuille inférieure à celle que l'on obtiendrait en détenant directement un portefeuille d'actions ordinaires de la Banque de Montréal, de la Banque Canadienne Impériale de Commerce, de la Banque Nationale du Canada, de la Banque Royale du Canada, de la Banque de Nouvelle-Écosse et de la Banque Toronto-Dominion.
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure du possible, le rendement d'un indice représentant les obligations à court terme du gouvernement du Canada, soit, actuellement l'indice des obligations du gouvernement à court terme FTSE Canada, déduction faite des frais.

Le Fonds offre des parts ordinaires, des parts ordinaires couvertes, des parts ordinaires non couvertes, des parts ordinaires couvertes en \$ US, des parts de la série FNB \$ CA, des parts de la série FNB couvertes en \$ CA, des parts de la série FNB non couvertes en \$ CA, des parts de la série FNB en \$ US, des parts de la série FNB couvertes en \$ US. L'exposition des titres non couverts d'un Fonds à des monnaies autres que le dollar canadien/américain n'est pas couverte par rapport au dollar canadien/américain, le cas échéant. Par conséquent, la valeur liquidative attribuable aux porteurs de parts/d'actions rachetables par part/action de chaque série ne sera pas la même en raison des frais différents attribuables à chaque série de parts/d'actions et/ou de la stratégie de couverture du risque de change différente, le cas échéant.

Le tableau qui suit indique la date à laquelle chaque Fonds a été établi ou la date du premier appel public à l'épargne inscrite dans le prospectus pour les Fonds établis initialement à titre de fiducies de placement à capital fixe (date de création). La date à laquelle chaque série de titres de chaque Fonds a commencé à être négociée à la Bourse de Toronto (« TSX ») ou à la Neo Exchange Inc. (« NEO ») sous forme de FNB (« date de lancement ») est aussi indiquée ci-dessous.

Fonds	Symbole de TSX	Parts ordinaires	Parts ordinaires couvertes	Parts ordinaires non couvertes (\$ CA et/ou \$ US)	Parts ordinaires couvertes en \$ US	Parts de série FNB en \$ CA
<b>FIDUCIES</b>						
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI	BXF	11 juin 2013	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif équilibré CI	CBAL	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI	CBGR	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI	CBIN	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB indiciel biorévolution CI	CDNA	24 févr. 2022	-	-	-	-
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI	CXF	7 juin 2011	-	-	-	-
FNB Indice d'actions canadiennes CI	CCDN	12 août 2021**	-	-	-	-
FNB de FPI canadiennes CI	RIT	14 juill. 2015	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif prudent CI	CCNV	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB indiciel sécurité numérique CI	CBUG	24 févr. 2022	-	-	-	-
FNB alpha Marchés émergents CI	CIEM / CIEM.U	-	-	-	-	26 août 2021
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	NXF / NXFB / NXFU	-	10 févr. 2015*	10 févr. 2015	3 mars 2022	-
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	FGO / FGO.U	-	31 juill. 2018*	-	31 juill. 2018***	-
FNB de répartition de l'actif en actions CI	CEQT	17 mai 2023	-	-	-	-
FNB Chaîne de blocs CI Galaxy	CBCX	28 avr. 2022	-	-	-	-
FNB Métavers CI Galaxy	CMVX	28 avr. 2022	-	-	-	-
FNB alpha Innovation mondiale CI	CINV / CINV.U	-	-	-	-	12 août 2021
FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise	CIAI	-	-	-	-	7 mai 2024
FNB Secteur financier mondial CI	FSF	25 avr. 2016	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	CHCL.B	-	-	12 août 2021	-	-
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	CGIN/CGIN.U	-	-	-	-	1 <sup>er</sup> nov. 2022
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	CGDV/CGDV.B	-	16 déc. 2022	16 déc. 2022	-	-
Fonds de lingots d'or CI	VALT / VALT.U / VALT.B	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	CGXF / CGXF.U	-	4 juin 2011*	-	3 mars 2022	-
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	CGRO	17 mai 2023	-	-	-	-

\*Auparavant des parts ordinaires

\*\*Auparavant des parts ordinaires non couvertes

\*\*\*Auparavant des parts ordinaires \$ US

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds (suite)	Symbole de TSX	Parts ordinaires	Parts ordinaires couvertes	Parts ordinaires	Parts ordinaires couvertes en \$ US	Parts de série FNB en \$ CA
				non couvertes (\$ CA et/ou \$ US)		
<b>FIDUCIES (suite)</b>						
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	FHI / FHI.B / FHI.U	-	7 juin 2018*	7 juin 2018	3 mars 2022	-
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	CSAV	14 juin 2019	-	-	-	-
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	FIG / FIG.U	-	22 août 2016*	-	12 déc. 2017***	-
FNB marché monétaire CI	CMNY	-	-	-	-	25 juil. 2023
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	WXM	15 févr. 2012	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	FXM	15 févr. 2012	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	ZXM / ZXM.B	-	18 nov. 2014*	18 nov. 2014	-	-
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	VXM / VXM.B	-	18 nov. 2014*	18 nov. 2014	-	-
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	QXM	6 févr. 2012	-	-	-	-
FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI	CESG / CESG.B	-	12 sept. 2019*	12 sept. 2019	-	-
FNB d'actions privilégiées CI	FPR	17 mai 2016	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	TXF / TXF.B / TXF.U	-	26 oct. 2011*	31 août 2017	3 mars 2022	-
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	FLI	-	3 sept. 2014*	-	-	-
FNB Indice 1000 É.-U. CI	CUSM.B	-	-	12 août 2021	-	-
FNB Indice 500 É.-U. CI	CUSA.B	-	19 avr. 2024	12 août 2021	-	-
FNB indiciel momentum amélioré américain CI	CMOM / CMOM.B	-	15 déc. 2023	15 déc. 2023	-	-
FNB indiciel valeur améliorée américain CI	CVLU / CVLU.B	-	15 déc. 2023	15 déc. 2023	-	-
FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI	CUDV / CUDV.B	-	16 déc. 2022	16 déc. 2022	-	-
FNB marché monétaire É.-U. CI	UMNY.U	-	-	-	-	-
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	CTIP	26 août 2021	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI	CUTL / CUTL.B	-	16 déc. 2022	16 déc. 2022	-	-
<b>CATÉGORIES DE SOCIÉTÉ</b>						
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	CIC	-	-	-	-	-
FNB Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	FGB	-	-	-	-	-
Fonds (suite)		Parts de série FNB couvertes en \$ CA	Parts de série FNB non couvertes en \$ CA	Parts de série FNB en \$ US	Parts de série FNB couvertes en \$ US	Actions de catégories de société (actions de FNB)
<b>FIDUCIES (suite)</b>						
FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI		-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif équilibré CI		-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI		-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI		-	-	-	-	-
FNB indiciel biorévolution CI		-	-	-	-	-
FNB d'obligations convertibles canadiennes CI		-	-	-	-	-
FNB Indice d'actions canadiennes CI		-	-	-	-	-
FNB de FPI canadiennes CI		-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif prudent CI		-	-	-	-	-
FNB indiciel sécurité numérique CI		-	-	-	-	-
FNB alpha Marchés émergents CI		-	-	-	26 août 2021	-

\*Auparavant des parts ordinaires

\*\*\*Auparavant des parts ordinaires \$ US

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

	Parts de série FNB couvertes en \$ CA	Parts de série FNB non couvertes en \$ CA	Parts de série FNB en \$ US	Parts de série FNB couvertes en \$ US	Actions de catégories de société (actions de FNB)
<b>Fonds (suite)</b>					
<b>FIDUCIARIES (suite)</b>					
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI	-	-	-	-	-
FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI	-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif en actions CI	-	-	-	-	-
FNB Chaîne de blocs CI Galaxy	-	-	-	-	-
FNB Métavers CI Galaxy	-	-	-	-	-
FNB alpha Innovation mondiale CI	-	-	-	12 août 2021	-
FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise	-	-	-	-	-
FNB Secteur financier mondial CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI	-	-	-	-	-
FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI	-	-	-	1 <sup>er</sup> nov. 2022	-
FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	-	-	-	-	-
Fonds de lingots d'or CI	6 janv. 2021	17 mars 2021	6 janv. 2021	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI	-	-	-	-	-
FNB de répartition de l'actif de croissance CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI	-	-	-	-	-
FNB d'épargne à intérêt élevé CI	-	-	-	-	-
FNB d'obligations de qualité supérieure CI	-	-	-	-	-
FNB marché monétaire CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Momentum CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar International Valeur CI	-	-	-	-	-
FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI	-	-	-	-	-
FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI	-	-	-	-	-
FNB d'actions privilégiées CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI	-	-	-	-	-
FNB Indice 1000 É.-U. CI	-	-	-	-	-
FNB Indice 500 É.-U. CI	-	-	-	-	-
FNB indiciel momentum amélioré américain CI	-	-	-	-	-
FNB indiciel valeur améliorée américain CI	-	-	-	-	-
FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI	-	-	-	-	-
FNB marché monétaire É.-U. CI	-	-	25 juil. 2023	-	-
FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI	-	-	-	-	-
FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI	-	-	-	-	-
<b>CATÉGORIES DE SOCIÉTÉ (suite)</b>					
FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI	-	-	-	-	24 sept. 2015
Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI	-	-	-	-	1 <sup>er</sup> mars 2016

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Le 5 avril 2024, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI	FNB indiciel momentum amélioré américain CI
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI	FNB indiciel valeur améliorée américain CI
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI	FNB Indice de croissance de dividendes sur titres canadiens de qualité CI
FNB Indice Chefs de file américains CI	FNB indiciel momentum amélioré américain CI

Le gestionnaire a utilisé la méthode de l'acquisition pour comptabiliser la fusion des Fonds. Selon cette méthode, l'un des Fonds est désigné le Fonds acquéreur et est désigné le « Fonds prorogé » et l'autre Fonds visé par la fusion est désigné le « Fonds clôturé ». Cette désignation est fondée sur la comparaison de la valeur liquidative relative des Fonds, ainsi que sur la prise en compte du maintien de certaines caractéristiques du Fonds prorogé, telles que les objectifs et procédures de placement et les types de titres en portefeuille.

