



États financiers semestriels

30 juin 2020 (non audité)

FNB d'actions mondiales ONE CI (ONEQ)

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI (ONEB)

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI (CHNA.B)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI (DGRC)

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI (EMV.B)

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI (EHE / EHE.B)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI (IQD / IQD.B)

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI (JAPN / JAPN.B)

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI (UMI / UMI.B)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI (DGR / DGR.B)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI (DQD)

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI (CAGG)

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI (CAGS)

Avis aux porteurs de parts

Le gestionnaire des Fonds, CI Investments Inc., nomme des auditeurs indépendants pour faire auditer les états financiers annuels des Fonds. En vertu des lois canadiennes sur les valeurs mobilières (Règlement 81-106), si les auditeurs n'ont pas effectué l'examen des états financiers semestriels, un avis accompagnant les états financiers doit en faire état.

Les auditeurs indépendants des Fonds n'ont pas effectué l'examen des présents états financiers semestriels en conformité avec les normes établies par Comptables professionnels agréés du Canada (CPA Canada).

Table des matières

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI 1

FNB d’actions mondiales ONE CI 11

FNB d’obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI 17

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI 22

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI 27

FNB Indice d’actions européennes couvert WisdomTree CI 38

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI 44

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI 53

FNB Indice d’actions japonaises WisdomTree CI 62

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI 72

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI 81

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI 89

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI 97

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI 110

Notes des états financiers (non audité) 119

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	2 817 019 \$	2 642 707 \$
Trésorerie	24 164	43 737
Plus-value latente des contrats de change	29	–
Créances :		
Titres de placement vendus	18 873	–
Dividendes	8 630	100
Total de l'actif	2 868 715	2 686 544
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	26	–
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	935	–
Distributions	32 000	22 000
Frais de gestion	1 139	1 242
Total du passif	34 100	23 242
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 834 615 \$	2 663 302 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 834 615	2 663 302
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	100 000	100 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	28,35 \$	26,63 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	61 610 \$	44 960 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(848)	144
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	157 952	288 488
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	218 714	333 592
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	215	(14)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	3	—
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	218	(14)
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	218 932	333 578
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	23	—
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	214	(474)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	278	(554)
Total des autres revenus (pertes)	515	(1 028)
Total des revenus (pertes)	219 447	332 550
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	8 211	7 248
Retenues d'impôt étranger	2 236	2 796
Coûts de transaction (note 2)	187	200
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	76	82
Total des charges	10 710	10 326
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(76)	(82)
Charges nettes	10 634	10 244
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	208 813 \$	322 306 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	100 000	100 000
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	2,09 \$	3,22 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États de révolutions de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	2 663 302 \$	2 217 177 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	208 813	322 306
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(37 500)	(17 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(37 500)	(17 000)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	2 834 615 \$	2 522 483 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	208 813 \$	322 306 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	848	(144)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(157 952)	(288 488)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	(3)	—
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(278)	554
Achat de placements ¹	(98 855)	(84 964)
Produit de la vente de placements ¹	81 647	76 360
Variation des créances	(27 403)	(8 322)
Variation des créditeurs	832	(420)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	7 649	16 882
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(27 500)	(2 500)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(27 500)	(2 500)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	278	(554)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(19 573)\$	13 828 \$
Trésorerie au début de la période	43 737 \$	25 969 \$
Trésorerie à la fin de la période	24 164 \$	39 797 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	50 844 \$	33 407 \$
Intérêts reçus	23	—

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %				Boissons – 4,9 %			
Chine – 99,4 %				Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.			
Aérospatiale et défense – 0,6 %				300 6 333 6 073			
AECC Aero-Engine Control Co., Ltd.	300	749	788	Kweichow Moutai Co., Ltd.	300	66 069	84 496
AECC Aviation Power Co., Ltd.	600	2 485	2 712	Luzhou Laojiao Co., Ltd.	400	6 454	7 017
AVIC Aircraft Co., Ltd.	800	2 439	2 733	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	200	3 340	5 584
AVIC Electromechanical Systems Co., Ltd.	800	1 061	1 217	Tsingtao Brewery Co., Ltd.	200	1 899	2 946
AVIC Shenyang Aircraft Co., Ltd.	200	1 207	1 264	Wuliangye Yibin Co., Ltd.	1 000	24 761	32 946
AviChina Industry & Technology Co., Ltd.	1 000	608	617	Total boissons		108 856	139 062
AVICOPTER PLC	300	2 665	2 372	Biotechnologie – 0,8 %			
China Aerospace Times Electronics Co., Ltd.	1 100	1 257	1 364	BeiGene Ltd.	15	3 228	3 849
China Avionics Systems Co., Ltd.	300	795	769	Beijing Tiantan Biological Products Corp., Ltd.	360	1 873	3 142
China Spacesat Co., Ltd.	400	1 591	2 374	China Biologic Products Holdings, Inc.	18	2 716	2 505
Total aérospatiale et défense		14 857	16 210	Hualan Biological Engineering, Inc.	585	3 967	5 644
Fret aérien et logistique – 0,7 %				Jinyu Bio-Technology Co., Ltd.	600	2 091	3 216
SF Holding Co., Ltd.	400	3 179	4 212	Shanghai RAAS Blood Products Co., Ltd.	1 100	1 527	1 792
Sinotrans Ltd.	764	606	475	Zai Lab Ltd.	23	2 523	2 573
STO Express Co., Ltd.	200	726	632	Total biotechnologie		17 925	22 721
YTO Express Group Co., Ltd.	600	1 873	1 682	Produits de construction – 0,1 %			
Yunda Holding Co., Ltd.	219	1 345	1 031	Beijing New Building Materials PLC	500	2 369	2 053
ZTO Express Cayman, Inc.	231	6 994	11 550	Zhejiang Weixing New Building Materials Co., Ltd.	240	605	538
Total fret aérien et logistique		14 723	19 582	Total produits de construction		2 974	2 591
Lignes aériennes – 0,5 %				Marchés financiers – 0,9 %			
Air China Ltd.	3 000	4 437	2 897	CITIC Securities Co., Ltd.	6 400	27 517	26 610
China Eastern Airlines Corp., Ltd.	5 100	4 854	3 489	Produits chimiques – 1,4 %			
China Southern Airlines Co., Ltd.	4 000	4 370	3 196	ENN Ecological Holdings Co., Ltd.	300	610	597
Hainan Airlines Holding Co., Ltd.	4 600	1 520	1 328	Hangjin Technology Co., Ltd.	200	863	860
Juneyao Airlines Co., Ltd.	500	1 396	876	Hengli Petrochemical Co., Ltd.	700	2 095	1 887
Spring Airlines Co., Ltd.	200	1 634	1 357	Hengyi Petrochemical Co., Ltd.	390	955	685
Total lignes aériennes		18 211	13 143	Huapont Life Sciences Co., Ltd.	800	755	829
Automobiles – 1,0 %				Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co., Ltd.	1 900	1 136	929
BYD Co., Ltd.	1 000	7 650	12 171	Jiangsu Yangnong Chemical Co., Ltd.	100	1 278	1 588
Geely Automobile Holdings Ltd.	3 000	7 562	6 432	Kangde Xin Composite Material Group Co., Ltd.	1 600	-	-
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	2 400	4 099	2 658	Kingfa Sci & Tech Co., Ltd.	1 000	1 355	2 536
SAIC Motor Corp., Ltd.	2 000	9 112	6 542	Lianhe Chemical Technology Co., Ltd.	300	1 135	1 259
Total automobiles		28 423	27 803	Lomon Billions Group Co., Ltd.	400	1 146	1 425
Institutions financières – 12,7 %				Luxi Chemical Group Co., Ltd.	600	1 205	862
Agricultural Bank of China Ltd.	38 100	23 781	22 949	Ningbo Shanshan Co., Ltd.	580	1 405	1 316
Bank of China Ltd.	60 000	34 951	32 580	Rongsheng Petro Chemical Co., Ltd.	700	1 615	1 658
Bank of Communications Co., Ltd.	24 400	24 332	22 327	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co., Ltd.	700	2 589	2 383
China CITIC Bank Corp., Ltd.	10 000	8 476	6 735	Sichuan Hebang Biotechnology Co., Ltd.	2 100	594	534
China Construction Bank Corp.	62 000	69 942	68 766	Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	3 200	1 664	1 458
China Merchants Bank Co., Ltd.	10 400	71 931	66 951	Tianqi Lithium Corp.	520	2 995	2 298
China Minsheng Banking Corp., Ltd.	22 500	25 653	23 936	Tongkun Group Co., Ltd.	600	1 718	1 474
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	59 600	60 820	51 033	Transfar Zhilian Co., Ltd.	300	400	314
Industrial Bank Co., Ltd.	8 800	32 437	26 736	Wanhua Chemical Group Co., Ltd.	900	9 411	8 662
Ping An Bank Co., Ltd.	5 700	17 610	14 047	Xinyangfeng Agricultural Technology Co., Ltd.	400	604	681
Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	1 500	1 329	1 320	Zhejiang Juhua Co., Ltd.	700	974	928
Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	5 000	4 042	3 910	Zhejiang Longsheng Group Co., Ltd.	1 500	4 041	3 694
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd.	9 300	21 416	18 944				
Total institutions financières		396 720	360 234				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Zhejiang Runtu Co., Ltd.	400	856	704				
Total produits chimiques		41 399	39 561	Services aux consommateurs diversifiés - 1,2 %			
Fournitures et services commerciaux - 0,4 %				New Oriental Education & Technology Group, Inc.	70	11 006	12 416
China Everbright International Ltd.	2 000	2 067	1 438	TAL Education Group	220	14 577	20 490
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	1 000	6 531	6 326	Total services aux consommateurs diversifiés		25 583	32 906
Jihua Group Corp., Ltd.	1 000	623	639	Matériel électrique - 0,9 %			
Shanghai M&G Stationery, Inc.	300	2 722	3 154	China XD Electric Co., Ltd.	1 200	813	1 118
Tus Environmental Science And Technology Development Co., Ltd.	500	877	714	Dongfang Electric Corp., Ltd.	700	1 197	1 193
Total fournitures et services commerciaux		12 820	12 271	Fangda Carbon New Material Co., Ltd.	1 460	2 951	1 765
Matériel de communications - 0,7 %				Gotion High-tech Co., Ltd.	400	1 083	2 067
Fiberhome Telecommunication Technologies Co., Ltd.	300	1 569	1 670	Hongfa Technology Co., Ltd.	200	1 283	1 545
Guangzhou Haige Communications Group, Inc. Co.	900	1 814	2 242	Jiangsu Zhongtian Technology Co., Ltd.	1 200	1 903	2 645
Hengtong Optic-electric Co., Ltd.	700	2 235	2 212	Nanyang Topsec Technologies Group, Inc.	300	1 485	1 535
ZTE Corp.	2 000	11 606	13 316	NARI Technology Co., Ltd.	1 000	3 943	3 899
Total matériel de communications		17 224	19 440	Shanghai Electric Group Co., Ltd.	4 100	2 820	2 811
Construction et génie - 1,6 %				TBEACo., Ltd.	2 000	2 541	2 607
China Communications Construction Co., Ltd.	3 900	4 726	3 576	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd.	1 700	3 567	2 962
China Conch Venture Holdings Ltd.	1 000	5 658	5 746	Zhejiang Chint Electrics Co., Ltd.	500	2 494	2 537
China Gezhouba Group Co., Ltd.	1 700	2 169	1 947	Total matériel électrique		26 080	26 684
China National Chemical Engineering Co., Ltd.	1 100	1 353	1 161	Équipement, instruments et composants électroniques - 4,0 %			
China Railway Construction Corp., Ltd.	4 100	7 001	5 800	AAC Technologies Holdings, Inc.	500	5 623	4 178
China Railway Group Ltd.	6 900	6 758	5 867	Avary Holding Shenzhen Co., Ltd.	100	932	964
China Railway Hi-tech Industry Co., Ltd.	500	1 070	849	AVICJonhon Optron Technology Co., Ltd.	260	1 891	2 053
China State Construction Engineering Corp., Ltd.	12 100	12 991	11 112	BOE Technology Group Co., Ltd.	16 100	13 607	14 476
China State Construction International Holdings Ltd.	2 000	2 342	1 589	Foxconn Industrial Internet Co., Ltd.	700	2 381	2 042
Metallurgical Corp. of China Ltd.	2 600	1 391	1 256	GoerTek, Inc.	1 100	4 079	6 218
Power Construction Corp. of China Ltd.	4 000	3 285	2 665	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co., Ltd.	2 300	14 333	13 440
Shanghai Construction Group Co., Ltd.	3 300	2 175	1 951	Lingyi iTech Guangdong Co.	800	1 616	1 637
Shanghai Tunnel Engineering Co., Ltd.	1 100	1 269	1 197	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	2 196	15 659	21 711
Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co., Ltd.	800	1 348	1 211	NAURA Technology Group Co., Ltd.	100	1 638	3 291
Total construction et génie		53 536	45 927	OFILM Group Co., Ltd.	1 100	3 278	3 895
Matériaux de construction - 1,3 %				Shengyi Technology Co., Ltd.	600	2 337	3 381
Anhui Conch Cement Co., Ltd.	1 800	17 988	17 830	Shennan Circuits Co., Ltd.	140	4 083	4 515
BBMG Corp.	2 100	1 443	1 237	Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	400	8 980	8 716
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co., Ltd.	600	2 939	4 694	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co., Ltd.	500	2 155	2 883
China Jushi Co., Ltd.	1 300	2 643	2 290	Tianma Microelectronics Co., Ltd.	600	1 894	1 774
China National Building Material Co., Ltd.	2 000	2 896	2 900	Unisplendour Corp., Ltd.	440	2 653	3 641
China Resources Cement Holdings Ltd.	2 000	3 302	3 335	Westone Information Industry, Inc.	300	1 440	1 233
CSG Holding Co., Ltd.	1 320	1 238	1 276	Wingtech Technology Co., Ltd.	200	3 950	4 850
Huaxin Cement Co., Ltd.	420	2 067	1 917	Wuhan Guide Infrared Co., Ltd.	200	1 007	1 127
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd.	300	950	926	WUS Printed Circuit Kunshan Co., Ltd.	600	2 503	2 886
Total matériaux de construction		35 466	36 405	Zhejiang Dahua Technology Co., Ltd.	900	3 331	3 329
Contenants et emballage - 0,1 %				Total équipement, instruments et composants électroniques		99 370	112 240
Shenzhen Jinjia Group Co., Ltd.	600	1 275	1 029	Diversissement - 0,8 %			
Yunnan Energy New Material Co., Ltd.	100	1 219	1 267	NetEase, Inc.	41	16 303	23 977
Total contenants et emballage		2 494	2 296	Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base - 0,3 %			
				Sun Art Retail Group Ltd.	1 500	2 344	3 490
				Yonghui Superstores Co., Ltd.	2 200	3 156	3 973
				Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		5 500	7 463