Le 5 avril 2024, à la clôture des bureaux, les Fonds prorogés ont acquis la totalité de l'actif net des Fonds clôturés en échange de titres des Fonds prorogés. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de ces fusions correspondait aux actifs nets transférés des Fonds clôturés. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont eu lieu sur une base de report d'impôt, à l'exception du Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI :

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis (\$)	Parts émises
FNB Indice Morningstar États-Unis Momentum CI	FNB indiciel momentum amélioré américain CI	20 736 657	887 518
FNB Indice Morningstar États-Unis Valeur CI	FNB indiciel valeur améliorée américain CI	16 029 594	742 733
Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI	FNB Indice de croissance de dividendes sur titres canadiens de qualité CI	13 106 486	338 472
FNB Indice Chefs de file américains CI	FNB indiciel momentum amélioré américain CI	14 458 363	623 576

Les résultats des Fonds clôturés ne figurent pas dans ces états financiers.

Le 31 mars 2023, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé	Fonds prorogé
FNB Indice MSCI Monde Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI
FNB Indice MSCI Europe Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI

Le gestionnaire a utilisé la méthode de l'acquisition pour comptabiliser la fusion des Fonds. Selon cette méthode, l'un des Fonds est désigné le Fonds acquéreur et est désigné le « Fonds prorogé » et l'autre Fonds visé par la fusion est désigné le « Fonds clôturé ». Cette désignation est fondée sur la comparaison de la valeur liquidative relative des Fonds, ainsi que sur la prise en compte du maintien de certaines

caractéristiques du Fonds prorogé, telles que les objectifs et procédures de placement et les types de titres en portefeuille.

Le 31 mars 2023, à la clôture des bureaux, le Fonds prorogé a acquis la totalité de l'actif net du Fonds clôturé en échange de titres du Fonds prorogé. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de cette fusion correspondait aux actifs nets transférés du Fonds clôturé. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Le 31 mars 2023, à la clôture des bureaux, les Fonds prorogés ont acquis la totalité de l'actif net des Fonds clôturés en échange de titres des Fonds prorogés. La valeur des titres du Fonds prorogé émis dans le contexte de ces fusions correspondait aux actifs nets transférés des Fonds clôturés. Le coût associé à la fusion a été pris en charge par le gestionnaire.

Les fusions suivantes ont eu lieu avec un report d'impôt :

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis (\$)	Parts émises
FNB Indice MSCI Europe Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	15 717 562	762 913
FNB Indice MSCI International Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	8 292 860	402 527
FNB Indice MSCI Monde Pondération faible risque CI	FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI	27 110 944	1 315 901

Les états de la situation financière sont au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le cas échéant. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts ou d'actions rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, 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 juin 2024 et 2023, le cas échéant.

## 2. INFORMATIONS SIGNIFICATIVES SUR LES 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 informations significatives sur les méthodes comptables des Fonds sont résumées ci-après :

### a. Classement et comptabilisation des instruments financiers

Les Fonds classent et évaluent leurs placements, entre autres dans des titres à revenu fixe, des titres de capitaux propres, des fonds de placement, des fonds négociés en Bourse et des dérivés, selon le modèle économique des Fonds pour la gestion de ces actifs financiers et les caractéristiques de flux de trésorerie contractuels des actifs financiers. Les portefeuilles d'actifs financiers des Fonds sont gérés et leur rendement est évalué selon la juste valeur. Les Fonds mettent surtout l'accent sur les informations sur la juste valeur et utilisent celles-ci pour évaluer le rendement des actifs et pour prendre des décisions. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance des Fonds correspondent uniquement à du capital et à des intérêts. Ces titres ne sont pas détenus aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels ni aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels et de la vente de ces titres. La perception de flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à la réalisation de l'objectif du modèle économique des Fonds. Par conséquent, tous les placements et les dérivés sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »). Les ventes à découvert sont comptabilisées en tant que passifs financiers à la JVRN. Les contrats de dérivés dont la juste valeur est négative sont présentés en tant que passifs à la JVRN.



# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les obligations des Fonds au titre de l'actif net attribuable aux porteurs de parts ou d'actions rachetables correspondent au montant du rachat, qui se rapproche de la juste valeur. Tous les autres actifs et passifs financiers sont évalués au coût amorti, qui se rapproche de la juste valeur. Selon cette méthode, les actifs et passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisé s'il y a lieu, selon le taux d'intérêt effectif.

Les actifs financiers et passifs financiers sont compensés et le solde net est présenté dans les états de la situation financière si, et seulement si, les Fonds ont un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et s'ils ont l'intention soit de régler les montants nets, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les Fonds concluent, dans le cadre normal de leurs activités, diverses conventions-cadres de compensation ou autres accords similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans les états de la situation financière, mais qui permettent néanmoins d'opérer compensation des montants dans certaines circonstances, comme la faillite ou la résiliation des contrats.

## b. Juste valeur des instruments financiers

À la clôture, les titres cotés sont évalués au dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des conditions actuelles du marché. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. Les bons de souscription non cotés, le cas échéant, sont évalués en fonction d'un modèle de tarification prenant en compte des facteurs comme la valeur de marché du titre sous-jacent, le prix d'exercice et les modalités du bon de souscription. Les titres à revenu fixe, les débentures et les autres instruments de créance, y compris les placements à court terme, sont évalués au cours fourni par des courtiers en valeurs mobilières reconnus. Le ou les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable selon la valeur liquidative présentée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

La juste valeur des placements privés et des autres titres pour lesquels il existe des données non observables importantes est établie à l'aide de modèles d'évaluation pouvant être fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire afin de garantir qu'elles sont raisonnables. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des placements privés.

## c. Trésorerie

La trésorerie comprend les dépôts en espèces et le découvert bancaire.

## d. Coût des placements

Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est déterminé selon le coût moyen, commissions et coûts de transaction non compris. Le coût moyen n'inclut pas l'amortissement des primes ou des escomptes sur les titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro.

Le coût du lingot d'or représente la juste valeur du lingot d'or au moment de l'achat.

## e. Opérations de placement et comptabilisation des revenus

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération, c'est-à-dire à la date où un Fonds s'engage à acheter ou à vendre le placement. Les « intérêts aux fins des distributions » présentés dans les états du résultat global correspondent à l'intérêt nominal reçu par les Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire. Les intérêts gagnés en espèces sont inclus dans les états du résultat global sous « Intérêts aux fins des distributions ».

Les dividendes et les distributions tirés des placements sont comptabilisés à la date ex-dividende/ex-distribution.

Les distributions des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents sont traitées à titre de revenu, gains en capital ou remboursement de capital, selon les meilleurs renseignements dont dispose le gestionnaire. En raison de la nature de ces placements, la répartition effectuée au cours de l'exercice considéré pourrait être différente de cette information. Les distributions de fiducies de revenu et de fonds sous-jacents qui sont traitées comme un remboursement de capital aux fins de l'impôt sur le revenu réduisent le coût moyen des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents.

## f. Conversion de devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds, sauf pour le Fonds de lingots d'or CI et FNB marché monétaire É.-U. CI, pour lequel le dollar américain est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation. Pour le FNB d'obligations de qualité supérieure CI, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI, le FNB alpha Marchés émergents CI, le FNB alpha Innovation mondiale CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI, le FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI et le FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI, tous les renseignements sont indiqués en dollars canadiens, à l'exception de la valeur liquidative par part de la série en dollars américains, qui est indiquée en dollars américains. Pour le Fonds de lingots d'or CI et FNB marché monétaire É.-U. CI, toutes les informations sont présentées en dollars américains, à l'exception de la valeur liquidative par part pour la Série FNB couverte en \$ CA et la Série FNB non couverte en \$ CA, qui est présentée en dollars canadiens.

Les montants en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle comme suit : les placements, les contrats de change à terme et les autres actifs et passifs à la juste valeur, au cours du change de clôture chaque jour ouvrable; les revenus et les charges, les achats, les ventes et les règlements de placements, au cours du change en vigueur à la date des opérations en cause. Les profits et pertes de change sur la trésorerie sont présentés à titre de « Profit (perte) de change sur la trésorerie » et les profits et pertes de change se rapportant à d'autres actifs et passifs financiers sont présentés sous les postes « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés » et « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global.

## g. Évaluation des parts/des actions

La valeur liquidative par part/action de chaque série est calculée à la fin de chaque jour ouvrable de la Bourse de Toronto/NEO en divisant la valeur liquidative totale de chaque série d'un Fonds par le nombre d'actions/de parts de cette série en circulation.

La valeur liquidative de chaque série est basée sur le calcul de la quote-part des actifs du Fonds revenant à cette série, moins la quote-part du passif collectif du Fonds revenant à cette série et le passif attribuable à cette série. Les charges attribuables directement à une série sont imputées à cette série. Les autres revenus et charges ainsi que les profits et les pertes sont imputés proportionnellement à chaque série en fonction de la valeur liquidative relative de chaque série.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Au 30 juin 2024, au 31 décembre 2023 et au 30 juin 2023, le cas échéant, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts/d'actions et les actifs nets attribuables aux porteurs de parts/d'actions rachetables utilisés aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

## **h. Classement des parts/des actions**

Les parts/actions des Fonds sont classées comme passifs financiers conformément à la norme IAS 32, *Instruments financiers : Présentation* (IAS 32), car elles ne répondent pas à la définition des instruments remboursables au gré du porteur devant être classés en capitaux propres conformément à l'IAS 32 aux fins de la présentation de l'information financière.

## **i. Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille**

Les coûts de transaction, notamment les commissions de courtage, engagés lors de l'achat et de la vente de titres, sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille ».

Les Fonds qui investissent uniquement dans les parts/les actions de fonds sous-jacents ne sont pas assujettis aux commissions.

## **j. Augmentation (diminution) des actifs nets attribuables aux porteurs de parts/d'actions rachetables, par part/action**

« L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts/d'actions rachetables par part/action » dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts/actions rachetables de chaque série d'un Fonds par le nombre moyen pondéré de parts/d'actions de cette série en circulation au cours de la période.

## **k. Contrats de change à terme**

Les Fonds sont autorisés à conclure des contrats de change à terme de temps à autre. Les contrats de change à terme sont évalués chaque jour d'évaluation selon la différence entre le taux prévu aux termes du contrat et le taux à terme en vigueur à la date d'évaluation, appliquée au montant notionnel du contrat et ajustée en fonction du risque de contrepartie. Tout profit (perte) latent découlant des contrats de change à terme est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

## **l. Contrats à terme standardisés**

Les contrats à terme standardisés sont évalués à chaque date d'évaluation en utilisant le cours de clôture affiché à la Bourse pertinente. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont détenus à titre de marge sur les contrats à terme standardisés qui sont présentés dans les états de la situation financière sous « Marge de variation quotidienne sur les dérivés ». Tout profit (perte) latent découlant des contrats à terme standardisés est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

## **m. Swap(s) sur défaillance**

Les swaps sur défaillance sont des ententes qui aident à atténuer l'exposition au risque de crédit à l'égard d'une entité émettrice (l'« entité de référence ») ou à augmenter l'exposition au risque de crédit de l'entité de référence en créant une position de placement théorique pour le Fonds. Lorsqu'une position de placement théorique est créée, le risque de crédit auquel est exposé le Fonds est comparable au risque qui aurait découlé d'un placement direct du Fonds dans l'entité de référence. En vertu des swaps sur défaillance, l'acheteur de protection, dont l'intention est de réduire son exposition au risque de crédit à l'égard de l'entité de référence, verse une prime au vendeur de protection qui assume le risque de crédit en cas de défaillance. Cette prime est payée à intervalles réguliers sur la durée du swap. En échange de la prime versée, l'acheteur de protection a le droit de recevoir du vendeur de protection le remboursement complet d'une perte attribuable à un cas de défaillance de l'entité de référence. Un cas de défaillance peut être déclenché par une faillite, un défaut de paiement ou une restructuration de l'entité de référence. En cas de défaillance, le swap peut être réglé par la livraison physique de l'obligation pour un produit correspondant à la valeur nominale ou par le versement d'un paiement comptant correspondant au montant de la perte. Les swaps sur défaillance sont évalués en fonction des évaluations fournies par les courtiers.

Les variations dans la valeur des swaps sur défaillance sont inscrites au poste « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés », dans les états du résultat global. Les primes versées ou reçues au titre des swaps sur défaillance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ». Si un swap sur défaillance vient à échéance ou est résilié, les profits ou les pertes sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

## **n. Contrat(s) d'option**

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'option sont évalués chaque jour selon le profit ou la perte qui seraient réalisés si les contrats étaient liquidés. Tout profit (perte) latent découlant des contrats d'option est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». Toutes les primes liées aux options arrivées à échéance sont comptabilisées dans les états du résultat global sous « Revenu (perte) sur les dérivés ».

## **o. Vente à découvert**

Lorsqu'un Fonds vend un titre à découvert, il emprunte ce titre d'un courtier afin de conclure la vente. Puisque le Fonds emprunte un titre du courtier, il doit avoir un compte sur marge auprès de ce dernier contenant des liquidités ou des titres liquides. Les liquidités détenues sur la marge en ce qui concerne l'activité de vente à découvert sont incluses dans le poste « Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert » dans les états de la situation financière. La perte maximale sur les titres vendus à découvert peut être illimitée. Le résultat d'une vente à découvert pour un Fonds est une perte si le prix du titre emprunté augmente entre la date de la vente à découvert et la date à laquelle le Fonds dénoue sa position vendeur en achetant ce titre. Le Fonds réalise un profit si le prix du titre baisse entre ces dates. Le profit ou la perte qui seraient réalisés si la position était fermée à la date d'évaluation sont indiqués dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés ». Lorsque la position vendeur est liquidée, les profits et les pertes sont réalisés et inclus au poste « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés », dans les états du résultat global. Les frais versés à un courtier pour l'emprunt de titres sont inclus dans les états du résultat global au poste « Frais d'emprunt de titres ».

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## **p. Compensation des instruments financiers**

Les informations présentées dans les tableaux « Compensation des instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds comprennent les actifs et passifs des contrats de change à terme qui sont assujettis à un accord de compensation exécutoire. Les transactions avec des contreparties individuelles sont régies par des accords de compensation distincts. Chaque accord prévoit un règlement net de certains contrats ouverts pour lesquels les Fonds et la contrepartie concernée choisissent de régler leurs contrats sur une base nette. En l'absence d'un tel choix, les contrats seront réglés sur une base brute. Cependant, chaque partie à l'accord de compensation aura la possibilité de régler tous les contrats ouverts sur une base nette en cas de défaillance de l'autre partie.

Les accords de compensation de l'International Swaps and Derivatives Association Inc. (« accord de compensation ISDA ») régissent les opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré conclus par les Fonds et des contreparties choisies. Les accords de compensation ISDA prévoient des dispositions pour les obligations générales, les représentations, les accords, les garanties et les cas de défaillance ou de résiliation. Les clauses de résiliation comprennent des dispositions qui peuvent permettre aux contreparties de choisir une résiliation anticipée et de provoquer un règlement de toutes les opérations en cours en vertu de l'accord de compensation ISDA applicable. Tout choix de résiliation anticipée pourrait avoir une incidence importante sur les états financiers. La juste valeur des opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré, nette de la garantie reçue ou donnée par une contrepartie à la fin de la période, est présentée dans les notes propres au Fonds jointes aux états financiers de chacun des Fonds, le cas échéant.

Les Fonds peuvent être assujettis à plusieurs accords-cadres ou accords de compensation, avec certaines contreparties. Ces accords-cadres réduisent le risque de contrepartie lié aux opérations pertinentes en spécifiant les mécanismes de protection de crédit et en fournissant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Puisque les opérations ont des mécanismes différents et sont parfois négociées par différentes entités juridiques d'une contrepartie, chaque type d'opération peut être couvert par un accord-cadre différent, d'où la nécessité d'avoir plusieurs accords avec une seule contrepartie. Comme les accords-cadres sont propres aux opérations uniques visant différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de dénouer et de régler leur exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance à l'égard des opérations régies par un accord unique avec une contrepartie.

## **q. Placements dans des entreprises associées, des coentreprises, des filiales et des entités structurées non consolidées**

Les filiales sont des entités, y compris les investissements dans d'autres entités d'investissement, sur lesquelles un Fonds exerce un contrôle. Un Fonds contrôle une entité lorsqu'il est exposé ou qu'il a droit à des rendements variables en raison de ses liens avec l'entité, et qu'il a la capacité d'influer sur ces rendements du fait du pouvoir qu'il détient sur celle-ci. Les entreprises associées et les coentreprises sont des participations dans des entités sur lesquelles un Fonds exerce une influence notable ou un contrôle conjoint. Une entité structurée est une entité qui a été conçue de telle sorte que les droits de vote ou droits similaires ne sont pas les facteurs dominants pour déterminer qui contrôle l'entité, ou de telle sorte que les droits de vote sont uniquement liés à des tâches administratives et que les activités pertinentes sont régies par des dispositions contractuelles.

Le gestionnaire a déterminé que le ou les fonds sous-jacents ou le ou les fonds négociés en Bourse (« FNB ») détenus par les Fonds répondent généralement à la définition d'une entité structurée non consolidée. Les titres adossés à des créances hypothécaires et les titres adossés à des crédits mobiliers sont également considérés comme des entités structurées non consolidées. Les Fonds comptabilisent leurs placements dans des entités structurées non consolidées à la JVRN.

Les Fonds qui investissent dans un ou des fonds sous-jacents sont assujettis aux modalités des documents de placement du ou des fonds sous-jacents concernés et sont sensibles au risque de prix du marché découlant des incertitudes entourant les valeurs futures du ou des fonds sous-jacents en question. Le ou les fonds sous-jacents du portefeuille de placements sont gérés par des gestionnaires de portefeuille qui sont rémunérés pour leurs services par le fonds sous-jacent concerné. Cette rémunération est généralement constituée de frais calculés en fonction de l'actif et est reflétée dans l'évaluation de chacun des fonds sous-jacents, sauf lorsque les Fonds investissent dans certaines catégories de fonds sous-jacents pour lesquelles la rémunération des gestionnaires de portefeuille est négociée et payée à l'extérieur de chacun des fonds sous-jacents. Le ou les fonds sous-jacents financent leurs activités en émettant des parts ou des actions rachetables qui donnent droit aux porteurs à une participation égale du ou des fonds sous-jacents. Les Fonds peuvent demander le rachat de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents sur une base quotidienne. Ces placements sont inclus au poste « Placements » à la JVRN dans les états de la situation financière. Tout profit (perte) latent découlant de ces placements est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global, jusqu'au moment où ces placements sont vendus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les fonds sous-jacents est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents.

Certains Fonds investissent dans un ou des FNB, qui sont présentés dans le tableau du portefeuille de placements, et ces Fonds ont déterminé que leurs investissements dans ces FNB répondent à la définition d'entités structurées non consolidées. Ce ou ces FNB financent leurs activités en émettant des actions rachetables qui peuvent être vendues au gré du détenteur et qui lui donnent droit à une participation proportionnelle à la valeur liquidative de chaque FNB. Le ou les FNB sont domiciliés au Canada ou aux États-Unis et sont cotés en Bourse. L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les FNB est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les FNB.

L'information se rapportant à la participation dans des entités structurées non consolidées figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

## **r. Lingots d'or**

Le lingot d'or est mesuré à la JVRN.

Les lingots d'or sont enregistrés à la date de transaction, qui est la date à laquelle un Fonds s'engage à acheter ou à vendre le lingot d'or. Toute perte ou tout profit latent découlant des avoirs en lingots est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des lingots d'or et des dérivés », dans les états du résultat global, jusqu'au moment où les avoirs en lingots sont vendus. À ce moment, les pertes ou les profits sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente des lingots d'or et de dérivés ».

## **s. Retenues d'impôts**

Un Fonds peut, de temps à autre, être assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées séparément dans les états du résultat global.

## **t. Taxe de vente harmonisée**

Certaines provinces, y compris l'Ontario, l'Île-du-Prince-Édouard, la Nouvelle-Écosse, le Nouveau-Brunswick et Terre-Neuve-et-Labrador (chacune, une juridiction fiscale participante), ont harmonisé leur

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

taxe de vente provinciale (« TVP ») avec la taxe fédérale sur les produits et services (« TPS »). La taxe de vente harmonisée (« TVH ») correspond au taux de 5 % de la TPS fédérale combiné à celui de la TVP des provinces concernées. La province de Québec perçoit également la taxe de vente du Québec (« TVQ »). La TVH à verser ou à recevoir est calculée selon le lieu de résidence des porteurs de parts/des actionnaires et la valeur de leur participation dans le Fonds à une date donnée, et non en fonction du territoire dont relève le Fonds. Le taux effectif des taxes de vente applicable à chaque série du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts/des actionnaires entre les provinces. Il est calculé selon le taux de TVH ou, si la province concernée n'applique pas la TVH, selon le taux de TPS ou de la TVQ. Tous les montants à ce titre sont inscrits au poste « Taxe de vente harmonisée » des états du résultat global.