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Produits alimentaires – 3,0 %							
China Feihe Ltd.	1 000	2 802	2 727	Huaneng Power International, Inc.	4 600	4 075	3 135
China Mengniu Dairy Co., Ltd.	2 000	10 485	10 403	Hubei Energy Group Co., Ltd.	1 300	1 036	881
Dali Foods Group Co., Ltd.	1 500	1 431	1 239	SDIC Power Holdings Co., Ltd.	2 100	3 589	3 178
Foshan Haitian Flavouring & Food Co., Ltd.	480	9 685	11 496	Shanghai Electric Power Co., Ltd.	600	899	855
Guangdong Haid Group Co., Ltd.	400	2 681	3 665	Shenergy Co., Ltd.	1 500	1 622	1 707
Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd.	600	3 243	5 324	Shenzhen Energy Group Co., Ltd.	840	930	750
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	2 800	16 128	16 782	Sichuan Chuantou Energy Co., Ltd.	1 400	2 567	2 499
Muyuan Foodstuff Co., Ltd.	680	10 362	10 736	Zhejiang Zheneng Electric Power Co., Ltd.	2 000	1 513	1 351
New Hope Liuhe Co., Ltd.	1 300	4 828	7 459	Total producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants		49 599	46 703
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	2 000	4 399	4 225	Conglomérats industriels – 0,2 %			
WantWant China Holdings Ltd.	4 000	4 846	4 112	China Baoan Group Co., Ltd.	1 440	1 659	2 359
WH Group Ltd.	5 500	7 368	6 418	CITIC Ltd.	2 000	3 447	2 559
Total produits alimentaires		78 258	84 586	Total conglomerats industriels		5 106	4 918
Services publics de gaz – 0,3 %				Assurance – 5,3 %			
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	500	2 956	2 276	China Life Insurance Co., Ltd.	5 700	22 559	17 374
China Gas Holdings Ltd.	1 400	6 761	5 880	China Pacific Insurance Group Co., Ltd.	3 400	20 468	14 942
Kunlun Energy Co., Ltd.	2 000	1 792	1 764	People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The)	4 000	2 157	1 589
Total services publics de gaz		11 509	9 920	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	8 500	133 369	116 440
Équipement et fournitures de soins de santé – 0,1 %				Total assurance		178 553	150 345
Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co., Ltd.	400	1 513	2 803	Médias et services interactifs – 11,1 %			
Fournisseurs et services de soins de santé – 0,6 %				Baidu, Inc.	151	24 776	24 657
Huadong Medicine Co., Ltd.	480	2 238	2 338	Tencent Holdings Ltd.	3 300	206 280	289 145
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd.	400	1 081	1 434	Total médias et services interactifs		231 056	313 802
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co., Ltd.	1 080	3 071	2 997	Vente au détail par Internet et par marketing direct – 14,1 %			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd.	1 300	3 961	3 850	Alibaba Group Holding Ltd.	896	246 437	263 230
Sinopharm Group Co., Ltd.	800	3 764	2 789	JD.com, Inc.	497	22 729	40 737
Topchoice Medical Corp.	100	1 909	3 211	Meituan Dianping	2 100	35 613	63 437
Total fournisseurs et services de soins de santé		16 024	16 619	Pinduoduo, Inc.	210	10 215	24 552
Technologies des soins de santé – 0,1 %				Trip.com Group Ltd.	246	10 710	8 685
Ping An Healthcare and Technology Co., Ltd.	100	946	2 072	Total vente au détail par Internet et par marketing direct		325 704	400 641
Hôtellerie, restauration et loisirs – 0,5 %				Services de TI – 0,3 %			
Yum China Holdings, Inc.	220	13 697	14 404	China TransInfo Technology Co., Ltd.	500	1 681	2 309
Produits ménagers durables – 2,4 %				DHC Software Co., Ltd.	1 300	2 497	3 134
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai	2 600	31 742	28 318	GDS Holdings Ltd.	36	2 408	3 906
Haier Smart Home Co., Ltd.	2 300	8 349	7 838	Total services de TI		6 586	9 349
Midea Group Co., Ltd.	2 815	30 526	32 405	Outils et services des sciences de la vie – 0,7 %			
Total produits ménagers durables		70 617	68 561	WuXi AppTec Co., Ltd.	380	6 359	6 978
Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants – 1,6 %				Wuxi Biologics Cayman, Inc.	500	8 209	12 459
CGN Power Co., Ltd.	7 000	2 423	1 968	Total outils et services des sciences de la vie		14 568	19 437
China National Nuclear Power Co., Ltd.	2 800	2 674	2 205	Machinerie – 2,3 %			
China Resources Power Holdings Co., Ltd.	2 000	3 619	3 202	China CSSC Holdings Ltd.	400	1 620	1 343
China Yangtze Power Co., Ltd.	5 400	18 477	19 691	China First Heavy Industries	1 700	945	920
Datang International Power Generation Co., Ltd.	1 700	796	691	China International Marine Containers Group Co., Ltd.	720	1 350	1 002
GD Power Development Co., Ltd.	7 100	3 174	2 529	China Shipbuilding Industry Co., Ltd.	6 200	6 048	4 775
Huadian Power International Corp., Ltd.	1 800	1 262	1 185	CRRC Corp., Ltd.	8 400	10 184	7 515
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc.	1 200	943	876	Haitian International Holdings Ltd.	1 000	3 123	2 766
				Han's Laser Technology Industry Group Co., Ltd.	500	3 821	3 461
				Hefei Meiya Optoelectronic Technology, Inc.	100	1 017	1 013

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Inner Mongolia First Machinery Group Co., Ltd.	400	812	800	Tongling Nonferrous Metals Group Co., Ltd.	3 900	1 692	1 449
Jiangsu Hengji Hydraulic Co., Ltd.	100	1 420	1 544	Western Mining Co., Ltd.	1 100	1 356	1 228
North Navigation Control Technology Co., Ltd.	500	774	728	Xiamen Tungsten Co., Ltd.	400	996	912
Sany Heavy Industry Co., Ltd.	3 200	10 157	11 558	Xinxing Ductile Iron Pipes Co., Ltd.	1 300	1 036	859
Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co., Ltd.	200	704	749	Xinyu Iron & Steel Co., Ltd.	800	784	628
Shanghai Mechanical and Electrical Industry Co., Ltd.	200	633	652	Yintai Gold Co., Ltd.	500	1 267	1 509
Shanghai Zhenhua Heavy Industries Co., Ltd.	1 200	811	663	Yunnan Aluminium Co., Ltd.	600	589	504
Sinotruk Hong Kong Ltd.	500	1 383	1 762	Yunnan Chihong Zinc & Germanium Co., Ltd.	1 500	1 255	993
Weichai Power Co., Ltd.	3 900	11 309	10 199	Yunnan Copper Co., Ltd.	500	1 272	1 021
XCMG Construction Machinery Co., Ltd.	2 600	2 648	2 958	Yunnan Tin Co., Ltd.	500	997	824
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	1 500	1 620	1 362	Zhejiang Huayou Cobalt Co., Ltd.	260	1 957	1 945
Zhejiang Dingli Machinery Co., Ltd.	100	1 462	1 459	Zhongjin Gold Corp., Ltd.	1 100	1 737	1 936
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co., Ltd.	845	2 743	3 563	Zijin Mining Group Co., Ltd.	11 900	9 333	9 230
Zhengzhou Yutong Bus Co., Ltd.	700	1 906	1 644	Total métaux et exploitation minière		78 137	71 362
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd.	3 300	4 104	4 085	Pétrole, gaz et autres combustibles - 1,9 %			
Total machinerie		70 594	66 521	China Coal Energy Co., Ltd.	4 000	2 468	1 659
Services maritimes - 0,1 %				China Petroleum & Chemical Corp.	22 500	18 756	13 975
COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	3 500	2 746	1 924	China Shenhua Energy Co., Ltd.	4 200	12 628	10 025
Métaux et exploitation minière - 2,5 %				CNOOC Ltd.	10 000	21 569	15 148
Aluminum Corp. of China Ltd.	6 000	3 588	2 636	PetroChina Co., Ltd.	22 300	18 209	13 019
Angang Steel Co., Ltd.	1 040	666	491	Total pétrole, gaz et autres combustibles		73 630	53 826
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd.	5 100	5 592	4 478	Papier et produits forestiers - 0,1 %			
China Molybdenum Co., Ltd.	7 800	5 612	4 726	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	1 000	1 340	1 232
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co., Ltd.	1 500	3 106	2 692	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd.	750	729	713
Chongqing Iron & Steel Co., Ltd.	4 200	1 484	1 205	Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd.	700	1 282	1 283
Citic Pacific Special Steel Group Co., Ltd.	400	1 331	1 316	Shanying International Holding Co., Ltd.	1 600	1 153	909
Ganfeng Lithium Co., Ltd.	500	3 327	5 157	Total papier et produits forestiers		4 504	4 137
GEM Co., Ltd.	2 100	1 954	2 010	Produits d'hygiène et de beauté - 0,2 %			
Guangdong HEC Technology Holding Co., Ltd.	900	1 716	1 197	Hengan International Group Co., Ltd.	500	4 590	5 333
Guangdong Hongda Blasting Co., Ltd.	200	1 407	1 344	Produits pharmaceutiques - 4,3 %			
Hangzhou Iron & Steel Co.	600	1 172	1 201	Beijing Tongrentang Co., Ltd.	400	2 153	2 089
Hesteel Co., Ltd.	3 000	1 479	1 178	Changchun High & New Technology Industry Group, Inc.	200	14 623	16 762
Hunan Valin Steel Co., Ltd.	840	768	610	Chengdu Kanghong Pharmaceutical Group Co., Ltd.	100	848	955
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co., Ltd.	12 900	3 291	2 682	China Medical System Holdings Ltd.	1 000	1 856	1 604
Jiangsu Shagang Co., Ltd.	600	1 636	1 444	China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	1 000	1 196	786
Jiangxi Copper Co., Ltd.	1 600	3 675	2 927	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co., Ltd.	300	1 769	1 686
Jinduicheng Molybdenum Co., Ltd.	600	895	714	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	2 400	7 076	6 175
Maanshan Iron & Steel Co., Ltd.	1 600	938	795	Dong-E-E-Jiao Co., Ltd.	300	2 027	2 068
Nanjing Iron & Steel Co., Ltd.	1 400	923	871	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	300	2 041	1 867
Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co., Ltd.	2 300	1 319	890	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co., Ltd.	200	924	980
Sansteel Minguang Co., Ltd. Fujian	600	1 076	769	Humanwell Healthcare Group Co., Ltd.	600	1 509	3 145
Shandong Gold Mining Co., Ltd.	560	3 401	3 948	Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd.	1 920	31 137	34 120
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd.	3 300	1 412	1 290	Jilin Aodong Pharmaceutical Group Co., Ltd.	600	1 895	1 817
Shenghe Resources Holding Co., Ltd.	500	866	679	Livzon Pharmaceutical Group, Inc.	390	2 511	3 605
Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfermet Co., Ltd.	1 500	1 232	1 074	Shandong Buchang Pharmaceuticals Co., Ltd.	260	1 045	1 444
				Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co., Ltd.	1 100	4 992	6 186

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Shenzhen Hepalink Pharmaceutical Group Co., Ltd.	200	726	964	Daqin Railway Co., Ltd.	3 900	6 117	5 286
Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co., Ltd.	200	762	1 142	Guangshen Railway Co., Ltd.	2 000	1 169	867
Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co., Ltd.	200	1 217	1 201	Total transport routier et ferroviaire		8 994	7 832
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co., Ltd.	400	1 795	1 617	Matériel et produits semi-conducteurs - 2,0 %			
Sino Biopharmaceutical Ltd.	4 000	7 256	10 263	Gigadevice Semiconductor Beijing, Inc.	140	5 621	6 359
Tasly Pharmaceutical Group Co., Ltd.	500	1 473	1 562	Hangzhou Silan Microelectronics Co., Ltd.	500	1 441	1 413
Tonghua Dongbao Pharmaceutical Co., Ltd.	900	2 175	3 020	JCET Group Co., Ltd.	500	2 046	3 010
Yifan Pharmaceutical Co., Ltd.	400	1 210	1 769	LONGi Green Energy Technology Co., Ltd.	1 300	6 009	10 194
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd.	300	5 125	5 419	Sanan Optoelectronics Co., Ltd.	1 400	4 910	6 739
Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co., Ltd.	100	2 099	3 278	Semiconductor Manufacturing International Corp.	1 500	2 981	7 117
Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co., Ltd.	440	1 537	2 874	Shenzhen Goodix Technology Co., Ltd.	100	3 845	4 292
Zhejiang NHU Co., Ltd.	500	2 165	2 801	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co., Ltd.	1 000	2 199	4 324
Total produits pharmaceutiques		105 142	121 199	Tianshui Huatian Technology Co., Ltd.	1 100	2 840	2 866
Services professionnels - 0,1 %				Unigroup Guoxin Microelectronics Co., Ltd.	200	1 893	2 801
51job, Inc.	15	1 653	1 467	Will Semiconductor Ltd.	100	3 794	3 888
Gestion et promotion immobilières - 4,6 %				Xinyi Solar Holdings Ltd.	2 000	2 402	2 580
China Evergrande Group	2 000	7 190	7 029	Total matériel et produits semi-conducteurs		39 981	55 583
China Fortune Land Development Co., Ltd.	1 100	5 877	4 841	Logiciels - 1,6 %			
China Jinmao Holdings Group Ltd.	4 000	4 041	3 831	360 Security Technology, Inc.	300	1 347	1 058
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co., Ltd.	1 800	6 658	5 697	Aisino Corp.	600	2 641	1 876
China Overseas Land & Investment Ltd.	2 000	10 102	8 242	Beijing Shiji Information Technology Co., Ltd.	200	1 460	1 503
China Resources Land Ltd.	2 000	12 915	10 315	China National Software & Service Co., Ltd.	200	2 683	3 050
China Vanke Co., Ltd.	4 200	24 749	20 483	Glodon Co., Ltd.	400	3 137	5 368
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	2 000	2 193	2 123	Hundsun Technologies, Inc.	468	6 927	9 704
Country Garden Holdings Co., Ltd.	5 000	10 385	8 365	Iflytek Co., Ltd.	900	5 777	6 486
ESR Cayman Ltd.	600	1 974	1 932	Kingdee International Software Group Co., Ltd.	1 000	1 296	3 167
Financial Street Holdings Co., Ltd.	1 400	2 116	1 790	Shanghai 2345 Network Holding Group Co., Ltd.	2 500	1 511	1 352
Gemdale Corp.	2 100	5 669	5 539	Shanghai Baosight Software Co., Ltd.	100	1 059	1 137
Greenland Holdings Corp., Ltd.	2 100	2 717	2 499	Venustech Group, Inc.	300	1 888	2 430
Jiangsu Zhongnan Construction Group Co., Ltd.	1 100	2 160	1 885	Yonyou Network Technology Co., Ltd.	1 014	5 869	8 610
Jinke Properties Group Co., Ltd.	1 500	2 145	2 357	Total logiciels		35 595	45 741
Logan Group Co., Ltd.	1 000	2 177	2 411	Commerce de détail spécialisé - 0,6 %			
Longfor Group Holdings Ltd.	1 000	6 075	6 476	China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd.	500	8 279	14 828
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd.	4 400	13 253	12 521	Suning.com Co., Ltd.	2 000	3 863	3 377
RiseSun Real Estate Development Co., Ltd.	1 100	2 013	1 715	Total commerce de détail spécialisé		12 142	18 205
Seazen Holdings Co., Ltd.	500	3 604	3 007	Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques - 1,2 %			
Shanghai Lingang Holdings Corp., Ltd.	200	915	827	China Greatwall Technology Group Co., Ltd.	1 000	2 897	2 541
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co., Ltd.	1 080	1 842	1 537	Dawning Information Industry Co., Ltd.	392	2 778	2 898
Shimao Group Holdings Ltd.	500	2 513	2 882	Inspur Electronic Information Industry Co., Ltd.	448	2 365	3 380
Sunac China Holdings Ltd.	1 000	7 747	5 703	Lenovo Group Ltd.	2 000	1 810	1 508
Xinhu Zhongbao Co., Ltd.	2 800	1 970	1 607	Ninestar Corp.	300	1 839	1 901
Youngor Group Co., Ltd.	2 240	2 981	2 570	Shenzhen Kaifa Technology Co., Ltd.	400	1 791	1 681
Zhejiang China Commodities City Group Co., Ltd.	1 600	1 183	1 500	Tsinghua Tongfang Co., Ltd.	1 300	2 239	1 825
Total gestion et promotion immobilières		147 164	129 684	Xiaomi Corp.	8 000	14 352	18 051
Transport routier et ferroviaire - 0,3 %				Total matériel informatique, matériel de stockage et périphériques		30 071	33 785
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co., Ltd.	1 400	1 708	1 679				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Textiles, vêtements et articles de luxe - 0,2 %			
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	400	7 582	6 565
Sociétés commerciales et de distribution - 0,2 %			
China Meheco Co., Ltd.	300	748	817
COSCO Shipping Development Co., Ltd.	1 800	868	638
Orient Group, Inc.	1 400	1 168	1 191
Shanghai Waigaoqiao Free Trade Zone Group Co., Ltd.	200	664	544
Sinochem International Corp.	780	789	760
Xiamen C & D, Inc.	1 000	1 674	1 560
Total sociétés commerciales et de distribution		5 911	5 510
Infrastructures de transport - 0,8 %			
China Merchants Expressway Network & Technology Holdings Co., Ltd.	400	653	518
COSCO Shipping Ports Ltd.	2 000	2 110	1 462
Guangzhou Baiyun International Airport Co., Ltd.	700	2 274	2 054
Jiangsu Expressway Co., Ltd.	2 000	3 555	3 191
Ningbo Zhoushan PortCo., Ltd.	2 200	1 597	1 512
Qinhuangdao Port Co., Ltd.	800	488	387
Shanghai International AirportCo., Ltd.	500	7 330	6 938
Shanghai International Port Group Co., Ltd.	4 100	4 561	3 316
Shenzhen Airport Co., Ltd.	600	1 091	885
Shenzhen International Holdings Ltd.	500	1 425	1 084
TangShan Port Group Co., Ltd.	1 700	823	730
Tianjin Port Co., Ltd.	720	824	613
Total infrastructures de transport		26 731	22 690
Services publics d'aqueduc - 0,2 %			
Beijing Enterprises Water Group Ltd.	4 000	2 607	2 123
Guangdong Investment Ltd.	2 000	5 425	4 674
Total services publics d'aqueduc		8 032	6 797
Services de télécommunications sans fil - 1,0 %			
China Mobile Ltd.	3 000	32 499	27 572
Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)		(1 886)	
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,4 %			
		2 663 529	2 817 019
Contrats de change (annexe 1) - 0,0 %			3
Autres actifs en excédent du passif - 0,6 %			17 593
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %			
			2 834 615 \$