### 3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

La préparation d'états financiers conformes aux IFRS exige que la direction émette des jugements, fasse des estimations et pose des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables ainsi que sur les montants présentés au titre de l'actif et du passif à la date de clôture et sur les montants présentés des revenus et des dépenses pour la période. Le paragraphe suivant présente une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation de leurs états financiers :

#### *Évaluation à la juste valeur des investissements et des dérivés non cotés sur un marché actif*

De temps à autre, les Fonds peuvent détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, notamment des titres non cotés, des titres privés ou des dérivés. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. La juste valeur des titres privés est établie à l'aide de modèles d'évaluation fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs ont été examinées de façon indépendante par le gestionnaire selon les hypothèses et les estimations disponibles à la date de l'état de la situation financière. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres privés.

Dans la mesure du possible, les modèles d'évaluation font appel à des données observables. Toutefois, le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre à l'entité que le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités, les corrélations et les hypothèses clés au sujet d'événements futurs. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers.

Les Fonds considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question.

La juste valeur des placements dans un ou des fonds sous-jacents qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs est évaluée principalement selon la dernière valeur liquidative de ces parts/actions disponible pour chaque fonds sous-jacent, telle qu'elle est déterminée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

### IFRS 10 - États financiers consolidés (IFRS 10)

Conformément à l'IFRS 10, le gestionnaire a déterminé que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement, à savoir une entité qui obtient des Fonds auprès d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion de placements; qui déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital ou de revenus de placement ou les deux, et qui évalue et mesure le rendement de leurs placements sur la base de la juste valeur. Par conséquent, les Fonds ne consolident pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent plutôt à la JVRN, comme l'exige la norme comptable.

### 4. PARTS/ACTIONS RACHETABLES

Chaque Fonds, sauf la FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI First Asset, est autorisé à émettre un nombre illimité de parts ordinaires rachetables et transférables, y compris les séries couvertes et non couvertes en dollars canadiens, les séries couvertes en dollars américains et les séries en dollars américains, selon le cas, dont chacune représente une participation indivise dans les actifs nets du Fonds. Dans le cas de Fonds à séries multiples, des parts entières de chaque série de parts peuvent être converties en parts entières de toute autre série de parts du Fonds en fonction de leur valeur liquidative respective, et les fractions de parts restantes sont rachetées à leur valeur liquidative.

Le capital autorisé de la société de placement, y compris : Le Catégorie FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI comprennent un nombre illimité de séries d'actions à dividende non cumulatif, rachetables, sans droit de vote (chacune une « catégorie de société »), pouvant être émises dans un nombre illimité de séries, et une série d'actions avec droit de vote désignée comme les actions de catégorie J. Chaque catégorie de société est un fonds de placement distinct ayant des objectifs de placement spécifiques et qui se rapporte à un portefeuille distinct de placements. Chaque catégorie de société a le droit d'émettre un nombre illimité d'actions de fonds négociés en Bourse. Les actions de FNB sont libellées en dollars canadiens.

Un courtier ou un preneur ferme désigné peut, un jour de Bourse donné, transmettre un ordre de souscription visant un multiple intégral du nombre prescrit de parts/d'actions de chaque Fonds. Un jour de Bourse est tout jour pendant lequel une séance est tenue à la Bourse de Toronto/NEO.

Si l'ordre de souscription est accepté, le Fonds émettra généralement les parts/les actions au courtier ou au preneur ferme désigné dans un délai de trois jours de Bourse suivant la date de prise d'effet de la souscription. Pour chaque nombre prescrit de parts/d'actions émises, un courtier ou un preneur ferme désigné doit remettre un paiement composé : i) d'un panier de parts/d'actions pertinentes et d'un montant au comptant suffisant pour que la valeur des parts/des actions et du montant au comptant soit égale à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de la souscription; ou ii) sur approbation du gestionnaire, d'un montant au comptant suffisant pour que sa valeur soit égale à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de la souscription, dans chaque cas plus les frais de souscription applicables établis par le gestionnaire.

Les parts/les actions de chaque Fonds peuvent également être émises aux porteurs de parts/aux actionnaires du Fonds au réinvestissement automatique de toutes les distributions conformément à la politique de distribution du Fonds.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les porteurs de parts/les actionnaires peuvent, tout jour de Bourse, échanger un multiple intégral du nombre prescrit de parts de chaque Fonds contre des paniers de parts/d'actions et un montant au comptant ou, à la discrétion du gestionnaire, contre un montant au comptant uniquement. Le prix d'échange sera égal à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds visées par l'échange au moment de l'évaluation le jour de prise d'effet de l'ordre d'échange, payable généralement dans un délai de trois jours de Bourse suivant la date de prise d'effet de l'ordre d'échange par la remise : i) d'un panier de parts/d'actions et d'un montant au comptant suffisant pour que la valeur des parts/des actions et du montant au comptant soit égale à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds; ou ii) sur approbation du gestionnaire, uniquement d'un montant au comptant suffisant pour que sa valeur soit égale à la valeur liquidative applicable du nombre prescrit de parts/d'actions du Fonds, dans chaque cas moins les frais de rachat applicables établis par le gestionnaire. Les parts/actions seront rachetées dans le cadre de l'échange.

Les porteurs de parts/les actionnaires de chaque Fonds peuvent aussi, tout jour de Bourse, faire racheter des parts/des actions du Fonds à un prix de rachat par part/par action égal à 95 % du cours de clôture applicable des titres à la Bourse de Toronto/NEO, le jour de prise d'effet du rachat, moins tous frais de rachat applicables déterminés par le gestionnaire.

Les porteurs de parts/les actionnaires qui ont présenté un ordre de rachat avant la date de clôture des registres pour le versement d'une distribution n'auront pas droit à cette distribution.

Chaque Fonds gère son capital selon ses objectifs et stratégies de placement décrits à la note 1 et les pratiques de gestion des risques décrites à la note 10, et s'efforce d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant des liquidités suffisantes pour effectuer des distributions et des rachats. Afin de gérer leur structure du capital, les Fonds peuvent rajuster le montant des distributions versées aux porteurs de parts/aux actionnaires.

L'information se rapportant aux opérations sur actions/parts rachetables figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

Afin d'établir chacune des séries, le gestionnaire a effectué des placements initiaux dans le Fonds suivant.

## 5. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

### *Frais de gestion*

Le gestionnaire de chaque Fonds, en contrepartie des frais de gestion qu'il reçoit, fournit les services de gestion requis pour les activités quotidiennes des Fonds, y compris la gestion des portefeuilles de placements des Fonds et le détachement de personnel de direction clé.

À titre de rémunération pour les services qu'il fournit aux Fonds, les Fonds versent au gestionnaire des frais de gestion annuels sur les actions du FNB applicables ou, dans le cas des Fonds, sur les parts ordinaires, les parts ordinaires couvertes, les parts ordinaires non couvertes, y compris en dollars canadiens et/ou en dollars américains, les parts de la série de FNB en dollars canadiens, les parts de la série de FNB en dollars américains et les parts de la série de FNB couvertes en dollars américains, calculées en pourcentage de la valeur liquidative quotidienne et payées mensuellement en arriérés. Le cas échéant, le gestionnaire paie la rémunération du conseiller ou du sous-conseiller en valeurs à même les frais de gestion qu'il reçoit.

### *Frais d'administration*

Le gestionnaire est responsable de tous les coûts et dépenses des Fonds suivants : FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI, FNB de répartition de l'actif

équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB indiciel biorévolution CI, FNB d'obligations convertibles canadiennes CI, FNB Indice d'actions canadiennes CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB indiciel sécurité numérique CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'énergie CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI, Fonds de lingots d'or CI, FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de l'or+ CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants de la santé CI, FNB d'épargne à intérêt élevé CI, FNB marché monétaire CI, FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI, FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI, FNB Indice Morningstar International Momentum CI, FNB Indice Morningstar International Valeur CI, FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI, FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants des technologies CI, FNB Indice 1000 É.-U. CI, FNB Indice 500 É.-U. CI, FNB indiciel momentum amélioré américain CI, FNB indiciel valeur améliorée américain CI, FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI, FNB marché monétaire É.-U. CI, FNB Indice des obligations indexées sur l'inflation du Trésor américain (couvert en \$ CA) CI et FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI, sauf les frais de gestion, frais de courtage et commissions, coûts de tout instrument financier utilisé pour atteindre l'objectif de placement des Fonds, coûts raisonnables associés au Comité d'examen indépendant (CEI), impôts sur le revenu, retenues d'impôt, tous les biens et services applicables ou autres taxes de vente, y compris la TPS/TVH, les coûts de conformité à toute nouvelle exigence gouvernementale ou réglementaire introduite après l'établissement des Fonds, tous les coûts associés à l'impression et à la distribution de tout document que les autorités de réglementation des valeurs mobilières exigent d'envoyer aux porteurs de parts/actionnaires, tous les frais de transaction engagés par le dépositaire et toutes les dépenses extraordinaires plus les taxes applicables. Le gestionnaire paie, à même les frais de gestion, tous les autres coûts et charges liés à l'exploitation des Fonds, y compris, s'il y a lieu, les frais d'administration, les frais juridiques, les frais de comptabilité, les frais de garde, les honoraires d'audit, les honoraires de l'agent chargé de la tenue des registres, les honoraires de l'agent des transferts et les frais à payer aux autres fournisseurs de services, y compris les fournisseurs de l'indice, le cas échéant. Par conséquent, ces Fonds n'ont pas d'autres charges.

Les frais d'administration sont calculés comme un pourcentage annuel de la valeur liquidative de chaque série d'un Fonds à la fin de chaque jour ouvrable et sont assujettis aux taxes d'application, y compris la TVH, la TPS et la TVQ.

### *Coûts d'exploitation*

Les Fonds suivants : FNB de FPI canadiennes CI, FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, FNB alpha Marchés émergents CI, FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI, FNB alpha innovation mondiale CI, FNB intelligence artificielle mondiale CI Devise, FNB Secteur financier mondial CI, FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiaux CI, FNB d'obligations de qualité supérieure CI, FNB d'actions privilégiées CI, Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI et FNB Options d'achat couvertes sur compagnies d'assurances américaines et canadiennes CI, sont responsables de tous les coûts liés à leur fonctionnement et à leur administration, qui sont présentés dans leurs états du revenu global.