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	596 USD	808 CAD	(3)\$	AA-
7/2/2020	1 213 USD	1 646 CAD	(6)	AA-
7/2/2020	1 483 USD	2 013 CAD	(7)	AA-
7/2/2020	2 150 USD	2 918 CAD	(10)	AA-
7/2/2020	13 658 HKD	2 406 CAD	6	AA-
7/2/2020	25 709 HKD	4 529 CAD	11	AA-
7/2/2020	25 859 HKD	4 556 CAD	12	AA-
			3 \$	

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

CAD	Dollar canadien
HKD	Dollar de Hong Kong
USD	Dollar américain

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	39 897 759 \$	45 117 416 \$
Trésorerie	507 189	778 249
Plus-value latente des contrats de change	9 544	163 241
Créances :		
Dividendes	74 370	106 739
Remboursements au titre de l'impôt étranger	9 493	8 696
Total de l'actif	40 498 355	46 174 341
PASSIF		
Passifs courants		
Créditeurs :		
Distributions	66 000	205 700
Frais de gestion	5 832	21 767
Total du passif	71 832	227 467
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	40 426 523 \$	45 946 874 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	40 426 523	45 946 874
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	1 650 000	1 700 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	24,50 \$	27,03 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	451 098 \$	759 024 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(138 499)	264 322
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(3 762 374)	4 347 229
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(3 449 775)	5 370 575
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(357 667)	(26 413)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(153 697)	493 397
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(511 364)	466 984
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(3 961 139)	5 837 559
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	62 624	(25 279)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	9 238	(10 241)
Total des autres revenus (pertes)	71 862	(35 520)
Total des revenus (pertes)	(3 889 277)	5 802 039
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	179 428	207 663
Retenues d'impôt étranger	24 403	37 353
Honoraires professionnels	—	14 802
Frais d'administration	—	6 994
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	—	5 959
Frais juridiques	—	5 446
Frais d'inscription	—	2 691
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	1 109	1 491
Coûts de transaction (note 2)	578	847
Honoraires de garde	—	696
Frais de transaction	—	447
Autres frais	—	10 286
Total des charges	205 518	294 675
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(1 109)	(48 812)
Charges nettes	204 409	245 863
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 093 686)\$	5 556 176 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	1 632 967	1 843 646
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	(2,51)\$	3,01 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	45 946 874 \$	41 447 567 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 093 686)	5 556 176
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(181 500)	(310 250)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(181 500)	(310 250)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	1 225 215	1 238 990
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(2 470 380)	(2 491 350)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(1 245 165)	(1 252 360)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	40 426 523 \$	45 441 133 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 093 686)\$	5 556 176 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	138 499	(264 322)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	3 762 374	(4 347 229)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	153 697	(493 397)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(9 238)	10 241
Achat de placements ¹	(8 477 203)	(2 933 895)
Produit de la vente de placements ¹	8 536 650	2 870 721
Variation des créances	31 572	(279 919)
Variation des créditeurs	(15 935)	13 516
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	26 730	131 892
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	16 219	3 730
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(2 047)	(9 694)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(321 200)	(240 500)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(307 028)	(246 464)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	9 238	(10 241)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(271 060)\$	(124 813)\$
Trésorerie au début de la période	778 249 \$	452 925 \$
Trésorerie à la fin de la période	507 189 \$	328 112 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	458 267 \$	759 127 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 51,0 %			
Brésil – 0,7 %			
Services de TI – 0,7 %			
Pagseguro Digital Ltd.	5 878	206 811	282 012
Canada – 23,4 %			
Institutions financières – 3,4 %			
Banque Royale du Canada	7 952	735 712	732 459
La Banque Toronto-Dominion	10 779	814 636	653 099
Total institutions financières		1 550 348	1 385 558
Fournitures et services commerciaux – 0,7 %			
Transcontinental, Inc.	19 230	274 427	290 373
Contenants et emballage – 0,6 %			
CCL Industries, Inc.	5 655	303 667	248 141
Services de télécommunications diversifiés – 2,0 %			
BCE Inc.	9 546	554 152	540 495
TELUS Corp.	12 200	273 012	277 794
Total services de télécommunications diversifiés		827 164	818 289
Services publics d'électricité – 1,8 %			
Emera, Inc.	7 067	337 948	377 519
Fortis, Inc.	7 122	313 310	367 709
Total services publics d'électricité		651 258	745 228
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base – 3,3 %			
Alimentation Couche-Tard Inc.	14 221	448 370	605 388
Les Compagnies Loblaw limitée	10 845	605 088	716 963
Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		1 053 458	1 322 351
Assurance – 2,9 %			
Société Financière Manuvie	29 732	690 505	549 150
Financière Sun Life inc.	12 277	592 189	612 500
Total assurance		1 282 694	1 161 650
Services de TI – 1,0 %			
CGI, Inc.	4 531	387 668	387 536
Métaux et exploitation minière – 0,9 %			
Ressources Teck Limitée	24 894	600 646	353 993
Grands magasins – 0,8 %			
Société Canadian Tire Limitée	2 917	426 722	343 156
Pétrole, gaz et autres combustibles – 2,4 %			
Canadian Natural Resources Ltd.	22 495	831 661	529 757
Suncor Énergie Inc.	18 667	745 716	427 288
Total pétrole, gaz et autres combustibles		1 577 377	957 045
Papier et produits forestiers – 1,0 %			
West Fraser Timber Co., Ltd	8 140	503 160	388 441
Transport routier et ferroviaire – 1,7 %			
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	5 683	554 294	682 585
Sociétés commerciales et de distribution – 0,9 %			
Industries Toromont Ltée	5 454	269 971	367 436
Total Canada		10 262 854	9 451 782

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Chine – 0,5 %			
Vente au détail par Internet et par marketing direct – 0,5 %			
Alibaba Group Holding Ltd.	764	180 310	223 725
Allemagne – 0,8 %			
Logiciels – 0,8 %			
SAP SE	1 648	234 081	313 225
Pays-Bas – 0,6 %			
Équipement et fournitures de soins de santé – 0,6 %			
Koninklijke Philips N.V.	4 083	203 818	259 638
Suisse – 0,8 %			
Produits pharmaceutiques – 0,8 %			
Roche Holding AG	5 268	203 863	310 247
Royaume-Uni – 1,2 %			
Aérospatiale et défense – 0,4 %			
BAE Systems PLC	4 673	193 060	152 258
Pétrole, gaz et autres combustibles – 0,3 %			
BP PLC	4 492	208 527	142 213
Produits d'hygiène et de beauté – 0,5 %			
Unilever N.V.	2 784	195 419	201 337
Total du Royaume-Uni		597 006	495 808
États-Unis – 23,0 %			
Aérospatiale et défense – 0,8 %			
Boeing Co. (The)	1 289	220 822	320 765
Institutions financières – 1,6 %			
Bank of America Corp.	10 876	363 323	350 675
Citigroup, Inc.	4 058	355 970	281 517
Total institutions financières		719 293	632 192
Biotechnologie – 2,8 %			
Amgen, Inc.	1 551	371 494	496 635
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	740	343 909	626 534
Total biotechnologie		715 403	1 123 169
Produits chimiques – 1,6 %			
DuPont de Nemours, Inc.	2 995	300 212	216 027
RPM International, Inc.	4 348	301 103	443 068
Total produits chimiques		601 315	659 095
Matériel de communications – 0,9 %			
Cisco Systems, Inc.	5 638	260 199	356 990
Fournisseurs et services de soins de santé – 0,8 %			
Cigna Corp.	1 345	287 995	342 644
Produits ménagers – 1,2 %			
Procter & Gamble Co. (The)	3 016	345 431	489 582
Assurance – 0,7 %			
Aflac, Inc.	5 427	275 005	265 458
Médias et services interactifs – 2,7 %			
Alphabet, Inc.	270	345 327	518 161
Facebook, Inc.	1 823	400 346	561 977
Total médias et services interactifs		745 673	1 080 138
Services de TI – 0,4 %			
Visa, Inc.	635	149 332	166 527

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Grands magasins – 0,8 %			
Target Corp.	2 021	183 563	329 053
Produits pharmaceutiques – 1,8 %			
Johnson & Johnson	2 653	449 155	506 509
Pfizer, Inc.	4 904	219 013	217 706
Total produits pharmaceutiques		668 168	724 215
Matériel et produits semi-conducteurs – 2,9 %			
Intel Corp.	4 296	219 382	348 943
NVIDIA Corp.	1 565	326 998	807 174
Total matériel et produits semi-conducteurs		546 380	1 156 117
Logiciels – 1,9 %			
Microsoft Corp.	2 851	298 411	787 689
Commerce de détail spécialisé – 0,9 %			
Home Depot, Inc. (The)	1 094	234 475	372 061
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques – 1,2 %			
Apple, Inc.	983	203 970	486 833
Total des États-Unis		6 455 435	9 292 528
TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES		18 344 178	20 628 965
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE – 47,7 %			
Canada – 25,3 %			
FNB Indice de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI – parts couvertes			
	243 225	5 773 228	6 185 844
FINB de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation CI WisdomTree – parts couvertes			
	66 331	1 619 410	1 323 303
iShares S&P/TSX Capped REIT Index ETF	13 122	214 262	195 912
iShares S&P/TSX Completion Index ETF	108 218	2 679 975	2 510 658
Total Canada		10 286 875	10 215 717
États-Unis – 22,4 %			
iShares Cohen & Steers REIT ETF	3 729	477 054	510 704
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF			
	24 818	1 580 302	1 603 783
iShares Micro-Cap ETF	14 988	1 690 229	1 775 744
iShares MSCI EAFE Small-Cap ETF	31 188	2 559 570	2 270 315
iShares Russell 2000 Growth ETF	5 316	1 173 363	1 492 981
iShares Russell 2000 Value ETF	8 335	1 231 405	1 102 818
SPDR Dow Jones International Real Estate ETF			
	7 584	377 904	296 732
Total des États-Unis		9 089 827	9 053 077
TOTAL DES FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE		19 376 702	19 268 794
Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)			
		(646)	
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES – 98,7 %			
		37 720 234	39 897 759
Contrats de change (annexe 1) – 0,0 %			
			9 544
Autres actifs en excédent du passif – 1,3 %			
			519 220
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			
			40 426 523 \$

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/16/2020	9 053 437 USD	12 300 000 CAD	9 544 \$	A

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

CAD	Dollar canadien
USD	Dollar américain

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	83 038 869 \$	89 626 879 \$
Trésorerie	760 702	2 769 455
Créances :		
Dividendes et intérêts	350 743	344 716
Total de l'actif	84 150 314	92 741 050
PASSIF		
Passifs courants		
Créditeurs :		
Distributions	160 000	273 600
Frais de gestion	8 758	29 823
Total du passif	168 758	303 423
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	83 981 556 \$	92 437 627 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	83 981 556	92 437 627
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	1 600 000	1 800 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	52,49 \$	51,35 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	893 197 \$	1 290 728 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	485 030	645 899
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	1 240 158	2 058 158
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	2 618 385	3 994 785
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	395 189	350 107
Total des autres produits (pertes)	395 189	350 107
Total des revenus (pertes)	3 013 574	4 344 892
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	259 043	297 715
Honoraires professionnels	—	14 802
Frais d'administration	—	8 882
Frais de communication de l'information aux porteurs de titres	—	5 959
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	2 479	3 298
Frais juridiques	—	5 446
Coûts de transaction (note 2)	802	2 005
Frais d'inscription	—	2 691
Honoraires de garde	—	2 441
Frais de transaction	—	150
Autres frais	—	8 480
Total des charges	262 324	351 869
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(2 479)	(52 149)
Charges nettes	259 845	299 720
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	2 753 729 \$	4 045 172 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	1 708 791	1 965 193
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	1,61 \$	2,06 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	92 437 627 \$	95 731 798 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	2 753 729	4 045 172
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(1 020 000)	(1 204 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 020 000)	(1 204 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	—	5 043 980
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(10 189 800)	(10 364 640)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(10 189 800)	(5 320 660)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	83 981 556 \$	93 251 910 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	2 753 729 \$	4 045 172 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(485 030)	(645 899)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(1 240 158)	(2 058 158)
Achat de placements ¹	(73 290 919)	(8 096 085)
Produit de la vente de placements ¹	71 415 544	8 820 413
Variation des créances	(6 027)	63 087
Variation des créditeurs	(21 065)	(8 998)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(873 926)	2 119 532
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	–	37 734
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(1 227)	(10 570)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(1 133 600)	(1 200 000)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(1 134 827)	(1 172 836)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(2 008 753)\$	946 696 \$
Trésorerie au début de la période	2 769 455 \$	1 218 761 \$
Trésorerie à la fin de la période	760 702 \$	2 165 457 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	952 439 \$	1 392 351 \$
Intérêts reçus	329 920	311 571