### *Absorption*

La décision de renoncer aux frais de gestion et aux charges d'exploitation propres à un Fonds ou de les prendre en charge est au gré du gestionnaire. La pratique visant à renoncer aux charges, ou à les prendre en charge, peut se poursuivre indéfiniment ou être abandonnée en tout temps sans avis aux porteurs de parts/aux actionnaires. Les charges d'exploitation propres à un Fonds prises en charge par le gestionnaire ou les frais de gestion auxquels il a renoncé sont présentés dans les états du résultat global.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## Rabais sur frais

Dans certains cas, le gestionnaire peut imputer à un Fonds des frais de gestion inférieurs à ceux que le gestionnaire est autrement en droit d'imputer à certains investisseurs dans un Fonds. L'écart dans le montant des frais de gestion est payé par le Fonds aux investisseurs concernés à titre de distribution de titres additionnels (distributions des frais de gestion) du Fonds. Les distributions des frais de gestion sont négociables entre le gestionnaire et l'investisseur et dépendent principalement de l'importance du placement de l'investisseur dans le Fonds. Les distributions des frais de gestion aux investisseurs admissibles n'ont pas d'incidence négative sur le Fonds ou sur tout autre investisseur dans le Fonds. Le gestionnaire peut augmenter ou diminuer le montant des distributions des frais de gestion pour certains investisseurs de temps à autre. Les rabais sur frais de gestion sont inclus dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, selon le cas, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ».

## Placements dans les fonds sous-jacents

Un Fonds qui investit dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents ne paiera pas de frais de gestion et d'administration en double sur la portion des actifs qui sont investis dans des parts ou des actions du ou des fonds sous-jacents. Au cours de la période, un Fonds pourrait recevoir un rabais sur les frais de gestion ou d'administration du gestionnaire du ou des fonds sous-jacents relativement à ses placements dans un fonds sous-jacent. Les rabais sur frais de gestion ou d'administration, le cas échéant, sont compris dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, selon le cas, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ».

Voir le tableau des frais de gestion et d'administration dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir les ratios des frais de gestion de chaque série de chaque Fonds.

## 6. PRÊT DE TITRES

Les Fonds, à l'exception du FNB d'épargne à intérêt élevé CI et Fonds de lingots d'or CI, ont conclu un programme de prêt de titres avec la Bank of New York Mellon, qui agit comme agent de prêt de titres. Ces opérations comportent l'échange temporaire de titres contre une garantie comportant l'engagement à remettre les mêmes titres à une date future. Le produit tiré de ces opérations prend la forme d'honoraires payés par la contrepartie et, dans certaines circonstances, d'intérêts payés sur le montant au comptant ou les titres détenus en garantie. Le produit des opérations de prêt de titres est inclus aux états du résultat global et est comptabilisé lorsqu'il est gagné. La valeur de marché globale de tous les titres prêtés par un Fonds ne peut dépasser 50 % des actifs de ce Fonds. La garantie reçue est composée de titres admissibles et de titres qui sont immédiatement convertibles en titres de même type ou qui peuvent être échangés contre de tels titres, qui comportent les mêmes modalités et pour un même nombre que ceux prêtés par chaque Fonds, d'une valeur de marché correspondant au moins à 102 % de la valeur de marché des titres prêtés. Chaque dépositaire du Fonds a le droit de recevoir des paiements à même le montant brut tiré des opérations de prêt de titres des Fonds et assume tous les coûts d'exploitation directement liés au prêt de titres, y compris le coût d'indemnisation en cas de défaut de l'emprunteur. La valeur des titres prêtés et des garanties reçues de même qu'un rapprochement entre le revenu brut tiré des prêts de titres et le revenu tiré des prêts de titres figurent dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant. Les revenus tirés des prêts de titres figurent au poste « Revenu tiré des prêts de titres » des états du résultat global.

## 7. IMPOSITION

Tous les Fonds, à l'exception de FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB indiciel biorévolution CI, FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB indiciel sécurité numérique CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB de titres à revenu fixe de qualité

supérieure mondiale CI, FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI, FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB marché monétaire CI, Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI, FNB indiciel momentum amélioré américain CI, FNB indiciel valeur améliorée américain CI et FNB marché monétaire É.-U. CI se qualifient comme une fiducie de fonds commun de placement en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du résultat net des Fonds aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours de tout exercice doivent être distribués aux porteurs de parts de manière à ce que chaque Fonds n'ait aucun impôt à payer. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. L'impôt sur le montant net des gains en capital réalisés qui ne sont ni payés ni payables peut, en général, être recouvré en vertu des dispositions de remboursement contenues dans la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et dans les lois provinciales de l'impôt sur le revenu, lorsque des rachats sont effectués. À l'occasion, les Fonds peuvent effectuer des distributions supérieures à leurs revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

Les FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB indiciel biorévolution CI, FNB indiciel sécurité numérique CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB alpha Innovation mondiale CI, FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI, FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiale CI, FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI, FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB marché monétaire CI, Catégorie FNB Indice MSCI Canada Qualité CI, Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI, FNB indiciel momentum amélioré américain CI, FNB indiciel valeur améliorée américain CI et FNB marché monétaire É.-U. CI se qualifient comme des fiducies unitaires en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et ne sont pas soumis à l'impôt sur leur revenu net, y compris les gains en capital nets réalisés pour l'année d'imposition, qui est payé ou payable à leurs porteurs de parts à la fin de l'année d'imposition. Toutefois, toute partie du revenu imposable de chacun des Fonds et du montant net des gains en capital réalisés qui n'est pas ainsi versée ou payable sera imposable pour ce Fonds. Chaque Fonds a l'intention de verser la totalité de son revenu net imposable et une partie suffisante du montant net de ses gains en capital réalisés de manière à ne pas devoir payer l'impôt sur le revenu. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. À l'occasion, un Fonds pourra verser des distributions supérieures à ses revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

La fin de l'exercice financier pour tous les Fonds est le 15 décembre, à l'exception du FNB de répartition de l'actif équilibré CI, FNB de répartition de l'actif de croissance équilibrée CI, FNB de répartition de l'actif de revenu équilibré CI, FNB indiciel biorévolution CI, FNB indiciel sécurité numérique CI, FNB de répartition de l'actif prudent CI, FNB alpha Marchés émergents CI, FNB de répartition de l'actif en actions CI, FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB alpha Innovation mondiale CI, FNB Indice Chefs de file mondiaux des soins de santé CI, FNB de titres à revenu fixe de qualité supérieure mondiale CI, FNB indiciel mondial faible volatilité à la baisse CI, FNB indiciel américain faible volatilité à la baisse CI, FNB Options d'achat couvertes sur géants des services publics CI, FNB de répartition de l'actif de croissance CI, FNB d'épargne à intérêt élevé CI, FNB marché monétaire CI, FNB Indice 1000 É.-U. CI, FNB Indice 500 É.-U. CI, FNB indiciel momentum amélioré américain CI, FNB indiciel valeur améliorée américain CI et FNB marché monétaire É.-U. CI, dont la fin de l'exercice financier est le 31 décembre.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Le FNB Catégorie Revenu d'options d'achat couvertes sur banques canadiennes CI et la Catégorie FNB Indice des obligations gouvernementales à court terme CI sont des catégories de société distinctes de la société de placement. La société de placement répond à la définition de société de placement à capital variable au sens de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La société de placement calcule son revenu (sa perte) net et ses gains (pertes) en capital nets aux fins de l'impôt sur le revenu comme si elle était une seule entité. Les pertes nettes d'un Fonds peuvent servir à réduire les gains nets d'un autre Fonds afin de diminuer le résultat net ou les gains en capital nets de la Société du Fonds dans son ensemble. En tant que société de placement à capital variable, la Société est assujettie à l'impôt fédéral de la partie IV. Les dividendes imposables qu'elle reçoit de sociétés canadiennes imposables sont assujettis à un impôt de 38 1/3 %. Cet impôt est entièrement remboursable au moment du versement aux actionnaires de dividendes imposables. La Société du Fonds est également assujettie à l'impôt de la partie I sur ses autres revenus et ses gains en capital imposables de l'année. La totalité des impôts versés sur le montant net des gains en capital réalisés imposables est recouvrable lorsque ces gains sont distribués aux actionnaires sous forme de dividendes sur les gains en capital ou par voie de rachat d'actions à la demande des actionnaires, tant que la Société du Fonds est admissible à titre de société à fonds commun de placement. Par conséquent, la Société du Fonds ne comptabilise pas de charges d'impôts exigibles au titre des dividendes reçus de sociétés canadiennes imposables ni des gains en capital. Les revenus d'intérêts et les dividendes étrangers, déduction faite des frais applicables, sont imposés au plein taux d'imposition des sociétés de placement à capital variable. Des crédits pour les impôts étrangers payés sont accordés, sous réserve de certaines limites. Les impôts sur le revenu (le cas échéant) sont imputés aux Fonds de la Société sur une base raisonnable.

La fin de l'année d'imposition de la société de placement est le 31 décembre.

## Retenues d'impôts

Certains Fonds peuvent être assujettis à un impôt étranger sur le revenu, les gains en capital à la vente de titres et certaines transactions en devises dans les pays où ils investissent. Les éventuels impôts étrangers sont comptabilisés conformément à la réglementation fiscale et aux taux établis par les autorités fiscales des pays où les Fonds investissent. Lorsqu'il est déterminé qu'un impôt sur les gains en capital s'applique, les Fonds enregistrent un passif fiscal estimé d'un montant qui serait payable si les titres étaient cédés à la date d'évaluation.

## 8. DISTRIBUTIONS

Chaque Fonds verse des distributions mensuelles ou trimestrielles à ses porteurs de parts/actionnaires. Le montant des distributions est fondé sur l'évaluation par le gestionnaire des flux de trésorerie prévus des Fonds de temps à autre.

Dans le cas des Fonds, si, au cours d'une année, un Fonds dispose, après ces distributions, d'un excédent de revenus nets ou de gains en capital nets réalisés, il entend faire une distribution spéciale, au plus tard le 31 décembre de l'exercice en question, du montant restant des revenus nets ou des gains en capital nets réalisés, de façon à ne pas être assujettie à l'impôt sur le revenu en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada), compte tenu de l'ensemble des déductions, crédits et remboursements disponibles.