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS - 26,8 %				
Alimentation Couche-Tard Inc.				
4,21 %, 8/21/20	BBB	153 000	156 482	153 702
3,06 %, 7/26/24	BBB	670 000	651 036	705 902
3,60 %, 6/2/25	BBB	1 250 000	1 260 500	1 352 131
AltaGas Ltd.				
3,98 %, 10/4/27	BBB-	1 950 000	2 070 600	2 160 239
Banque de Montréal				
3,34 %, 12/8/25	BBB+	495 000	497 389	499 811
3,32 %, 6/1/26	BBB+	305 000	306 316	310 751
La Banque de Nouvelle-Écosse				
2,87 %, 6/4/21	NR	346 000	345 462	353 285
Bell Canada, Inc.				
3,35 %, 3/22/23	BBB+	846 000	845 595	889 112
4,70 %, 9/11/23	BBB+	786 000	828 971	861 763
Brookfield Asset Management, Inc.				
4,54 %, 3/31/23	A-	2 836 000	2 980 819	3 042 135
Canadian Natural Resources Ltd.				
3,31 %, 2/11/22	BBB	1 000 000	1 025 000	1 023 915
Capital Power Corp.				
4,28 %, 9/18/24	BBB-	1 000 000	1 053 400	1 061 565
CCL Industries, Inc.				
3,86 %, 4/13/28	BBB	865 000	907 887	952 789
Enbridge, Inc.				
3,19 %, 12/5/22	BBB+	99 000	98 887	102 857
3,94 %, 6/30/23	BBB+	35 000	35 833	37 191
Société de financement GE Capital Canada				
4,60 %, 1/26/22	BBB+	714 000	730 052	738 483
TELUS Corp.				
2,35 %, 3/28/22	BBB+	1 186 000	1 155 151	1 211 155
3,35 %, 3/15/23	BBB+	256 000	255 748	268 851
Industries Toromont Ltée				
3,84 %, 10/27/27	NR	1 001 000	1 007 851	1 096 911
TransCanada PipeLines Ltd.				
3,65 %, 11/15/21	BBB+	1 643 000	1 673 825	1 697 235
Crédit Volkswagen Canada Inc.				
2,65 %, 6/27/22	BBB+	2 000 000	2 026 520	2 034 770
Wells Fargo Canada Corp.				
3,04 %, 1/29/21	A-	1 366 000	1 368 318	1 384 202
3,46 %, 1/24/23	A-	506 000	511 144	534 893
TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS			21 792 786	22 473 648
OBLIGATIONS PROVINCIALES - 1,0 %				
Province d'Alberta				
2,90 %, 9/20/29	A+	131 000	127 671	146 769
Province d'Ontario				
4,00 %, 6/2/21	A+	413 000	428 403	426 935

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Province de Québec				
4,50 %, 12/1/20	AA-	242 000	252 450	246 234
TOTAL DES OBLIGATIONS PROVINCIALES			808 524	819 938
OBLIGATIONS MUNICIPALES - 0,2 %				
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto				
3,04 %, 9/21/22	A+	205 000	207 702	212 610
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES - 1,5 %				
Belgique - 0,2 %				
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.				
3,38 %, 1/25/23	BBB+	136 000	135 520	142 514
2,60 %, 5/15/24	BBB+	40 000	38 303	41 323
Total de la Belgique			173 823	183 837
États-Unis - 1,3 %				
PepsiCo, Inc.				
2,15 %, 5/6/24	A+	1 000 000	1 015 380	1 042 720
TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES			1 189 203	1 226 557
Actions				
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE - 69,4 %				
Canada - 69,4 %				
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI				
		72 120	3 424 282	3 811 542
Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI				
		1 088 170	52 591 779	54 494 574
TOTAL DES FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			56 016 061	58 306 116
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 98,9 %			80 014 276	83 038 869
Autres actifs en excédent du passif - 1,1 %				942 687
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %				83 981 556 \$

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	244 301 496 \$	230 726 484 \$
Trésorerie	405 417	917 695
Créances :		
Titres de placement vendus	743 810	—
Dividendes	1 251 610	788 840
Total de l'actif	246 702 333	232 433 019
PASSIF		
Passifs courants		
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	—	551 231
Distributions	2 268 000	623 700
Frais de gestion	24 596	26 271
Total du passif	2 292 596	1 201 202
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	244 409 737 \$	231 231 817 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	244 409 737	231 231 817
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	9 450 000	8 100 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	25,86 \$	28,55 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	4 618 757 \$	2 351 480 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(20 368 278)	2 098 740
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 560 172)	12 609 510
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(18 309 693)	17 059 730
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	1 315	1 094
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	1 315	1 094
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(18 308 378)	17 060 824
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	135	–
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(3 145)	(1 406)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	798	(3 127)
Total des autres revenus (pertes)	(2 212)	(4 533)
Total des revenus (pertes)	(18 310 590)	17 056 291
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	271 324	170 075
Coûts de transaction (note 2)	28 276	56 360
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	6 519	4 879
Total des charges	306 119	231 314
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(6 519)	(4 879)
Charges nettes	299 600	226 435
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(18 610 190)\$	16 829 856 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	8 976 648	5 430 110
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	(2,07)\$	3,10 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	231 231 817 \$	90 051 999 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(18 610 190)	16 829 856
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(3 648 000)	(2 336 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 648 000)	(2 336 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	46 060 005	81 709 515
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(10 623 895)	(1 228 960)
Opérations sur parts rachetables, montant net	35 436 110	80 480 555
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	244 409 737 \$	185 026 010 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(18 610 190)\$	16 829 856 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	20 368 278	(2 098 740)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 560 172	(12 609 510)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(798)	3 127
Achat de placements ¹	(117 547 949)	(86 347 208)
Produit de la vente de placements ¹	116 095 681	85 504 060
Variation des créances	(1 206 580)	(1 795 215)
Variation des crédettes	(552 906)	1 398 139
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	1 105 708	884 509
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	521 304	671 339
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(136 388)	(10 304)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(2 003 700)	(1 360 400)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(1 618 784)	(699 365)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	798	(3 127)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(512 278)\$	182 017 \$
Trésorerie au début de la période	917 695 \$	176 789 \$
Trésorerie à la fin de la période	405 417 \$	358 806 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	4 155 987 \$	2 301 148 \$
Intérêts reçus	135	—

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 100,0 %				Métaux et exploitation minière – 10,3 %			
Canada – 100,0 %				Société aurifère Barrick			
Composantes d'automobile – 5,4 %				352 478 7 886 009 12 876 021			
Linamar Corp.	17 574	822 441	644 966	Kirkland Lake Gold Ltd.	46 295	2 279 976	2 587 891
Magna International, Inc.	200 506	12 880 282	12 122 592	Lundin Mining Corp.	316 412	2 054 835	2 303 479
Martinrea International, Inc.	29 800	337 634	306 344	Pan American Silver Corp.	27 609	776 899	1 138 319
Total composantes d'automobile		14 040 357	13 073 902	Wheaton Precious Metals Corp.	104 800	5 434 928	6 257 608
Marchés financiers – 5,5 %				Total métaux et exploitation minière		18 432 647	25 163 318
CI Financial Corp.	204 171	4 047 249	3 526 033	Grands magasins – 2,4 %			
Société financière IGM Inc.	298 954	9 496 921	9 862 493	Société Canadian Tire Limitée			
Total marchés financiers		13 544 170	13 388 526	48 914	6 797 529	5 754 243	
Fournitures et services commerciaux – 3,4 %				Pétrole, gaz et autres combustibles – 8,2 %			
Boyd Group Services, Inc.	1 379	260 011	278 655	Keyera Corp.			
Les Encans Ritchies Bros, inc	45 337	2 204 188	2 505 776	414 787	7 372 668	8 573 647	
Waste Connections, Inc.	44 017	5 194 876	5 598 522	Corporation TC Énergie	197 100	11 605 248	11 431 800
Total fournitures et services commerciaux		7 659 075	8 382 953	Total pétrole, gaz et autres combustibles		18 977 916	20 005 447
Construction et génie – 0,7 %				Papier et produits forestiers – 0,4 %			
Aecon Group, Inc.	52 700	798 405	777 852	Stella-Jones, Inc.			
Badger Daylighting Ltd.	15 100	419 478	448 772	25 802	1 042 518	880 880	
Groupe SNC-Lavalin inc.	26 100	586 467	597 951	Services professionnels – 5,8 %			
Total construction et génie		1 804 350	1 824 575	Stantec, Inc.			
Crédit à la consommation – 0,2 %				37 325 1 407 297 1 564 291			
goeasy Ltd.	7 800	435 084	426 504	Thomson Reuters Corp.	137 486	12 333 234	12 681 708
Contenants et emballage – 1,6 %				Total services professionnels			
CCL Industries, Inc.	62 461	3 522 811	2 740 788		13 740 531	14 245 999	
Intertape Polymer Group, Inc.	84 000	991 200	1 006 320	Gestion et promotion immobilières – 0,1 %			
Winpak Ltd.	4 515	201 363	187 779	DREAM Unlimited Corp.			
Total contenants et emballage		4 715 374	3 934 887	24 747	265 770	221 733	
Services de télécommunications diversifiés – 9,6 %				Transport routier et ferroviaire – 10,3 %			
BCE Inc.	213 893	13 362 359	12 110 622	Compagnie des chemins de fer			
TELUS Corp.	501 739	11 852 745	11 424 597	nationaux du Canada			
Total services de télécommunications diversifiés		25 215 104	23 535 219	104 650	11 901 015	12 569 511	
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base – 5,5 %				Chemin de fer Canadien Pacifique			
Alimentation Couche-Tard Inc.	161 459	6 309 540	6 873 310	Limitée	30 183	8 800 676	10 422 794
Metro, Inc.	88 470	4 594 706	4 954 320	TFI International, Inc.	44 840	1 809 333	2 160 840
North West Co., Inc. (The)	56 500	1 576 915	1 676 920	Total transport routier et ferroviaire		22 511 024	25 153 145
Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		12 481 161	13 504 550	Logiciels – 1,4 %			
Produits alimentaires – 2,6 %				Constellation Software, Inc.			
Saputo inc.	196 134	6 492 388	6 348 858	1 776	2 094 948	2 722 413	
Hôtellerie, restauration et loisirs – 4,8 %				Enghouse Systems Ltd.	8 654	347 879	627 415
Restaurant Brands International, Inc.	160 204	13 168 465	11 837 474	Total logiciels		2 442 827	3 349 828
Assurance – 10,7 %				Institutions d'épargne et de financement hypothécaire – 1,5 %			
Great-West Lifeco, Inc.	494 900	11 778 620	11 778 620	Genworth MI Canada, Inc.			
iA Financial Corp., Inc.	94 329	4 493 984	4 288 196	110 764	5 303 472	3 678 472	
Intact Corporation financière	78 276	9 302 577	10 114 042	Sociétés commerciales et de distribution – 2,0 %			
Total assurance		25 575 181	26 180 858	Finning International, Inc.			
Machinerie – 0,2 %				150 873 3 512 919 2 792 659			
Savaria Corp.	37 200	472 440	463 512	Industries Toromont Ltée	30 332	1 929 307	2 043 467
Médias – 2,2 %				Total sociétés commerciales et de distribution			
Cogeco Communications, Inc.	24 470	2 738 703	2 393 411		5 442 226	4 836 126	
Québecor inc.	105 600	3 232 113	3 080 352	Infrastructures de transport – 0,4 %			
Total médias		5 970 816	5 473 763	Westshore Terminals			
				Investment Corp.			
				56 600	877 300	945 786	
				Services de télécommunications sans fil – 4,8 %			
				Rogers Communications Inc.			
				214 316	14 055 730	11 690 938	
				Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)			
				(21 175)			
				TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES – 100,0 %			
						241 442 280	244 301 496
				Autres actifs en excédent du passif – 0,0 %			
				108 241			
				ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			
				244 409 737 \$			

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	32 980 887 \$	35 396 877 \$
Trésorerie	152 196	120 638
Plus-value latente des contrats de change	–	1 823
Créances :		
Titres de placement vendus	–	378 447
Dividendes	218 356	62 590
Remboursements au titre de l'impôt étranger	44	170
Total de l'actif	33 351 483	35 960 545
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	–	11
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	6 544	–
Impôt étranger sur les gains en capital	–	163
Distributions	161 000	473 200
Frais de gestion	5 940	11 568
Total du passif	173 484	484 942
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	33 177 999 \$	35 475 603 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	33 177 999	35 475 603
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	1 400 000	1 300 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	23,70 \$	27,29 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	699 457 \$	443 851 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(528 773)	124 279
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(4 644 060)	136 793
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(4 473 376)	704 923
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	6 555	(56 866)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(1 812)	(9 286)
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	4 743	(66 152)
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(4 468 633)	638 771
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	(1 157)	–
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(13 138)	21 437
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	2 872	14 395
Total des autres revenus (pertes)	(11 423)	35 832
Total des revenus (pertes)	(4 480 056)	674 603
CHARGES		
Retenues d'impôt étranger	78 746	49 692
Frais de gestion (note 5)	67 501	33 989
Coûts de transaction (note 2)	4 523	35 566
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	944	530
Impôt étranger sur les gains en capital	(12)	–
Total des charges	151 702	119 777
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(944)	(530)
Charges nettes	150 758	119 247
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 630 814)\$	555 356 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	1 385 165	623 204
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	(3,34)\$	0,89 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	35 475 603 \$	5 031 187 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 630 814)	555 356
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(406 000)	(404 380)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(406 000)	(404 380)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	2 739 210	28 864 565
Réinvestissement des distributions	–	109 880
Opérations sur parts rachetables, montant net	2 739 210	28 974 445
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	33 177 999 \$	34 156 608 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 630 814)\$	555 356 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	528 773	(124 279)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	4 644 060	(136 793)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	1 812	9 286
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(2 872)	(14 395)
Achat de placements ¹	(2 764 321)	(30 399 584)
Produit de la vente de placements ¹	1 215 346	309 677
Variation des créances	222 807	2 333 860
Variation des créditeurs	916	6 296 528
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(784 293)	(21 170 344)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	1 531 179	28 864 565
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(718 200)	(115 500)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	812 979	28 749 065
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	2 872	14 395
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	31 558 \$	7 593 116 \$
Trésorerie au début de la période	120 638 \$	7 505 \$
Trésorerie à la fin de la période	152 196 \$	7 600 621 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	465 071 \$	211 619 \$
Intérêts reçus (versés)	(1 157)	—