Dans le cas d'une société de placement, si, au cours d'une année d'imposition, après le versement des distributions régulières, la société de placement était par ailleurs assujettie à l'impôt à l'égard des gains en capital réalisés nets, ou de l'impôt remboursable à l'égard des dividendes reçus de sociétés canadiennes imposables, la société de placement entend verser, le 31 décembre de l'année en question, un dividende spécial sur les gains en capital et/ou un dividende ordinaire pour que la société de placement ne soit pas assujettie à l'impôt sur le revenu sur ces montants en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) (compte tenu de l'ensemble des déductions, des crédits et des remboursements

disponibles), ou afin de recouvrer l'impôt remboursable qu'elle ne pourrait pas par ailleurs recouvrer au versement de distributions en espèces régulières.

Cette distribution spéciale des gains en capital peut être payée sous forme de parts/d'actions et consolidée par la suite. Elle est considérée comme un revenu imposable et elle augmente le coût de base ajusté des parts/des actions pour chaque porteur de parts/actionnaire. Le nombre de parts/d'actions détenues par le porteur de parts/l'actionnaire et la valeur liquidative par part/par action du Fonds ne changent pas en raison des distributions autres qu'en trésorerie.

## 9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Le gestionnaire assure la gestion et l'administration des activités et des affaires des Fonds et, sauf dans le cas de certains Fonds, est également responsable de fournir les conseils en placement et les services de gestion de portefeuille requis par les Fonds. Ces services sont fournis dans le cours normal des activités et sont comptabilisés selon le montant de la contrepartie dont ont convenu les parties. Les achats et les ventes de titres entre les Fonds sont effectués sans lien de dépendance par l'entremise d'un tiers courtier indépendant.

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp. ou ses filiales ou dans d'autres Fonds de placement gérés par le gestionnaire indiqués dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

### Opérations entre Fonds

Ces opérations entre Fonds surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète un titre d'un émetteur auprès d'un autre Fonds de placement géré par le gestionnaire. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le Comité d'examen indépendant (CEI) passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Au cours des périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, certains Fonds ont effectué des opérations entre Fonds.

### Opérations entre Fonds liés

Ces opérations surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète les parts ou actions d'un autre fonds de placement géré par le gestionnaire. Au cours des périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, certains Fonds ont effectué des opérations entre Fonds liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans un ou des Fonds liés à la fin de chaque période.

### Opérations avec un émetteur lié

Ces opérations surviennent lorsqu'un Fonds vend ou achète les titres de CI Financial Corp. Ces opérations sont exécutées par l'entremise des intermédiaires du marché conformément aux conditions qui prévalent sur le marché. Le CEI passe en revue ces opérations dans le cadre de ses réunions habituelles. Durant les périodes closes les 30 juin 2024 et 2023, certains Fonds ont effectué des opérations entre émetteurs liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans la société CI Financial Corp. à la fin de chaque période.

## 10. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

### Gestion des risques

Les Fonds sont exposés à divers risques associés aux instruments financiers, à savoir le risque lié à l'effet de levier et à la vente à découvert, le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque de marché (y compris l'autre risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt). Le niveau de risque auquel chaque Fonds est exposé est fonction de l'objectif de placement et du type de placements que détient le Fonds. La valeur des placements dans un portefeuille peut changer de jour en jour en raison des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur, des conditions du marché, de la conjoncture économique et des nouvelles propres aux sociétés dans lesquelles le Fonds a investi. Le gestionnaire des Fonds peut

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

atténuer les effets négatifs de ces risques sur la performance des Fonds à l'aide de mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions des Fonds et des événements du marché; la diversification du portefeuille de placements par catégorie d'actifs, pays, secteur et durée jusqu'à l'échéance, tout en respectant les objectifs établis; et par l'entremise des dérivés à titre de couverture de certains risques.

L'objectif d'investissement du Fonds de lingots d'or CI est de fournir aux porteurs de parts une exposition aux lingots d'or. Les prix de l'or peuvent fluctuer quotidiennement en raison de l'évolution de la conjoncture économique et des conditions du marché, des changements politiques et des cours mondiaux de l'or. L'investissement dans l'or est hautement spéculatif et volatil.

Les Fonds qui investissent dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents sont indirectement exposés aux risques liés aux instruments financiers indiqués plus haut.

## Risque lié à l'effet de levier et à la vente à découvert

Lorsqu'un Fonds investit dans des produits dérivés, emprunte des espèces à des fins de placement ou a recours à la vente à découvert physique d'actions ou d'autres actifs du portefeuille, un effet de levier peut survenir dans le Fonds. Un effet de levier survient lorsque l'exposition théorique du Fonds aux actifs sous-jacents est supérieure au montant investi. Il s'agit d'une technique de placement qui amplifie les profits et les pertes. Par conséquent, toute détérioration de la valeur ou du niveau de l'actif sous-jacent, du taux ou de l'indice peut amplifier les pertes comparativement à celles qui auraient été subies si l'actif sous-jacent avait été détenu directement par le Fonds et cela peut entraîner des pertes supérieures au montant investi dans l'instrument dérivé lui-même. L'effet de levier peut accroître la volatilité, nuire à la liquidité du Fonds et contraindre celui-ci à liquider des positions à des moments défavorables.

En 2024 et en 2023, le FNB d'obligations de qualité supérieure CI, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI ont exercé un effet de levier en effectuant des ventes à découvert, lesquelles exposent les Fonds au risque lié à la vente à découvert.

Le risque lié à la vente à découvert représente le risque de perte lié à la vente à découvert. Rien ne garantit que la valeur des titres baissera durant la période de la vente à découvert pour que les Fonds réalisent un profit, et la valeur des titres vendus à découvert pourrait même s'apprécier, générant une perte pour les Fonds. Les Fonds pourraient avoir des difficultés à racheter et à rendre les titres empruntés s'il n'existe pas de marché liquide pour ceux-ci. Le prêteur peut également rappeler les titres empruntés en tout temps. Le prêteur peut faire faillite, et les Fonds pourraient perdre les biens en garantie déposés auprès du prêteur. Les Fonds atténuent ce risque en déposant les biens en garantie seulement auprès d'institutions financières réglementées ou de courtiers réglementés.

Chacun des Fonds peut emprunter des espèces jusqu'à concurrence de 20 % de sa valeur liquidative et peut vendre des titres à découvert; ainsi, la valeur marchande globale des titres vendus à découvert sera limitée à 20 % de la valeur liquidative de chaque Fonds. L'utilisation combinée de la vente à découvert et des emprunts d'espèces par chacun des Fonds est assujettie à une limite globale de 20 % de la valeur liquidative de chacun des Fonds.

Au cours de la période close le 30 juin 2024, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le FNB d'obligations de qualité supérieure CI a été de néant (néant de la valeur liquidative), (néant au 31 décembre 2023, néant de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier utilisé au cours de la période était de néant (néant de la valeur liquidative), (néant au 31 décembre 2023, néant de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2024, le FNB d'obligations de qualité supérieure CI avait donné en garantie au courtier principal des titres correspondant à 2 456 156 \$ (3 983 149 \$ au 31 décembre 2023).

Au cours de la période close le 30 juin 2024, la valeur totale minimale de l'effet de levier exercé par le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI a été de 0,01 million \$ (néant de la valeur liquidative), (néant au 31 décembre 2023, néant de la valeur liquidative) et la valeur totale maximale de l'effet de levier utilisé au cours de la période était de 0,04 million \$ (0,01 % de la valeur liquidative), (néant au 31 décembre 2023, néant de la valeur liquidative).

Au 30 juin 2024, le FNB amélioré d'obligations gouvernementales CI avait donné en garantie auprès du courtier principal des titres correspondant à néant (17 087 815 \$ au 31 décembre 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.

L'objectif d'investissement du Fonds de lingots d'or CI est de fournir aux porteurs de parts une exposition à l'or et le Fonds ne devrait pas avoir d'exposition à d'autres investissements ou actifs. Hormis la trésorerie et les équivalents de trésorerie, le Fonds investira la quasi-totalité de ses actifs dans l'or. La valeur liquidative du Fonds peut être plus volatile que la valeur d'un portefeuille ou d'un Fonds d'investissement plus largement diversifié et peut fluctuer considérablement sur de courtes périodes. Cela peut avoir une incidence négative sur la valeur liquidative du Fonds.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

## Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque que l'émetteur du titre ou la contrepartie à un instrument financier ne puisse pas respecter ses obligations financières. La juste valeur d'un titre de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur. La valeur comptable des titres de créance telle que présentée dans l'inventaire du portefeuille représente l'exposition au risque de crédit de chaque Fonds. L'exposition au risque de crédit pour les dérivés se fonde sur le profit latent de chaque Fonds sur les obligations contractuelles envers la contrepartie à la date de clôture. La note de crédit d'une contrepartie à un dérivé est indiquée dans l'inventaire du portefeuille de chaque Fonds, le cas échéant. L'exposition au risque de crédit des autres actifs du Fonds correspond à leur valeur comptable présentée dans les états de la situation financière.

Certains Fonds investissent uniquement dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents et peuvent être exposés au risque de crédit indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents investissent dans des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés.

Les notes de crédit des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés proviennent de S&P Global Ratings, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement. Les notes de crédit peuvent être à long terme ou à court terme. Les notes de crédit à court terme sont généralement attribuées aux obligations et instruments dérivés à court terme.

Le tableau ci-dessous permet de comparer les notes de crédit à long terme présentées dans le tableau des risques de crédit et les notes de crédit à court terme présentées à l'annexe des dérivés de l'inventaire du portefeuille.



# Notes des états financiers (non audité) (suite)

## Notes de crédit selon le tableau des risques

### de crédit

AAA/Aaa/A++

AA/Aa/A+

A

BBB/Baa/B++

BB/Ba/B+

B

CCC/Caa/C++

CC/Ca/C+

C et moins

Aucune

## Notes de crédit selon les tableaux

### des dérivés

A-1+

A-1, A-2, A-3

B, B-1

B-2

B-3

C

-

-

D

AN

Les soldes de trésorerie présentés dans les états de la situation financière sont conservés par le dépositaire. Le gestionnaire surveille régulièrement la solvabilité du dépositaire. La note de crédit du dépositaire au 30 juin 2024 était de AA (AA au 31 décembre 2023).

Toutes les opérations effectuées par les Fonds portant sur des titres cotés sont réglées ou payées à la livraison en utilisant des courtiers approuvés. Le risque de défaillance est considéré comme minime, étant donné que la livraison des titres vendus n'est effectuée qu'au moment de la réception du paiement par le courtier. Le paiement est effectué lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une ou l'autre des parties manque à son obligation.

## Risque de liquidité

Le risque de liquidité s'entend du risque que les Fonds ne soient pas en mesure de satisfaire à leurs obligations en temps opportun ou à un prix raisonnable.

Les Fonds sont principalement exposés au risque de liquidité en raison des rachats de parts/d'actions quotidiens en espèces. En règle générale, les Fonds investissent dans des titres qui sont considérés comme étant facilement réalisables étant donné qu'ils sont négociés en Bourse. Certains titres peuvent être moins liquides que d'autres titres et comportent le risque que le gestionnaire ne soit pas en mesure de les vendre aux cours du marché en vigueur. Ainsi, il peut être difficile de modifier considérablement la composition du portefeuille d'un Fonds dans une courte période.

Les passifs financiers arrivent à échéance en l'espace d'un à trois mois, sauf pour les parts/les actions rachetables, lesquelles peuvent être rachetées sur demande au gré du porteur. Le gestionnaire ne s'attend pas à ce que cette échéance contractuelle soit représentative des sorties de trésorerie réelles, car les porteurs de parts/les actionnaires conservent généralement ces instruments pour une plus longue période.

## Risque de marché

Les placements des Fonds sont exposés au risque de marché, qui est le risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des conditions du marché.

### Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt). La valeur de chaque placement est influencée par les perspectives de l'émetteur et par les conditions économiques et politiques générales, de même que par les tendances du secteur et du marché. Les titres présentent tous un risque de perte de capital. Sauf pour les options vendues, les contrats à

terme standardisés vendus à découvert et les placements vendus à découvert, le risque maximal provenant des instruments financiers est équivalent à leur juste valeur.

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme et, par conséquent, leur exposition à l'autre risque de prix est minime.

### Risque de change

Le risque de change provient d'instruments financiers qui sont libellés en devises autres que le dollar canadien, la monnaie fonctionnelle des Fonds. Par conséquent, les Fonds peuvent être exposés au risque que la valeur des titres libellés dans d'autres devises varie à cause de fluctuations des taux de change. L'inventaire du portefeuille indique toutes les obligations et tous les dérivés qui sont libellés en devises. Les actions négociées sur des marchés étrangers sont aussi exposées à des risques de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle des Fonds afin de déterminer leur juste valeur.

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de change indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers qui sont libellés en devises autres que la monnaie fonctionnelle des Fonds.

### Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt et des dérivés de taux d'intérêt fluctue en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur des Fonds qui investissent dans des titres de créance ou des titres de fiducies de revenu sera influencée par des fluctuations du taux d'intérêt applicable. Si les taux d'intérêt diminuent, la juste valeur des titres de créance existants pourrait augmenter en raison du rendement plus élevé. Par contre, si les taux d'intérêt augmentent, la réduction du rendement des titres de créance existants pourrait entraîner une baisse de leur juste valeur. En général, la baisse est plus importante pour les titres de créance à long terme que pour les titres de créance à court terme.

Le risque de taux d'intérêt s'applique également aux Fonds qui investissent dans des titres convertibles. La juste valeur de ces titres varie de façon inverse aux taux d'intérêt, tout comme d'autres titres de créance. Toutefois, étant donné qu'ils peuvent être convertis en actions ordinaires, les titres convertibles sont généralement moins touchés par les fluctuations de taux d'intérêt que d'autres titres de créance.

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de taux d'intérêt indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers portant intérêt.

## Risques propres au Fonds de lingots d'or CI

### Risques liés à la source de prix

L'or est négocié dans le monde entier et 24 heures sur 24 par le biais de transactions de gré à gré (dont les principaux centres sont à Londres, New York et Zurich), ainsi que par le biais de Bourses (dont la plus importante est le COMEX, exploité par New York Mercantile Exchange, Inc.) Le prix de l'or est déterminé deux fois par jour (en dollars américains) par un processus d'enchères mené par l'ICE Benchmark Administration Limited et publié par la London Bullion Market Association (la LBMA). L'or détenu par le Fonds est évalué sur la base du prix de l'or déterminé par la séance de l'après-midi, qui débute à 15 heures, heure de Londres, Angleterre (le LBMA Gold Price PM), ou par tout autre prix ou indice de marché sélectionné par le gestionnaire de temps à autre.

# Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les divergences potentielles dans le calcul du LBMA Gold Price PM, ainsi que toute modification future du LBMA Gold Price PM, pourraient avoir une incidence sur la valeur de l'or détenu par le Fonds et pourraient avoir un effet négatif sur la valeur d'un investissement dans les parts du Fonds.

## *Risque lié à la garde de l'or*

Il existe un risque qu'une partie ou la totalité des lingots d'or du Fonds soit perdue, endommagée ou volée, nonobstant le traitement des livraisons de lingots d'or par le dépositaire d'or et le stockage des lingots d'or dans ses coffres. Les lingots d'or achetés par le Fonds sont attribués par la contrepartie concernée dans un délai et d'une manière commercialement raisonnables. Il existe une période entre le moment où le Fonds a acheté des lingots d'or et le moment où ces lingots d'or ont été entièrement attribués au Fonds, ou lorsque le Fonds rachète des parts, pendant laquelle le Fonds détiendra des lingots d'or non attribués. Le Fonds tente de limiter la durée de la période pendant laquelle les lingots d'or ne sont pas attribués. Pendant cette période, le Fonds est exposé au risque de crédit de la contrepartie et/ou des vendeurs de lingots d'or. Rien ne garantit que les pertes attribuables à la détention de lingots d'or non attribués seront récupérées par le Fonds. En outre, l'accès aux lingots d'or du Fonds pourrait être restreint par des événements naturels, des actions humaines ou des situations de pandémie. L'un ou l'autre de ces événements peut avoir un effet négatif sur les actifs du Fonds et, par conséquent, sur un investissement dans les parts du Fonds.

## **Hiérarchie des justes valeurs**

Les Fonds doivent classer les instruments financiers évalués selon la juste valeur en utilisant une hiérarchie des justes valeurs. Les placements évalués selon des cours cotés sur des marchés actifs sont classés au niveau 1. Ce niveau comprend des actions cotées en Bourse, des fonds négociés en Bourse, des fonds communs de placement offerts aux particuliers, des bons de souscription négociés en Bourse, des contrats à terme standardisés et des options négociées en Bourse.

Les instruments financiers qui sont négociés sur les marchés qui ne sont pas considérés comme étant actifs, mais qui sont évalués selon les cours du marché, les cotations de courtiers ou d'autres sources d'évaluations étayées par des données observables sont classés au niveau 2. Ces instruments comprennent les titres à revenu fixe, les titres adossés à des créances hypothécaires, les instruments à court terme, les bons de souscription hors cote, les options hors cote, les billets structurés de titres indexés, les contrats de change à terme, les swaps et les certificats américain de dépôt et les certificats mondiaux d'actions étrangères si aucun cours du marché n'est disponible.

L'évaluation des placements classés au niveau 3 repose sur des données non observables importantes. Les placements du niveau 3 comprennent les actions de sociétés fermées, les prêts à terme privés, les fonds d'actions privés et certains dérivés. Des cours observables n'étant pas disponibles pour ces titres, les Fonds pourraient utiliser une variété de techniques d'évaluation pour calculer leur juste valeur.

Certains Fonds investissent dans d'autres fonds de placement et ces placements sont classés au niveau 1.

La politique des Fonds consiste à comptabiliser les transferts d'un niveau à l'autre de la hiérarchie à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Les détails de l'exposition de chaque Fonds aux risques liés aux instruments financiers, y compris le risque de concentration et le classement dans la hiérarchie des justes valeurs, sont disponibles dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

## **11. LÉGENDE DES DEVISES**

Voici une liste des abréviations qui peuvent être utilisées dans les états financiers :

AUD	Dollar australien
MXN	Peso mexicain
BMD	Dollar des Bermudes
MYR	Ringgit malaisien
BRL	Réal brésilien
NOK	Couronne norvégienne
CAD	Dollar canadien
NZD	Dollar néo-zélandais
CHF	Franc suisse
PEN	Nouveau sol péruvien
DKK	Couronne danoise
PHP	Peso philippin
EUR	Euro
PKR	Roupie pakistanaise
GBP	Livre sterling
PLN	Zloty polonais
HKD	Dollar de Hong Kong
SEK	Couronne suédoise
IDR	Rupiah indonésienne
SGD	Dollar de Singapour
ILS	Shekel israélien
THB	Baht thaï
INR	Roupie indienne
TWD	Nouveau dollar de Taiwan
JPY	Yen japonais
USD	Dollar américain
KRW	Won sud-coréen
ZAR	Rand sud-africain

# Avis juridique

---

Certains noms, mots, phrases, graphismes ou conceptions graphiques figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Gestion mondiale d'actifs CI.

Fonds CI, Financière CI, Placements CI et le logo Placements CI sont des marques déposées de Gestion mondiale d'actifs CI. Les marques et noms des logos CI et de l'icône CI sont la propriété de Gestion mondiale d'actifs CI et sont utilisés sous licence. Gestion mondiale d'actifs CI est le nom d'une société enregistrée de CI Investments Inc.

Morningstar® est une marque de commerce de Morningstar Inc. et est utilisée aux termes d'une licence à des fins spécifiques par Gestion mondiale d'actifs CI. FNB Indice Morningstar Canada Momentum CI, FNB Indice Morningstar Canada Valeur CI, FNB Indice Morningstar International Momentum CI, FNB Indice Morningstar International Valeur CI et FNB Indice Morningstar Banque Nationale Québec CI (les « Fonds Morningstar ») ne sont pas parrainés, approuvés, vendus ni promus par Morningstar ni aucune de ses filiales (collectivement, « Morningstar »), et Morningstar ne fait aucune déclaration sur les occasions d'investissement dans ce fonds.

FNB indiciel MSCI Monde Incidence ESG CI (le « Fonds MSCI ») et le fonds et les titres auxquels il est fait référence dans le présent document ne sont pas parrainés, approuvés ni promus par MSCI, et MSCI ne peut être tenue responsable de tout fonds ou titre sur lequel se basent ces derniers. Le prospectus du Fonds contient une description plus détaillée de la relation limitée entre MSCI, Gestion mondiale d'actifs CI et tout autre fonds apparenté figurant dans le prospectus des fonds.