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %							
Brésil – 3,2 %							
Ambev S.A.	15 103	93 277	52 973	Empresas CMPC S.A.	6 676	25 167	18 083
Atacadao S.A.	2 693	17 047	13 193	Empresas COPEC S.A.	2 511	36 886	22 964
B3 S.A. – Brasil Bolsa Balcao	6 284	75 940	85 872	Enel Americas S.A.	236 835	57 860	48 743
Banco Bradesco S.A.	4 865	50 819	22 880	Enel Chile S.A.	260 607	34 221	26 558
Banco do Brasil S.A.	8 417	140 129	67 124	Engie Energia Chile S.A.	9 244	21 775	16 862
Banco Santander Brasil S.A.	1 846	28 973	12 830	Falabella S.A.	3 530	30 448	15 233
BB Seguridade Participacoes S.A.	4 103	41 420	27 754	Inversiones Aguas Metropolitanas S.A.	9 729	18 563	11 382
BR Malls Participacoes S.A.	9 585	46 940	23 966	Ripley Corp. S.A.	19 748	19 009	8 751
CCR S.A.	9 067	44 458	32 612	Total du Chili		460 956	310 445
Centrais Elétricas Brasileiras S.A.	1 300	14 789	9 997	Chine – 27,4 %			
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	1 715	26 594	24 546	Agile Group Holdings Ltd.	22 000	39 058	35 259
Cia de Saneamento do Parana	3 162	28 906	24 715	Agricultural Bank of China Ltd.	281 200	173 066	160 244
Cia Hering	1 812	16 197	6 436	Angang Steel Co., Ltd.	30 000	13 512	9 964
Cia Siderurgica Nacional S.A.	9 585	39 916	25 393	Anhui Conch Cement Co., Ltd.	14 800	115 013	140 629
Cielo S.A.	25 884	78 840	29 663	ANTA Sports Products Ltd.	3 000	36 565	36 060
Cogna Educacao	6 947	26 893	11 390	Asia Cement China Holdings Corp.	8 000	12 913	10 684
Cosan S.A.	895	14 864	15 745	BAIC Motor Corp., Ltd.	18 500	15 186	10 891
Cyrela Brazil Realty S.A. Empreendimentos e Participacoes	3 770	31 687	21 368	Bank of Beijing Co., Ltd.	21 600	24 505	20 378
Duralex S.A.	4 954	21 158	15 803	Bank of China Ltd.	687 000	405 314	353 447
EDP – Energias do Brasil S.A.	3 379	21 338	14 601	Bank of Communications Co., Ltd.	213 400	228 232	184 632
Energisa S.A.	1 385	20 911	16 834	Bank of Jiangsu Co., Ltd.	9 900	12 857	10 807
Engie Brasil Energia S.A.	1 762	26 551	18 396	Bank of Nanjing Co., Ltd.	10 600	17 366	14 959
Equatorial Energia S.A.	3 156	19 271	18 178	Bank of Shanghai Co., Ltd.	8 200	14 411	13 104
Fleury S.A.	3 485	26 620	21 257	Baoshan Iron & Steel Co., Ltd.	32 499	41 280	28 533
Hypera S.A.	3 227	33 750	26 655	Beijing Capital International Airport Co., Ltd.	16 000	20 752	13 637
IRB Brasil Resseguros S.A.	2 177	21 168	5 940	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	4 000	24 459	18 206
Itau Unibanco Holding S.A.	4 352	44 032	25 909	Beijing Enterprises Water Group Ltd.	64 000	48 543	33 965
Itausa S.A.	12 278	52 064	33 380	Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	10 000	14 244	12 196
Klabin S.A.	10 809	55 525	54 509	CGN Power Co., Ltd.	87 000	30 865	24 462
Localiza Rent a Car S.A.	1 454	18 056	14 755	China Aoyuan Group Ltd.	10 000	14 448	16 466
Lojas Renner S.A.	2 532	37 802	26 253	China BlueChemical Ltd.	54 000	19 325	10 913
Odontoprev S.A.	3 823	20 717	13 494	China Cinda Asset Management Co., Ltd.	87 000	28 310	23 239
Petrobras Distribuidora S.A.	7 523	64 977	40 214	China CITIC Bank Corp., Ltd.	93 000	75 075	55 239
Porto Seguro S.A.	782	14 250	9 780	China Communications Construction Co., Ltd.	41 000	51 676	31 486
Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros S.A.	2 666	18 193	19 178	China Communications Services Corp.	20 000	16 280	16 941
Raia Drogasil S.A.	531	17 536	14 570	China Conch Venture Holdings Ltd.	7 500	35 045	43 098
Smiles Fidelidade S.A.	1 705	21 877	6 221	China Construction Bank Corp.	733 800	834 987	809 976
Sul America S.A.	847	10 215	9 469	China Everbright Bank Co., Ltd.	29 100	22 362	20 058
TIM Participacoes S.A.	5 862	22 775	20 648	China Everbright International Ltd.	31 370	38 648	22 547
Transmissora Alianca de Energia Elétrica S.A.	6 141	55 874	42 804	China Fortune Land Development Co., Ltd.	2 800	14 460	12 324
Ultrapar Participacoes S.A.	4 871	40 659	22 208	China Galaxy Securities Co., Ltd.	18 500	13 834	13 622
WEG S.A.	2 690	19 432	33 770	China Gas Holdings Ltd.	6 800	31 326	28 560
YDUQS Participacoes S.A.	3 029	35 437	25 283	China Hongqiao Group Ltd.	18 500	16 269	11 184
Total du Brésil		1 557 877	1 058 566	China International Marine Containers Group Co., Ltd.	11 000	13 297	12 178
Chili – 0,9 %				China Jinmao Holdings Group Ltd.	36 000	27 412	34 479
AES Gener S.A.	78 889	27 217	15 451	China Lesso Group Holdings Ltd.	12 000	12 378	21 256
Aguas Andinas S.A.	37 104	27 534	17 133	China Life Insurance Co., Ltd.	10 000	32 825	27 414
Banco de Chile	240 236	42 468	28 908	China Lilang Ltd.	14 000	17 428	10 235
Banco de Credito e Inversiones S.A.	222	19 163	10 281	China Longyuan Power Group Corp., Ltd.	23 000	19 291	17 582
Banco Santander Chile	323 965	29 419	18 067	China Medical System Holdings Ltd.	15 000	19 472	24 066
Cia Cervecerias Unidas S.A.	1 976	31 721	19 399	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	4 000	20 871	20 807
Colbun S.A.	150 074	39 505	32 630	China Merchants Bank Co., Ltd.	25 500	158 052	162 369
				China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co., Ltd.	4 400	15 875	13 927

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
China Minsheng Banking Corp., Ltd.	54 500	51 105	50 952	Great Wall Motor Co., Ltd.	43 000	39 796	36 573
China Mobile Ltd.	50 500	655 253	464 134	Guangdong Investment Ltd.	22 000	57 208	51 419
China Molybdenum Co., Ltd.	54 000	25 967	24 008	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	28 000	40 203	27 506
China National Building Material Co., Ltd.	30 000	34 722	43 494	Guangzhou R&F Properties Co., Ltd.	16 000	38 759	25 362
China Oriental Group Co., Ltd.	34 000	24 688	12 607	Guotai Junan Securities Co., Ltd.	6 100	19 711	20 271
China Overseas Land & Investment Ltd.	20 000	95 608	82 418	Haier Electronics Group Co., Ltd.	6 000	21 089	24 725
China Pacific Insurance Group Co., Ltd.	16 100	83 003	63 232	Haier Smart Home Co., Ltd.	5 300	16 939	18 062
China Petroleum & Chemical Corp.	520 400	520 058	304 719	Haitian International Holdings Ltd.	5 000	14 092	13 830
China Power International Development Ltd.	79 666	24 949	19 880	Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd.	4 100	22 506	36 383
China Railway Construction Corp., Ltd.	17 000	28 446	18 193	Hengan International Group Co., Ltd.	7 500	76 400	80 002
China Railway Group Ltd.	32 000	29 968	22 381	Huaneng Power International, Inc.	26 000	20 852	13 296
China Railway Signal & Communication Corp., Ltd.	25 000	21 575	14 630	Huatai Securities Co., Ltd.	7 800	26 461	28 233
China Resources Beer Holdings Co., Ltd.	2 000	14 093	15 183	Huayu Automotive Systems Co., Ltd.	4 100	16 753	16 411
China Resources Cement Holdings Ltd.	34 000	47 076	56 702	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	560 400	553 459	467 427
China Resources Gas Group Ltd.	4 000	29 193	26 535	Industrial Bank Co., Ltd.	17 600	59 408	53 472
China Resources Land Ltd.	12 000	65 516	61 893	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	7 100	39 108	42 554
China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	14 000	17 626	10 997	Jiangsu Expressway Co., Ltd.	14 000	23 577	22 339
China Resources Power Holdings Co., Ltd.	18 000	40 348	28 816	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	900	18 831	18 219
China SCE Group Holdings Ltd.	28 000	16 771	16 533	Jiangxi Copper Co., Ltd.	9 000	13 524	12 352
China Shenhua Energy Co., Ltd.	51 700	159 858	114 368	Kingboard Holdings Ltd.	8 500	34 635	30 024
China South City Holdings Ltd.	104 000	16 253	14 438	Kunlun Energy Co., Ltd.	32 000	41 413	28 230
China State Construction Engineering Corp., Ltd.	29 400	33 640	27 000	Kweichow Moutai Co., Ltd.	300	65 465	84 496
China State Construction International Holdings Ltd.	18 000	23 408	14 298	KWG Group Holdings Ltd.	18 000	25 936	41 184
China Telecom Corp., Ltd.	100 000	67 246	38 134	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd.	24 000	21 269	17 545
China Unicom Hong Kong Ltd.	24 000	33 014	17 672	Lenovo Group Ltd.	70 000	70 347	52 772
China Vanke Co., Ltd.	15 900	82 644	73 839	Logan Group Co., Ltd.	12 000	24 329	28 932
China Yangtze Power Co., Ltd.	17 600	57 960	64 180	Longfor Group Holdings Ltd.	8 000	38 651	51 806
Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd.	23 000	16 881	12 328	Lonking Holdings Ltd.	54 000	21 689	22 300
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	38 000	33 366	40 334	Luye Pharma Group Ltd.	21 000	20 393	17 492
CITIC Ltd.	23 000	43 763	29 424	Luzhou Laojiao Co., Ltd.	900	13 968	15 789
CITIC Securities Co., Ltd.	13 800	45 875	46 500	Maanshan Iron & Steel Co., Ltd.	46 000	25 558	16 814
CITIC Telecom International Holdings Ltd.	39 000	18 956	16 860	Midea Group Co., Ltd.	6 100	60 188	70 221
CNOOC Ltd.	201 000	432 667	304 476	Minth Group Ltd.	4 000	17 717	15 500
COSCO Shipping Ports Ltd.	22 000	23 137	16 083	Nanjing Iron & Steel Co., Ltd.	27 800	16 684	17 288
Country Garden Holdings Co., Ltd.	56 000	106 084	93 686	New China Life Insurance Co., Ltd.	4 500	25 665	20 521
CRRC Corp., Ltd.	41 000	54 801	30 529	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	34 000	42 259	41 884
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	16 800	47 445	43 222	PetroChina Co., Ltd.	217 100	174 470	107 672
Dali Foods Group Co., Ltd.	14 500	13 323	11 976	PICC Property & Casualty Co., Ltd.	31 000	44 278	34 811
Daqin Railway Co., Ltd.	16 400	26 182	22 229	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	21 700	311 712	296 392
Dongfeng Motor Group Co., Ltd.	28 000	33 894	22 782	Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd.	8 300	20 901	23 619
Dongyue Group Ltd.	32 000	23 024	17 714	Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	56 000	44 523	43 792
ENN Energy Holdings Ltd.	2 500	32 918	38 309	Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	16 000	10 157	12 203
Far East Horizon Ltd.	19 000	22 984	21 970	Qingdao Port International Co., Ltd.	22 000	17 722	15 928
Focus Media Information Technology Co., Ltd.	16 500	17 238	17 695	SAIC Motor Corp., Ltd.	9 300	45 684	30 422
Fosun International Ltd.	28 000	49 906	48 516	Sansteel Minguang Co., Ltd. Fujian	11 300	16 919	14 490
Fufeng Group Ltd.	27 000	16 668	11 720	Sany Heavy Industry Co., Ltd.	7 400	17 871	26 728
Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	11 700	49 468	41 748	Seazen Group Ltd.	14 000	18 514	16 557
Geely Automobile Holdings Ltd.	28 000	63 272	60 030	Shaanxi Coal Industry Co., Ltd.	7 500	12 591	10 411
Gemdale Corp.	8 500	20 066	22 420	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co., Ltd.	12 000	18 196	36 355
Genertec Universal Medical Group Co., Ltd.	26 500	23 837	21 794	Shanghai International Port Group Co., Ltd.	12 000	14 961	9 704
				Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd.	10 500	27 462	24 024

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd.	14 500	33 952	29 537	Kingboard Laminates Holdings Ltd.	15 000	20 025	20 534
Shenzhen Expressway Co., Ltd.	8 000	14 013	11 022	Stella International Holdings Ltd.	10 500	20 232	14 669
Shenzhen International Holdings Ltd.	7 477	19 239	16 214	Total de Hong Kong		107 411	102 206
Shenzhen Investment Ltd.	32 000	15 555	13 777	Hongrie - 0,2 %			
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd.	10 900	14 365	12 718	MOL Hungarian Oil & Gas PLC	3 637	50 984	29 165
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	3 200	57 201	52 523	Richter Gedeon Nyrt	968	24 592	27 239
Shimao Group Holdings Ltd.	8 500	33 532	48 994	Total de la Hongrie		75 576	56 404
Shougang Fushan Resources Group Ltd.	94 000	27 009	26 760	Inde - 5,2 %			
Shui On Land Ltd.	67 500	20 472	15 420	Ashok Leyland Ltd.	15 504	23 591	13 131
Sino Biopharmaceutical Ltd.	9 500	13 393	24 374	Asian Paints Ltd.	792	22 344	24 108
Sino-Ocean Group Holding Ltd.	43 500	24 192	14 218	Bajaj Auto Ltd.	509	27 355	25 948
Sinopec Engineering Group Co., Ltd.	20 500	19 675	11 888	Bharat Petroleum Corp., Ltd.	6 885	50 189	46 450
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd.	86 000	43 614	28 110	Bharti Infratel Ltd.	14 293	74 997	57 109
Sinopharm Group Co., Ltd.	8 000	40 390	27 892	Coal India Ltd.	23 524	101 952	56 374
Sinotrans Ltd.	44 000	18 516	12 140	GAIL India Ltd.	11 063	31 926	20 385
Sinotruk Hong Kong Ltd.	9 000	21 911	31 711	Godrej Industries Ltd.	2 438	18 141	18 361
SITC International Holdings Co., Ltd.	17 000	21 767	24 706	Grasim Industries Ltd.	1 968	27 803	22 000
Sun Art Retail Group Ltd.	12 500	18 422	29 084	HCL Technologies Ltd.	2 665	26 585	26 770
Sunac China Holdings Ltd.	9 000	53 448	51 322	Hero MotoCorp., Ltd.	900	44 500	41 350
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	1 200	18 722	26 149	Hindustan Petroleum Corp., Ltd.	7 745	38 840	30 282
TCL Technology Group Corp.	22 800	15 514	27 216	Hindustan Unilever Ltd.	1 868	63 090	73 458
Tencent Holdings Ltd.	3 800	227 874	332 955	Housing Development Finance Corp., Ltd.	2 760	107 710	87 359
Tianneng Power International Ltd.	18 000	15 839	41 754	Indiabulls Housing Finance Ltd.	8 130	33 324	30 380
Times China Holdings Ltd.	8 000	17 339	20 132	Indian Oil Corp., Ltd.	33 666	92 741	51 833
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	12 000	22 009	25 348	IndusInd Bank Ltd.	905	21 573	7 751
TravelSky Technology Ltd.	5 000	14 567	11 985	Infosys Ltd.	18 110	251 349	239 790
Uni-President China Holdings Ltd.	11 000	15 428	14 923	ITC Ltd.	17 692	90 308	62 121
Wanhua Chemical Group Co., Ltd.	3 400	27 599	32 724	JSW Steel Ltd.	6 722	30 205	22 960
WantWant China Holdings Ltd.	50 000	52 852	51 402	Larsen & Toubro Ltd.	1 634	41 988	27 815
Weichai Power Co., Ltd.	27 000	55 823	69 555	Mahindra & Mahindra Ltd.	3 342	38 719	30 788
Wens Foodstuffs Group Co., Ltd.	3 240	20 758	13 599	Marico Ltd.	3 541	24 007	22 478
WH Group Ltd.	55 000	69 574	64 177	Maruti Suzuki India Ltd.	389	50 190	40 968
Wuliangye Yibin Co., Ltd.	1 400	26 029	46 125	Mphasis Ltd.	1 248	21 384	19 783
Xiamen C & D, Inc.	8 100	13 155	12 632	National Aluminium Co., Ltd.	28 661	26 128	16 467
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd.	7 600	17 220	14 589	Nestle India Ltd.	103	22 882	31 910
Xinyi Glass Holdings Ltd.	34 000	51 620	56 761	NHPC Ltd.	49 346	22 537	17 803
Xinyi Solar Holdings Ltd.	20 215	13 643	26 075	NMDC Ltd.	11 657	23 689	17 064
XTEP International Holdings Ltd.	19 500	15 543	8 841	Oil India Ltd.	7 320	22 585	12 366
Yanzhou Coal Mining Co., Ltd.	28 000	33 931	28 490	Petronet LNG Ltd.	8 534	39 659	39 725
Yuexiu Property Co., Ltd.	66 000	18 631	16 006	Piramal Enterprises Ltd.	789	26 672	19 410
Yuexiu Transport Infrastructure Ltd.	18 000	21 708	17 113	Power Grid Corp. of India Ltd.	15 133	55 680	47 731
Yuzhou Properties Co., Ltd.	32 000	20 293	18 838	REC Ltd.	10 904	26 516	21 263
Zhejiang Expressway Co., Ltd.	22 000	24 656	21 186	Reliance Industries Ltd.	3 333	81 483	102 456
Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd.	3 200	21 837	11 078	Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	3 185	24 518	27 173
Zijin Mining Group Co., Ltd.	52 000	27 545	32 988	Tata Consultancy Services Ltd.	3 139	124 458	117 899
Total de la Chine		10 224 008	9 094 997	Tata Steel Ltd.	3 525	25 921	20 774
République tchèque - 0,1 %				Tech Mahindra Ltd.	2 575	35 631	25 241
O2 Czech Republic AS	1 650	22 100	20 748	UPL Ltd.	1 964	21 839	15 064
Hong Kong - 0,3 %				Vedanta Ltd.	48 604	155 121	93 287
China Water Affairs Group Ltd.	14 000	14 462	13 728	Yes Bank Ltd.	22 214	27 590	10 258
ChowTai Fook Jewellery Group Ltd.	26 000	31 847	33 857	Zee Entertainment Enterprises Ltd.	3 040	17 282	9 383
Concord New Energy Group Ltd.	340 000	20 845	19 418	Total de l'Inde		2 135 002	1 745 026
				Indonésie - 2,0 %			
				Adaro Energy Tbk PT	237 300	29 891	22 512
				Astra International Tbk PT	142 200	98 675	65 078
				Bank Central Asia Tbk PT	18 300	49 256	49 683

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Bank Mandiri Persero Tbk PT	95 200	66 557	44 930	Mexique – 2,5 %			
Bank Mandiri Persero Tbk PT Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	43 200	33 571	18 865	Alfa S.A.B. de C.V.	28 922	37 338	22 077
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	241 800	92 158	69 855	America Movil S.A.B. de C.V.	108 648	114 429	94 460
Bukit Asam Tbk PT	117 700	31 843	22 669	Arca Continental S.A.B. de C.V.	2 560	18 762	15 203
Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	39 200	22 035	20 837	Banco del Bajío S.A.	11 670	21 750	13 441
Gudang Garam Tbk PT	5 500	37 959	24 738	Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V.	3 123	23 778	18 522
Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	91 400	27 334	14 335	Concentradora Fibra Danhos S.A. de C.V.	12 093	22 274	15 568
Indo Tambangraya Megah Tbk PT	12 600	21 972	8 530	Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.	5 775	71 029	48 503
Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	13 800	25 584	15 526	Gruma S.A.B. de C.V.	1 783	24 325	26 069
Indofood Sukses Makmur Tbk PT	32 700	22 300	20 343	Grupo Aeroportuario del Centro Norte S.A.B. de C.V.	3 240	24 125	20 406
Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT	98 100	15 569	11 084	Grupo Aeroportuario del Pacífico S.A.B. de C.V.	4 550	58 625	44 324
Kalbe Farma Tbk PT	148 600	19 951	20 686	Grupo Aeroportuario del Sureste S.A.B. de C.V.	1 199	26 696	18 138
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	78 400	16 440	8 484	Grupo Bimbo S.A.B. de C.V.	5 670	14 389	12 857
Sarana Menara Nusantara Tbk PT	270 100	17 213	26 268	Grupo Financiero Banorte S.A.B. de C.V.	16 237	120 722	76 297
Semen Indonesia Persero Tbk PT	17 600	18 968	16 151	Grupo Financiero Inbursa S.A.B. de C.V.	12 347	21 095	11 608
Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	399 600	145 749	116 204	Grupo Mexico S.A.B. de C.V.	44 337	148 188	139 632
Unilever Indonesia Tbk PT	35 000	30 272	26 363	Industrias Penoles S.A.B. de C.V.	1 231	19 031	17 026
United Tractors Tbk PT	20 200	44 326	31 875	Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V.	13 466	32 641	28 479
Total de l'Indonésie		867 623	655 016	Macquarie Mexico Real Estate Management S.A. de C.V.	11 559	16 445	16 072
Malaisie – 3,0 %				Megacable Holdings S.A.B. de C.V.	2 969	16 140	11 772
AirAsia Group Bhd	32 700	26 444	9 095	Orbia Advance Corp. S.A.B. de C.V.	9 680	29 314	19 388
Alliance Bank Malaysia Bhd	21 300	21 853	14 759	Promotora y Operadora de Infraestructura S.A.B. de C.V.	2 042	24 190	19 927
AMMB Holdings Bhd	17 600	23 345	17 398	Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V.	41 136	151 044	133 721
Astro Malaysia Holdings Bhd	38 100	18 308	10 051	Total du Mexique		1 036 330	823 490
Berjaya Sports Toto Bhd	21 800	16 911	15 244	Philippines – 0,8 %			
Bermaz Auto Bhd	28 600	18 867	13 454	Aboitiz Equity Ventures, Inc.	14 360	21 268	17 861
British American Tobacco Malaysia Bhd	3 100	22 057	10 622	Aboitiz Power Corp.	14 600	13 448	10 776
Carlsberg Brewery Malaysia Bhd	1 800	14 782	14 177	Ayala Corp.	825	17 004	17 523
CIMB Group Holdings Bhd	41 900	71 182	47 412	Ayala Land, Inc.	15 800	18 101	14 598
DiGi.Com Bhd	29 800	44 696	40 824	Bank of the Philippine Islands	6 686	14 485	13 159
Gamuda Bhd	20 695	21 493	23 944	BDO Unibank, Inc.	4 570	16 390	12 243
HAP Seng Consolidated Bhd	4 200	13 351	11 748	DMCI Holdings, Inc.	62 600	16 332	7 016
Hartalega Holdings Bhd	12 100	22 030	49 998	Globe Telecom, Inc.	375	20 239	21 219
Heineken Malaysia Bhd	2 000	14 677	14 342	International Container Terminal Services, Inc.	5 870	18 847	16 447
Hong Leong Bank Bhd	4 400	24 888	19 692	Jollibee Foods Corp.	2 810	15 005	10 754
IJM Corp. Bhd	17 600	11 626	10 125	Manila Electric Co.	2 960	27 403	21 685
Inari Amertron Bhd	26 300	13 197	14 128	Pilipinas Shell Petroleum Corp. PLDT, Inc.	14 100	14 926	6 922
IOI Corp. Bhd	16 300	22 863	22 486	SM Investments Corp.	1 000	24 702	25 668
Kuala Lumpur Kepong Bhd	2 700	19 592	19 052	SM Prime Holdings, Inc.	19 600	19 423	17 065
Magnum Bhd	23 900	20 248	16 713	Universal Robina Corp.	4 590	18 332	16 311
Malayan Banking Bhd	54 100	157 051	129 141	Total des Philippines		315 942	272 984
Malaysia Airports Holdings Bhd	5 600	14 175	9 701	Pologne – 0,5 %			
Maxis Bhd	18 500	32 706	31 577	Asseco Poland S.A.	1 058	19 424	24 043
MISC Bhd	11 400	26 083	27 756	Cyfrowy Polsat S.A.	2 506	23 016	22 693
Petronas Chemicals Group Bhd	27 000	67 562	53 209	Grupa Lotos S.A.	651	19 871	13 449
Petronas Dagangan Bhd	2 600	20 076	17 024	Polski Koncern Naftowy Orlen S.A.	1 991	67 945	42 928
Petronas Gas Bhd	7 200	39 944	38 631	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A.	16 440	25 479	25 728
Public Bank Bhd	14 900	105 483	78 144	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A.	3 897	52 094	30 754
RHB Bank Bhd	21 400	37 840	32 582	Total de la Pologne		207 829	159 595
Sime Darby Bhd	26 000	18 722	17 768				
Sime Darby Plantation Bhd	17 000	25 881	26 585				
Tenaga Nasional Bhd	21 500	89 752	79 409				
TIME dotCom Bhd	6 900	21 005	23 862				
Westports Holdings Bhd	13 700	16 982	16 547				
YTL Corp. Bhd	57 274	20 106	15 110				
Total de la Malaisie		1 155 778	992 310				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Russie – 9,5 %				Tiger Brands Ltd.			
Gazprom Neft PJSC	550	22 313	17 154	1 882	41 242	26 319	
Gazprom PJSC	92 211	760 314	677 691	Truworths International Ltd.	8 244	46 410	21 979
Lukoil PJSC	4 340	483 681	438 957	Vodacom Group Ltd.	9 091	100 481	87 618
Magnit PJSC	6 600	120 708	116 770	Total de l'Afrique du Sud	1 676 368	1 025 893	
Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	3 409	38 838	31 294	Corée du Sud – 12,2 %			
MMC Norilsk Nickel PJSC	13 178	396 192	470 070	BNK Financial Group, Inc.	2 784	22 480	15 762
Mobile TeleSystems PJSC	10 074	113 652	126 094	Cheil Worldwide, Inc.	930	25 963	17 270
Novatek PJSC	492	126 054	95 289	CJ CheilJedang Corp.	66	19 636	24 363
Novolipetsk Steel PJSC	2 836	91 249	76 789	Daelim Industrial Co., Ltd.	210	21 867	19 570
PhosAgro PJSC	2 649	45 668	44 522	DB Insurance Co., Ltd.	407	26 453	19 747
Polyus PJSC	588	39 005	67 392	DGB Financial Group, Inc.	2 283	19 550	13 210
Rosneft Oil Co. PJSC	15 955	135 686	109 262	Dongsuh Cos., Inc.	814	18 033	14 609
Sberbank of Russia PJSC	23 806	446 684	368 983	Doosan Bobcat, Inc.	505	19 233	15 039
Severstal PAO	4 736	97 657	78 050	E-Mart, Inc.	119	18 595	14 216
Tatneft PJSC	6 491	596 930	413 039	EBEST Investment & Securities Co., Ltd.	3 077	18 250	15 818
VTB Bank PJSC	12 428	19 568	15 886	GS Engineering & Construction Corp.	794	26 956	22 072
Total de la Russie		3 534 199	3 147 242	GS Holdings Corp.	473	27 338	19 415
Singapour – 0,1 %				Hana Financial Group, Inc.	2 329	98 406	71 203
IGG, Inc.	20 000	29 079	22 283	Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	477	18 885	13 314
Afrique du Sud – 3,1 %				Hanon Systems	1 310	18 052	13 439
Absa Group Ltd.	6 281	101 890	41 998	Hanwha Corp.	744	21 684	18 660
Aeci Ltd.	1 579	13 770	9 568	Hyundai Glovis Co., Ltd.	125	21 491	14 366
African Rainbow Minerals Ltd.	1 791	26 866	23 748	Hyundai Heavy Industries Holdings Co., Ltd.	110	42 318	30 640
Anglo American Platinum Ltd.	197	19 044	19 366	Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	617	19 996	15 999
Attacq Ltd.	14 239	18 052	5 603	Hyundai Motor Co.	966	146 071	106 865
AVI Ltd.	3 702	31 478	20 470	Hyundai Steel Co.	554	24 149	12 860
Barloworld Ltd.	1 994	22 756	10 785	Industrial Bank of Korea	2 103	33 538	19 241
Bid Corp., Ltd.	1 283	36 127	28 512	Kangwon Land, Inc.	979	33 877	23 833
Bidvest Group Ltd. (The)	2 079	39 322	23 148	KB Financial Group, Inc.	2 390	124 279	91 876
Clicks Group Ltd.	934	17 299	15 402	KEPCO Plant Service & Engineering Co., Ltd.	424	16 675	13 947
Coronation Fund Managers Ltd.	4 590	18 034	14 392	Kia Motors Corp.	1 306	59 042	47 395
Discovery Ltd.	1 336	17 109	10 949	Korea Investment Holdings Co., Ltd.	236	18 811	11 892
Exaro Resources Ltd.	6 053	77 360	61 892	Korea Zinc Co., Ltd.	80	40 909	30 346
FirstRand Ltd.	19 463	122 195	58 067	KT Corp.	2 089	32 928	27 712
Foschini Group Ltd. (The)	2 591	41 210	13 037	KT&G Corp.	1 040	119 452	92 089
Gold Fields Ltd.	2 066	15 854	26 272	LG Chem Ltd.	221	91 235	122 743
Hyprop Investments Ltd.	4 880	31 463	8 565	LG Corp.	859	72 269	69 253
Imperial Logistics Ltd.	3 114	14 262	9 601	LG Electronics, Inc.	344	27 754	24 617
KAP Industrial Holdings Ltd.	44 631	22 714	8 711	LG Household & Health Care Ltd.	18	26 906	27 434
Kumba Iron Ore Ltd.	1 363	51 353	49 479	LG Uplus Corp.	1 521	25 112	21 011
Life Healthcare Group Holdings Ltd.	15 751	35 293	20 829	Lotte Chemical Corp.	173	54 072	32 714
Mr. Price Group Ltd.	2 614	44 969	29 302	Lotte Corp.	479	20 532	17 139
MTN Group Ltd.	19 396	169 050	80 324	LS Corp.	377	20 789	14 855
Naspers Ltd.	294	79 458	72 898	Meritz Securities Co., Ltd.	3 386	17 640	11 617
Nedbank Group Ltd.	2 901	67 618	23 093	Mirae Asset Daewoo Co., Ltd.	2 586	22 512	19 531
Old Mutual Ltd.	35 421	63 182	33 430	NAVER Corp.	114	19 896	34 465
Pick n Pay Stores Ltd.	3 577	21 890	14 300	NCSOFT Corp.	53	31 495	53 471
PSG Group Ltd.	832	15 766	10 330	NH Investment & Securities Co., Ltd.	1 299	20 043	12 164
Rand Merchant Investment Holdings Ltd.	6 129	17 829	14 029	POSCO	702	200 157	138 309
Remgro Ltd.	2 046	36 951	16 022	S-1 Corp.	151	17 192	14 670
Resilient REIT Ltd.	2 802	16 563	9 515	Samsung Electro-Mechanics Co., Ltd.	167	20 218	24 393
Reunert Ltd.	2 808	18 522	7 515	Samsung Electronics Co., Ltd.	31 755	1 709 044	1 898 505
Sanlam Ltd.	9 207	66 266	42 538	Samsung Fire & Marine Insurance Co., Ltd.	248	73 521	49 423
Shoprite Holdings Ltd.	2 586	37 477	21 619	Samsung Life Insurance Co., Ltd.	455	42 211	23 030
SPAR Group Ltd. (The)	1 688	30 863	22 706	Samsung SDS Co., Ltd.	112	26 834	21 369
Telkom S.A. SOC Ltd.	5 150	28 380	11 962				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Samsung Securities Co., Ltd.	522	21 182	15 575	Getac Technology Corp.	10 000	19 949	20 058
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	2 577	128 658	83 891	Giant Manufacturing Co., Ltd.	2 000	18 778	24 374
SK Holdings Co., Ltd.	183	52 116	60 299	Gigabyte Technology Co., Ltd.	9 000	18 833	27 213
SK Hynix, Inc.	2 184	188 958	210 449	Great Wall Enterprise Co., Ltd.	11 723	18 665	23 081
SK Innovation Co., Ltd.	582	114 047	86 330	Highwealth Construction Corp.	12 000	24 857	24 124
SK Telecom Co., Ltd.	289	84 585	69 047	Hiwin Technologies Corp.	2 000	22 774	27 097
Woori Financial Group, Inc.	3 729	49 552	37 199	Ho Tung Chemical Corp.	79 000	24 816	26 622
Total de la Corée du Sud		4 333 447	4 060 271	Holy Stone Enterprise Co., Ltd.	4 000	18 350	22 343
Taiwan – 24,8 %				Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	141 600	462 226	564 109
Accton Technology Corp.	3 000	23 771	31 575	Hotai Motor Co., Ltd.	2 000	41 809	64 904
Acer, Inc.	35 000	28 843	28 921	Hua Nan Financial Holdings Co., Ltd.	29 715	24 786	27 434
Advantech Co., Ltd.	2 000	24 536	27 282	Huaku Development Co., Ltd.	4 000	14 507	15 548
ASE Technology Holding Co., Ltd.	23 500	64 945	73 334	IBF Financial Holdings Co., Ltd.	36 260	16 313	19 668
Asia Cement Corp.	32 000	59 025	64 406	International CSRC Investment Holdings Co.	11 021	16 011	10 251
Asustek Computer, Inc.	11 000	107 324	109 682	Intevent Corp.	49 000	50 441	56 775
Aten International Co., Ltd.	7 000	26 871	28 759	KingYuan Electronics Co., Ltd.	14 000	17 286	22 200
Capital Securities Corp.	47 140	18 856	22 523	Kung Long Batteries Industrial Co., Ltd.	4 000	26 038	27 328
Catcher Technology Co., Ltd.	8 000	77 426	81 985	Lien Hwa Industrial Holdings Corp.	13 755	19 851	26 986
Cathay Financial Holding Co., Ltd.	26 788	49 121	51 752	Lite-On Technology Corp.	28 000	56 303	59 845
Chang Hwa Commercial Bank Ltd.	25 421	21 521	22 707	Macronix International	18 000	25 496	25 759
Cheng Loong Corp.	22 000	18 057	23 663	Makalot Industrial Co., Ltd.	3 000	20 697	21 466
Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd.	14 000	25 951	21 812	MediaTek, Inc.	5 000	59 410	133 640
Chicony Electronics Co., Ltd.	8 005	26 203	31 484	Mega Financial Holding Co., Ltd.	79 000	99 154	112 687
Chilisin Electronics Corp.	5 000	21 184	20 773	Merry Electronics Co., Ltd.	3 000	19 594	19 319
China Development Financial Holding Corp.	51 000	21 135	22 272	Micro-Star International Co., Ltd.	9 000	32 606	44 662
China Steel Chemical Corp.	3 000	16 337	14 541	Nan Ya Plastics Corp.	79 000	259 006	235 585
China Steel Corp.	98 000	104 542	93 645	Nanya Technology Corp.	24 000	69 555	67 582
Chong Hong Construction Co., Ltd.	5 000	17 690	20 035	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	1 000	11 387	13 272
Chroma ATE, Inc.	3 000	19 530	20 981	Novatek Microelectronics Corp.	6 000	43 392	63 150
Chung-Hsin Electric & Machinery Manufacturing Corp.	25 000	22 561	31 910	Oriental Union Chemical Corp.	17 000	16 458	13 184
ChungHwa Telecom Co., Ltd.	29 000	136 714	156 629	Pegatron Corp.	29 000	67 458	85 678
Cleanaway Co., Ltd.	3 000	19 594	23 127	Posiflex Technology, Inc.	5 000	21 509	19 319
Compal Electronics, Inc.	48 000	39 405	42 654	Pou Chen Corp.	20 000	32 131	26 590
CTBC Financial Holding Co., Ltd.	114 000	102 935	107 092	Powertech Technology, Inc.	11 000	35 684	54 333
CTCI Corp.	11 000	21 719	19 804	President Chain Store Corp.	3 000	39 644	41 061
CyberPower Systems, Inc.	4 000	16 860	15 012	Prince Housing & Development Corp.	38 000	18 110	17 717
Delta Electronics, Inc.	16 000	103 942	123 715	Qisda Corp.	23 000	19 960	18 740
E.Sun Financial Holding Co., Ltd.	42 608	44 260	54 680	Quanta Computer, Inc.	38 000	94 900	124 546
Eclat Textile Co., Ltd.	1 000	17 768	15 788	Realtek Semiconductor Corp.	3 000	30 358	41 408
Elan Microelectronics Corp.	6 000	23 852	33 375	Ruentex Industries Ltd.	7 600	24 945	24 839
Elite Material Co., Ltd.	3 000	16 257	22 089	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. (The)	22 000	48 376	46 259
Eternal Materials Co., Ltd.	19 070	22 201	27 510	Shin Kong Financial Holding Co., Ltd.	38 800	14 963	15 403
Everlight Electronics Co., Ltd.	16 000	20 429	22 860	Sinbon Electronics Co., Ltd.	3 000	16 371	20 635
Far Eastern Department Stores Ltd.	13 000	10 289	14 943	Sinon Corp.	30 000	24 158	25 135
Far Eastern International Bank	39 116	19 039	20 043	SinoPac Financial Holdings Co., Ltd.	72 120	35 855	36 122
Far Eastern New Century Corp.	46 000	60 101	59 245	Standard Foods Corp.	6 000	15 727	17 449
Far EastTone Telecommunications Co., Ltd.	16 000	50 885	50 225	Supreme Electronics Co., Ltd.	21 000	27 238	28 840
Feng Hsin Steel Co., Ltd.	9 000	19 763	21 604	Syncmold Enterprise Corp.	9 000	31 089	33 611
Feng TAY Enterprise Co., Ltd.	3 000	28 167	23 058	Synnex Technology International Corp.	18 000	29 036	34 608
First Financial Holding Co., Ltd.	54 730	50 817	57 225	System Corp.	5 000	15 890	18 765
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	56 000	251 402	195 692	TA Chen Stainless Pipe	15 334	22 939	19 183
Formosa Petrochemical Corp.	15 000	69 952	61 281	Taishin Financial Holding Co., Ltd.	50 036	29 773	30 836
Formosa Plastics Corp.	55 000	250 425	222 411	Taiwan Business Bank	28 476	15 245	14 197
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	36 000	69 332	72 955	Taiwan Cement Corp.	74 143	128 503	146 317
Fusheng Precision Co., Ltd.	2 000	15 549	15 049	Taiwan Cogeneration Corp.	17 000	20 311	30 880
				Taiwan Cooperative Financial Holding Co., Ltd.	44 714	37 602	42 830