Le FNB Indice des obligations gouvernementales coupons détachés échelonnés 1-5 ans CI n'est pas parrainé, avalisé, vendu ou promu par FTSE Global Debt Capital Markets Inc. (« FTDCM »), FTSE International Limited (« FTSE »), les sociétés du London Stock Exchange Group (la « Bourse ») ou TSX Inc. (conjointement avec FTDCM, FTSE et la Bourse, les « Parties concédantes »). Les Parties concédantes ne donnent aucune garantie ni ne font aucune déclaration, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir de l'utilisation de l'indice FTSE Canada 1-5 Year Laddered Government Bond<sup>MD</sup> (« l'indice ») et/ou du chiffre auquel ledit indice se situe à un moment particulier d'un jour donné ou autre. L'indice est compilé et calculé par FTDCM et tous les droits d'auteur sur les valeurs de l'indice et les listes constitutives sont détenus par FTDCM. Les parties concédantes ne sont pas responsables (que ce soit par négligence ou autrement) envers toute personne pour toute erreur dans l'indice et les parties concédantes ne sont pas tenues d'informer toute personne de toute erreur dans cet indice. L'indice FTSE Canada 1-5 Year Laddered Government Bond<sup>MD</sup> est une marque de commerce de FTSE Global Debt Capital Markets Inc. qui incorpore « FTSE<sup>MD</sup> » sous licence. « FTSE<sup>MD</sup> » est une marque de commerce des sociétés du London Stock Exchange Group et est utilisée aux termes d'une licence par FTDCM.

Le fonds n'est pas parrainé, endossé, vendu ou promu par FTSE Global Debt Capital Markets Inc. (« FTDCM »), FTSE International Limited (« FTSE »), les sociétés du London Stock Exchange Group (la « Bourse ») ou TSX Inc. (conjointement avec FTDCM, FTSE et la Bourse, les « Parties concédantes »). Les parties concédantes ne donnent aucune garantie ni ne font aucune déclaration, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir de l'utilisation de l'indice des obligations du gouvernement du Canada à court terme FTSE Canada (« l'indice ») et/ou du chiffre auquel ledit indice se situe à un moment particulier d'un jour donné ou autre. L'indice est compilé et calculé par FTDCM et tous les droits d'auteur sur les valeurs de l'indice et les listes constitutives sont détenus par FTDCM. Les parties concédantes ne sont pas responsables (que ce soit par négligence ou autrement) envers toute personne pour toute erreur dans l'indice et les parties concédantes ne sont pas tenues d'informer toute personne de toute erreur dans cet indice. « FTSE<sup>MD</sup> » est une marque de commerce des sociétés du London Stock Exchange Group et est utilisée aux termes d'une licence par FTDCM.

Solactive AG (« Solactive ») est le concédant de licence de l'indice Solactive Canada Broad Market (CA NTR), de l'indice Solactive Developed Markets Healthcare 150 CAD (CA NTR), de l'indice Solactive GBS United States 1000 CAD (CA NTR), de l'indice Solactive GBS United States 500 CAD à (CA NTR), de l'indice Solactive GBS United States 500 Hedged to CAD à (CA NTR), de l'indice Solactive U.S. Treasury Inflation-Linked Bond Hedged to CAD TR, Solactive Global Genomics Immunology and Medical Revolution CAD Hedged Index NTR, de l'indice Solactive Digital Security CAD Hedged Index NTR, de l'indice Solactive DM Minimum Downside Volatility Hedged to CAD NTR, de l'indice Solactive DM Minimum Downside Volatility CAD NTR, de l'indice Solactive US Minimum Downside Volatility Hedged to CAD NTR, et de l'indice Solactive US Minimum Downside Volatility CAD NTR (les « Indices Solactive »). Les instruments financiers qui sont basés sur les indices Solactive ne sont pas commandités, endossés, promus ou vendus par Solactive de quelque manière que ce soit et Solactive ne fait aucune déclaration, garantie ou assurance expresse ou implicite en ce qui concerne : (a) l'opportunité d'investir dans les instruments financiers; (b) la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices Solactive; et/ou (c) les résultats obtenus ou à obtenir par toute personne ou entité de l'utilisation des indices Solactive. Solactive ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices Solactive et ne peut être tenue responsable de toute erreur ou omission à cet égard. Nonobstant les obligations de Solactive à l'égard de ses concédants, Solactive se réserve le droit de modifier les méthodes de calcul ou de publication concernant les indices Solactive et Solactive ne sera pas responsable de toute erreur de calcul ou de toute publication incorrecte, retardée ou interrompue concernant les indices Solactive. Solactive ne sera pas responsable de tout dommage, y compris, mais sans s'y limiter, toute perte de profits ou d'affaires, ou tout dommage particulier, accessoire, punitif, indirect ou consécutif subi ou encouru à la suite de l'utilisation (ou de l'incapacité à utiliser) des indices Solactive.

LE PRIX DE L'OR LBMA, QUI EST ADMINISTRÉ ET PUBLIÉ PAR ICE BENCHMARK ADMINISTRATION LIMITED (« IBA »), SERT D'ENTRÉE OU DE RÉFÉRENCE SOUS-JACENTE, OU EN FAIT PARTIE, POUR LE FONDS DE LINGOTS D'OR CI.

LE PRIX DE L'OR LBMA EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE PRECIOUS METALS PRICES LIMITED, ET EST AUTORISÉ À L'IBA EN TANT QU'ADMINISTRATEUR DU PRIX DE L'OR LBMA. ICE BENCHMARK ADMINISTRATION EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE L'IBA ET/OU DE SES AFFILIÉS. LE PRIX DE L'OR LBMA PM, ET LES MARQUES DE COMMERCE PRIX DE L'OR LBMA ET ICE BENCHMARK ADMINISTRATION, SONT UTILISÉS PAR GESTION MONDIALE D'ACTIFS CI AVEC LA PERMISSION SOUS LICENCE DE L'IBA.

IBA ET SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES NE FONT AUCUNE RÉCLAMATION, PRÉDICTION, GARANTIE OU DÉCLARATION DE QUELQUE NATURE QUE CE SOIT, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS À OBTENIR DE TOUTE UTILISATION DU COURS DU PRIX DE L'OR LBMA, OU QUANT AU CARACTÈRE APPROPRIÉ OU ADÉQUAT DU PRIX DE L'OR LBMA POUR TOUT OBJECTIF PARTICULIER AUQUEL IL POURRAIT ÊTRE DESTINÉ, Y COMPRIS EN CE QUI CONCERNE LE FONDS DE LINGOTS D'OR CI. DANS TOUTE LA MESURE PERMISE PAR LA LOI APPLICABLE, TOUS LES TERMES, CONDITIONS ET GARANTIES IMPLICITES, Y COMPRIS, MAIS SANS S'Y LIMITER, EN MATIÈRE DE QUALITÉ, DE QUALITÉ MARCHANDE, D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER, DE TITRE OU D'ABSENCE DE CONTREFAÇON, EN RAPPORT AVEC LE PRIX DE L'OR LBMA, SONT EXCLUS PAR LES PRÉSENTES ET NI L'IBA NI AUCUNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES NE SERA

# Avis juridique

---

RESPONSABLE EN MATIÈRE CONTRACTUELLE OU DÉLICTEUELLE (Y COMPRIS LA NÉGLIGENCE), POUR VIOLATION D'UNE OBLIGATION LÉGALE OU NUISANCE, OU EN VERTU DES LOIS ANTITRUST OU AUTRES, EN CE QUI CONCERNE LES INEXACTITUDES, ERREURS, OMISSIONS, RETARDS, DÉFAILLANCES, INTERRUPTIONS OU CHANGEMENTS (MATÉRIELS OU AUTRES) DU PRIX DE L'OR LBMA, OU POUR TOUT DOMMAGE, DÉPENSE OU AUTRE PERTE (DIRECTE OU INDIRECTE) QUE VOUS POURRIEZ SUBIR EN RAISON DE OU EN RELATION AVEC LE PRIX DE L'OR LBMA OU TOUTE CONFIANCE QUE VOUS POURRIEZ LUI ACCORDER.

LE PRIX DE L'OR LBMA EST UNE MARQUE DE COMMERCE DE PRECIOUS METALS PRICES LIMITED, EST LICENCIÉ À ICE BENCHMARK ADMINISTRATION LIMITED (IBA) EN TANT QU'ADMINISTRATEUR DU PRIX DE L'OR LBMA, ET EST UTILISÉ PAR GESTION MONDIALE D'ACTIFS CI AVEC LA PERMISSION SOUS LICENCE DE L'IBA. »

L'indice Alerian, VettaFi et Alerian Galaxy Global Cryptocurrency-Focused Blockchain Equity couvert en \$ CA, l'indice Alerian Galaxy Immersive Digital Worlds couvert en \$ CA, l'indice VettaFi US Enhanced Momentum, l'indice VettaFi US Enhanced Momentum (couvert en \$ CA), l'indice VettaFi US Enhanced Value, et l'indice VettaFi US Enhanced Value (couvert en \$ CA) (les « indices VettaFi ») sont des marques de service de VettaFi LLC (« VettaFi ») et ont été utilisés sous licence par Gestion mondiale d'actifs CI. FNB indiciel chaîne de blocs CI Galaxy, FNB indiciel métavers CI Galaxy, FNB indiciel momentum amélioré américain CI et FNB indiciel valeur améliorée américain CI (les « FNB VettaFi ») ne sont pas émis, parrainés, endossés, vendus ou promus par VettaFi ou ses affiliés. VettaFi ne fait aucune déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, aux acheteurs ou aux propriétaires du FNB VettaFi ou à tout membre du public concernant l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le FNB VettaFi en particulier ou la capacité des indices VettaFi à suivre la performance générale du marché. La seule relation de VettaFi avec les FNB VettaFi est la licence des marques de service et des indices VettaFi, qui est déterminé, composé et calculé par VettaFi sans égard à Gestion mondiale d'actifs CI ou aux FNB VettaFi. VettaFi n'est pas responsable et n'a pas participé à la détermination du calendrier, des prix ou des quantités de FNB VettaFi. VettaFi n'a aucune obligation ou responsabilité en ce qui concerne l'émission, l'administration, la commercialisation ou la négociation des FNB VettaFi.

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires de ces états financiers en composant le **1 800 792-9355**, en envoyant un courriel à [servicefrancais@ci.com](mailto:servicefrancais@ci.com) ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet du Fonds, est disponible à l'adresse [www.ci.com](http://www.ci.com) ou à l'adresse [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca).

**Pour plus d'informations, veuillez visiter [www.ci.com](http://www.ci.com).**

SA\_F 08/24