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Taiwan FU Hsing Industrial Co., Ltd.	13 000	24 313	23 464	SPCG PCL	18 300	15 206	13 145
Taiwan High Speed Rail Corp.	14 000	22 693	23 589	Thai Oil PCL	7 300	19 433	14 235
Taiwan Hon Chuan Enterprise Co., Ltd.	9 000	21 174	22 809	Thai Union Group PCL	24 700	18 895	14 041
Taiwan Mobile Co., Ltd.	14 000	68 303	71 413	Thanachart Capital PCL	6 900	15 815	10 794
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	142 000	1 486 177	2 051 736	TMB Bank PCL	244 714	18 425	11 323
Taiwan Styrene Monomer	26 000	24 790	19 684	TPI Polene Power PCL	75 500	14 569	13 375
Teco Electric and Machinery Co., Ltd.	18 000	17 106	22 476	True Corp. PCL	59 500	13 400	8 915
Topco Scientific Co., Ltd.	6 000	25 712	30 190	Total de la Thaïlande		1 119 093	917 581
Tripod Technology Corp.	6 000	25 274	36 284	Turquie - 0,8 %			
TSRC Corp.	18 000	20 873	14 250	BIM Birlesik Magazalar AS	2 810	29 486	37 967
Uni-President Enterprises Corp.	34 000	111 015	111 907	Enka Insaat ve Sanayi AS	16 322	18 842	19 977
Unimicron Technology Corp.	8 000	11 087	18 502	Eregli Demirve Celik Fabrikalari T.A.S.	37 433	66 446	63 816
United Microelectronics Corp.	106 000	58 860	77 802	Ford Otomotiv Sanayi AS	1 422	20 179	20 032
Voltronic Power Technology Corp.	1 000	28 532	39 053	Haci Omer Sabanci Holding AS	10 566	21 552	19 399
Walsin Lihwa Corp.	46 000	32 144	30 897	KOC Holding AS	6 995	28 553	25 018
Walsin Technology Corp.	6 000	47 052	49 578	TAV Havalimanlari Holding AS	4 295	25 612	16 530
Weikeng Industrial Co., Ltd.	36 000	27 378	25 509	Tekfen Holding AS	4 867	21 561	16 459
Winbond Electronics Corp.	43 089	27 679	26 554	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	3 268	16 116	17 207
Wistron Corp.	37 088	36 339	61 292	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	13 369	41 959	43 670
Wistron NeWeb Corp.	6 000	20 622	17 837	Total de la Turquie		290 306	280 075
Wiwynn Corp.	1 000	21 270	37 022	TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES		36 271 731	32 980 661
WPG Holdings Ltd.	21 840	36 924	39 571	DROITS - 0,0 %			
WT Microelectronics Co., Ltd.	13 117	22 492	23 948	Chine - 0,0 %			
Yageo Corp.	6 000	85 855	105 527	Legend Holdings Corp., échéant le			
YC INOX Co., Ltd.	20 000	23 027	22 989	20 juillet 2020	53	—	—
Yuanta Financial Holding Co., Ltd.	67 000	51 907	53 971	BONS DE SOUSCRIPTION - 0,0 %			
Total de Taiwan		7 122 807	8 235 529	Thaïlande - 0,0 %			
Thaïlande - 2,8 %				BTS Group Holdings PCL	4 500	—	226
Advanced Info Service PCL	7 100	59 421	57 882	Commissions et autres coûts de transaction du			
Airports of Thailand PCL	12 100	35 672	32 259	portefeuille (note 2)		(27 255)	
Bangkok Dusit Medical Services PCL	26 800	27 215	26 572	TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES			
Bangkok Expressway & Metro PCL	41 400	18 533	17 332	TITRES - 99,4 %		36 244 476	32 980 887
Banpu PCL	28 800	16 841	7 742	Autres actifs en excédent du passif - 0,6 %			197 112
Berli Jucker PCL	8 000	16 259	13 925	ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE			
BTS Group Holdings PCL	54 700	26 166	27 238	PARTS RACHETABLES - 100,0 %			33 177 999 \$
Bumrungrad Hospital PCL	3 700	25 170	18 995				
Central Pattana PCL	7 000	22 327	15 038				
Charoen Pokphand Foods PCL	22 000	26 286	30 781				
CP ALL PCL	13 600	45 781	40 603				
Delta Electronics Thailand PCL	6 700	17 291	15 870				
Electricity Generating PCL	1 300	15 979	14 150				
Gulf Energy Development PCL	12 500	19 191	20 794				
Hana Microelectronics PCL	14 500	18 595	17 731				
Indorama Ventures PCL	23 900	37 623	29 226				
Intouch Holdings PCL	14 200	41 615	35 198				
IRPC PCL	145 100	29 068	16 753				
Kiatnakin Bank PCL	6 900	18 902	12 162				
Krung Thai Bank PCL	24 300	19 099	11 029				
Land & Houses PCL	31 300	14 177	10 483				
Major Cineplex Group PCL	13 600	14 433	8 990				
Osotspa PCL	9 600	17 636	16 076				
PTT Exploration & Production PCL	13 200	68 030	53 369				
PTT Global Chemical PCL	25 800	66 515	52 583				
PTT PCL	80 400	157 754	133 748				
Ratch Group PCL	4 400	14 529	12 070				
Siam Cement PCL (The)	3 000	56 659	48 650				
Siam Commercial Bank PCL (The)	10 800	56 583	34 504				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	39 914 375 \$	59 529 315 \$
Trésorerie	157 106	12 945
Plus-value latente des contrats de change	111 872	323 636
Créances :		
Titres de placement vendus	31 072	1 115
Dividendes	15 785	945
Remboursements au titre de l'impôt étranger	285 730	235 442
Renonciation aux honoraires de consultation	18 171	1 624
Total de l'actif	40 534 111	60 105 022
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	976	51 365
Créditeurs :		
Distributions	201 250	178 250
Total du passif	202 226	229 615
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	40 331 885 \$	59 875 407 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		
Parts couvertes	21 973 235	34 255 695
Parts non couvertes	18 358 650	25 619 712
	40 331 885 \$	59 875 407 \$
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)		
Parts couvertes	950 000	1 250 000
Parts non couvertes	800 000	1 000 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part		
Parts couvertes	23,13 \$	27,40 \$
Parts non couvertes	22,95 \$	25,62 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	839 073 \$	1 792 714 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(8 030 176)	(692 893)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(738 618)	6 392 107
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(7 929 721)	7 491 928
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(1 478 144)	(50 243)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(161 375)	2 240 854
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(1 639 519)	2 190 611
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(9 569 240)	9 682 539
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(67 014)	(58 432)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	12 562	(12 896)
Total des autres revenus (pertes)	(54 452)	(71 328)
Total des revenus (pertes)	(9 623 692)	9 611 211
CHARGES		
Retenues d'impôt étranger	120 965	251 599
Frais de gestion (note 5)	142 255	201 476
Coûts de transaction (note 2)	14 439	17 316
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	1 842	3 019
Total des charges	279 501	473 410
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(1 842)	(3 019)
Charges nettes	277 659	470 391
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(9 901 351)\$	9 140 820 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par catégorie		
Parts couvertes	(6 908 454)	6 083 981
Parts non couvertes	(2 992 897)	3 056 839
	(9 901 351)\$	9 140 820 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables		
Parts couvertes	1 065 385	1 488 122
Parts non couvertes	923 077	1 163 536
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part		
Parts couvertes	(6,48)\$	4,09 \$
Parts non couvertes	(3,24)\$	2,63 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	59 875 407 \$	66 445 619 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(9 901 351)	9 140 820
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(448 250)	(815 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(448 250)	(815 000)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	1 014 189	–
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(10 208 110)	(11 954 428)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(9 193 921)	(11 954 428)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	40 331 885 \$	62 817 011 \$
PARTS COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	34 255 695 \$	39 046 096 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(6 908 454)	6 083 981
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(226 250)	(464 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(226 250)	(464 000)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	1 013 476	–
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(6 161 232)	(7 005 988)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(5 147 756)	(7 005 988)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	21 973 235 \$	37 660 089 \$
PARTS NON COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	25 619 712 \$	27 399 523 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(2 992 897)	3 056 839
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(222 000)	(351 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(222 000)	(351 000)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	713	–
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(4 046 878)	(4 948 440)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(4 046 165)	(4 948 440)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	18 358 650 \$	25 156 922 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(9 901 351)\$	9 140 820 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	8 030 176	692 893
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	738 618	(6 392 107)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	161 375	(2 240 854)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(12 562)	12 896
Achat de placements ¹	(8 562 132)	(12 247 718)
Produit de la vente de placements ¹	12 808 106	17 244 618
Variation des créances	(111 632)	1 229 884
Variation des créditeurs	—	283 272
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	3 150 598	7 723 704
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	1 014 189	—
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(3 607 938)	(7 077 291)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(425 250)	(744 001)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(3 018 999)	(7 821 292)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	12 562	(12 896)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	144 161 \$	(110 484)\$
Trésorerie au début de la période	12 945 \$	151 603 \$
Trésorerie à la fin de la période	157 106 \$	41 119 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	652 980 \$	1 421 389 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES - 98,9 %				Allemagne - 30,2 %			
Autriche - 0,4 %				BASF SE			
Andritz AG	3 094	188 304	153 349	Bayer AG	17 634	1 977 367	1 774 703
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	115	14 492	4 125	Bayerische Motoren Werke AG	12 031	1 367 476	1 045 726
Total de l'Autriche		202 796	157 474	Brenntag AG	1 546	108 577	110 609
Belgique - 5,7 %				Continental AG	2 748	618 996	366 394
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	24 707	2 999 269	1 657 880	Covestro AG	3 804	310 179	196 976
Bekaert S.A.	1 186	54 951	31 659	Daimler AG	26 164	2 181 796	1 446 663
Solvay S.A.	2 820	435 382	307 404	Duerr AG	821	49 301	29 137
UCBS.A.	2 026	209 675	319 531	Evonik Industries AG	7 944	327 693	274 761
Total de la Belgique		3 699 277	2 316 474	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	1 910	220 727	222 932
Finlande - 3,9 %				Fresenius SE & Co. KGaA	3 403	287 490	229 674
Ahlstrom-Munksjo Oyj	2 391	48 438	48 646	GEA Group AG	2 136	105 027	91 980
Cargotec Oyj	1 181	63 484	37 325	Hannover Rueck SE	1 601	284 925	375 692
Fiskars Oyj Abp	2 130	44 740	33 365	Hapag-Lloyd AG	279	24 430	22 151
Huhtamaki Oyj	1 575	80 209	84 423	HeidelbergCement AG	2 196	232 970	159 700
Kemira Oyj	4 120	68 548	72 226	Henkel AG & Co. KGaA	2 040	281 774	231 396
Kone Oyj	9 032	634 589	845 848	Hochtief AG	1 165	197 745	140 700
Konecranes Oyj	1 702	86 905	52 384	Infineon Technologies AG	7 501	202 805	239 530
Metso Oyj	3 510	149 317	156 624	K+S AG	893	29 525	7 680
Valmet Oyj	2 709	71 408	96 266	Krones AG	273	33 869	23 846
Wartsila Oyj Abp	13 437	286 551	151 244	LANXESS AG	648	56 358	46 550
Total de la Finlande		1 534 189	1 578 351	Merck KGaA	619	87 333	97 815
France - 31,3 %				MTU Aero Engines AG	277	55 872	65 319
Air Liquide S.A.	4 273	639 869	839 291	Pfeiffer Vacuum Technology AG	72	15 747	18 107
Arkema S.A.	1 004	139 472	130 762	SAP SE	5 789	842 177	1 100 929
bioMérieux	217	24 969	40 598	Siemens AG	11 082	1 796 076	1 775 941
Cie Générale des Établissements Michelin SCA	2 488	416 735	351 443	Siemens Healthineers AG	6 806	387 826	444 044
Danone S.A.	7 447	730 200	701 285	Siltronic AG	916	103 899	127 204
Dassault Systèmes SE	493	74 039	115 839	Software AG	651	36 160	35 751
Gaztransport & Technigaz S.A.	559	41 447	58 063	Symrise AG	495	52 374	78 372
Hermès International	322	248 852	366 376	Wacker Chemie AG	664	95 603	62 001
Imerys S.A.	1 507	122 306	69 943	Total de l'Allemagne		14 230 182	12 165 376
IPSO	556	23 981	18 967	Irlande - 1,9 %			
Kering S.A.	1 107	729 693	820 034	CRH PLC	12 755	566 070	595 107
L'Oréal S.A.	3 529	1 080 859	1 542 328	Glanbia PLC	3 063	67 760	47 231
Legrand S.A.	2 292	213 054	237 085	Kerry Group PLC	700	92 418	118 110
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3 506	1 447 762	2 094 343	Total de l'Irlande		726 248	760 448
Pernod Ricard S.A.	1 628	321 020	348 781	Italie - 0,8 %			
Publicis Groupe S.A.	3 805	292 878	167 692	Brunello Cucinelli SpA	359	14 566	14 520
Rémy Cointreau S.A.	295	45 859	54 694	Davide Campari-Milano SpA	4 087	39 154	46 890
Rubis SCA	1 161	86 044	75 978	DiaSorin SpA	305	43 495	79 503
Sanofi	19 669	2 343 243	2 727 501	Ferrari N.V.	863	148 042	200 466
Sartorius Stedim Biotech	167	23 976	57 480	Total de l'Italie		245 257	341 379
Schneider Electric SE	7 319	813 080	1 107 070	Pays-Bas - 13,4 %			
SCOR SE	3 583	176 447	133 737	Akzo Nobel N.V.	3 144	383 436	383 507
SEB S.A.	289	64 793	65 032	ASM International N.V.	638	59 359	134 244
Société BIC S.A.	985	122 397	68 107	ASML Holding N.V.	3 193	868 896	1 596 720
Sodexo S.A.	1 606	227 250	147 896	BE Semiconductor Industries N.V.	4 025	169 945	244 132
Teleperformance	252	52 846	87 083	Corbion N.V.	699	28 080	34 270
Valeo S.A.	5 102	290 627	182 317	EXOR N.V.	879	70 990	68 361
Vicat S.A.	648	50 220	27 111	Heineken Holding N.V.	3 172	381 264	353 490
Total de la France		10 843 918	12 636 836	Heineken N.V.	5 833	743 296	732 215
				Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	24 585	708 284	912 380
				Koninklijke DSM N.V.	2 374	285 163	447 411

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Koninklijke Vopak N.V.	2 229	138 798	160 532
SBM Offshore N.V.	2 407	52 584	47 922
Wolters Kluwer N.V.	2 663	190 112	283 202
Total des Pays-Bas		4 080 207	5 398 386
Portugal – 0,9 %			
Galp Energia, SGPS, S.A.	22 846	468 358	359 792
Espagne – 2,4 %			
Acerinox S.A.	6 113	99 347	67 142
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	7 221	342 452	247 876
Cie Automotive S.A.	1 878	65 763	44 874
Construccion y Auxiliar de Ferrocarriles S.A.	287	15 942	14 181
Grifols S.A.	4 411	173 929	182 389
Mapfre S.A.	105 373	409 719	255 328
Prosegur Cash S.A.	35 025	99 016	40 077
Prosegur Cia de Seguridad S.A.	11 657	82 961	36 948
Viscofan S.A.	988	77 899	87 811
Total de l'Espagne		1 367 028	976 626
Suisse – 0,8 %			
STMicroelectronics N.V.	8 539	212 896	316 371
Royaume-Uni – 7,2 %			
Fiat Chrysler Automobiles N.V.	51 903	881 992	710 132
Unilever N.V.	30 180	2 182 376	2 181 403
Total du Royaume-Uni		3 064 368	2 891 535
TOTAL DES ACTIONS ORDINAIRES		40 674 724	39 899 048
DROITS – 0,1 %			
Espagne – 0,1 %			
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A., échéant le 10 juillet 2020	7 216	15 182	15 327
Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)			(54 611)
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES – 99,0 %		40 635 295	39 914 375
Contrats de change (annexe 1) – 0,3 %			110 896
Autres actifs en excédent du passif – 0,7 %			306 614
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			40 331 885 \$

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	20 305 EUR	31 279 CAD	218 \$	A+
7/2/2020	100 055 EUR	153 903 CAD	845	A+
7/2/2020	106 279 CAD	68 984 EUR	(752)	A+
7/2/2020	2 221 019 EUR	3 416 994 CAD	19 433	A+
7/2/2020	2 914 327 EUR	4 484 799 CAD	26 665	A+
7/2/2020	2 915 312 EUR	4 484 799 CAD	25 158	A+
7/2/2020	2 917 891 EUR	4 484 799 CAD	21 212	A+
7/2/2020	2 920 021 EUR	4 484 799 CAD	17 954	A+
7/2/2020	3 399 987 CAD	2 222 716 EUR	170	A+
7/2/2020	4 462 481 CAD	2 917 169 EUR	1	A+
7/2/2020	4 462 481 CAD	2 917 217 EUR	74	A+
7/2/2020	4 462 481 CAD	2 917 188 EUR	30	A+
7/2/2020	4 462 481 CAD	2 917 207 EUR	59	A+
8/4/2020	2 296 346 EUR	3 514 728 CAD	(192)	A+
8/4/2020	3 013 758 EUR	4 613 078 CAD	46	A+
8/4/2020	3 013 784 EUR	4 613 078 CAD	7	A+
8/4/2020	3 013 793 EUR	4 613 078 CAD	(8)	A+
8/4/2020	3 013 803 EUR	4 613 078 CAD	(24)	A+
			110 896 \$	

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

CAD Dollar canadien
EUR Euro

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	57 617 547 \$	57 621 017 \$
Trésorerie	118 614	52 279
Plus-value latente des contrats de change	201 713	300 656
Créances :		
Titres de placement vendus	206 218	–
Dividendes	79 480	55 764
Remboursements au titre de l'impôt étranger	104 542	86 575
Renonciation aux honoraires de consultation	4 321	–
Total de l'actif	58 332 435	58 116 291
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	37 009	66 232
Créditeurs :		
Distributions	333 500	401 200
Frais de gestion	–	2 219
Total du passif	370 509	469 651
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	57 961 926 \$	57 646 640 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		
Parts couvertes	33 062 145	37 515 171
Parts non couvertes	24 899 781	20 131 469
	57 961 926 \$	57 646 640 \$
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)		
Parts couvertes	1 300 000	1 400 000
Parts non couvertes	1 000 000	800 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part		
Parts couvertes	25,43 \$	26,80 \$
Parts non couvertes	24,90 \$	25,16 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	832 302 \$	855 009 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(1 162 458)	(1 434 771)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	174 813	5 691 622
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(155 343)	5 111 860
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(1 122 985)	(159 888)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(69 720)	1 718 596
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(1 192 705)	1 558 708
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(1 348 048)	6 670 568
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	(197)	–
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(18 381)	3 811
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	2 663	(8 398)
Total des autres revenus (pertes)	(15 915)	(4 587)
Total des revenus (pertes)	(1 363 963)	6 665 981
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	163 414	136 848
Retenues d'impôt étranger	84 541	89 991
Coûts de transaction (note 2)	15 233	58 928
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	1 562	1 513
Total des charges	264 750	287 280
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(1 562)	(1 513)
Charges nettes	263 188	285 767
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 627 151)\$	6 380 214 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par catégorie		
Parts couvertes	(1 493 126)	5 162 418
Parts non couvertes	(134 025)	1 217 796
	(1 627 151)\$	6 380 214 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables		
Parts couvertes	1 304 396	1 400 000
Parts non couvertes	973 077	589 503
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part		
Parts couvertes	(1,14)\$	3,69 \$
Parts non couvertes	(0,14)\$	2,07 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	57 646 640 \$	39 573 873 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 627 151)	6 380 214
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(499 500)	(328 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(499 500)	(328 000)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	5 126 536	4 718 520
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(2 684 599)	–
Opérations sur parts rachetables, montant net	2 441 937	4 718 520
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	57 961 926 \$	50 344 607 \$
PARTS COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	37 515 171 \$	29 145 358 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 493 126)	5 162 418
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(279 500)	(229 600)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(279 500)	(229 600)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	4 199	–
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(2 684 599)	–
Opérations sur parts rachetables, montant net	(2 680 400)	–
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	33 062 145 \$	34 078 176 \$
PARTS NON COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	20 131 469 \$	10 428 515 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(134 025)	1 217 796
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(220 000)	(98 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(220 000)	(98 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	5 122 337	4 718 520
Opérations sur parts rachetables, montant net	5 122 337	4 718 520
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	24 899 781 \$	16 266 431 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 627 151)\$	6 380 214 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	1 162 458	1 434 771
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(174 813)	(5 691 622)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	69 720	(1 718 596)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(2 663)	8 398
Achat de placements ¹	(9 989 302)	(27 131 348)
Produit de la vente de placements ¹	9 005 127	25 976 812
Variation des créances	(252 222)	912 549
Variation des créditeurs	(2 219)	276 986
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(1 811 065)	448 164
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	5 126 536	116 089
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(2 684 599)	—
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(567 200)	(632 699)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	1 874 737	(516 610)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	2 663	(8 398)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	66 335 \$	(76 844)\$
Trésorerie au début de la période	52 279 \$	134 005 \$
Trésorerie à la fin de la période	118 614 \$	57 161 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	706 078 \$	706 162 \$
Intérêts reçus (versés)	(197)	—

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %				France – 4,8 %			
Australie – 3,8 %				Cie Plastic Omnium S.A.			
Altium Ltd.	702	18 018	21 381	3 617	114 994	100 314	
Appen Ltd.	193	4 865	6 139	Gaztransport & Technigaz S.A.	845	109 000	87 769
ARB Corp., Ltd.	1 003	21 463	16 883	Hermès International	508	433 961	578 009
Aristocrat Leisure Ltd.	7 145	185 892	170 853	Ipsen S.A.	434	78 983	50 224
Beach Energy Ltd.	18 738	33 714	26 708	Kering S.A.	1 757	1 356 874	1 301 536
BlueScope Steel Ltd.	5 193	55 859	56 926	Rubis SCA	1 845	132 467	120 740
carsales.com Ltd.	5 212	74 693	86 704	Sartorius Stedim Biotech	260	56 365	89 489
Computershare Ltd.	8 622	153 483	107 129	Teleperformance	386	104 734	133 389
Corporate Travel Management Ltd.	1 752	32 810	15 920	Trigano S.A.	325	48 344	46 361
CSL Ltd.	3 429	642 058	922 849	Valeo S.A.	8 089	451 385	289 057
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	1 481	67 251	95 396	Total de la France	2 887 107	2 796 888	
IDP Education Ltd.	1 924	31 546	27 947	Allemagne – 7,6 %			
Invocare Ltd.	1 546	22 218	15 193	Bechtle AG	317	43 199	76 133
Magellan Financial Group Ltd.	3 948	122 680	214 764	CANCOM SE	251	18 624	18 123
NIB Holdings Ltd.	8 061	54 840	34 847	Dermapharm Holding SE	850	42 060	57 583
Northern Star Resources Ltd.	4 183	34 441	52 405	Deutsche Wohnen SE	4 885	248 100	298 536
Pendal Group Ltd.	15 910	139 848	89 069	Fuchs Petrolub SE	1 387	82 916	63 652
Reece Ltd.	6 556	75 902	56 498	Hochtief AG	2 118	331 436	255 796
Regis Resources Ltd.	10 268	42 842	50 262	Infineon Technologies AG	13 886	324 555	443 423
St Barbara Ltd.	16 042	41 582	47 386	MTU Aero Engines AG	475	147 117	112 009
Technology One Ltd.	3 499	22 294	28 841	Nemetschek SE	414	24 477	38 758
Viva Energy Group Ltd.	25 019	45 965	42 700	SAP SE	10 490	1 847 249	1 994 947
Webjet Ltd.	1 023	13 578	3 185	Siemens Healthineers AG	12 382	708 645	807 839
Total de l'Australie		1 937 842	2 189 985	Siltronic AG	1 691	209 498	234 827
Autriche – 0,0 %				Total de l'Allemagne	4 027 876	4 401 626	
S IMMO AG	996	28 239	24 317	Hong Kong – 0,5 %			
Chine – 2,5 %				Melco International Development Ltd.	8 000	23 808	21 088
Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co., Ltd.	13 000	30 352	23 850	Techtronic Industries Co., Ltd.	20 000	177 392	266 409
China Overseas Land & Investment Ltd.	217 000	1 012 235	894 237	Vitasoy International Holdings Ltd.	4 506	22 559	23 478
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	75 200	178 557	193 468	Total de Hong Kong	223 759	310 975	
Guangdong Investment Ltd.	132 000	356 365	308 515	Indonésie – 0,1 %			
Total de la Chine		1 577 509	1 420 070	First Resources Ltd.	19 100	30 498	25 920
Danemark – 8,2 %				Irlande – 0,2 %			
Ambu A/S	500	18 074	21 387	Hibernia REIT PLC	10 203	21 180	17 481
Chr Hansen Holding A/S	734	84 646	103 045	Kerry Group PLC	719	114 756	121 316
Coloplast A/S	2 744	375 589	578 963	Total de l'Irlande	135 936	138 797	
DSV Panalpina A/S	409	45 482	67 979	Israël – 0,2 %			
GN Store Nord A/S	366	22 573	26 547	ICL Group Ltd.	31 336	211 041	126 524
Novo Nordisk A/S	29 811	2 055 475	2 627 318	Italie – 1,1 %			
Novozymes A/S	2 532	157 310	199 298	Brunello Cucinelli SpA	423	23 155	17 109
Orsted A/S	4 672	542 075	733 948	DiaSorin SpA	320	45 407	83 413
Rockwool International A/S	112	48 416	41 263	Ferrari N.V.	917	162 826	213 009
Royal Unibrew A/S	750	65 430	84 941	Interpump Group SpA	555	22 065	22 448
SimCorp A/S	303	30 655	44 465	RAI WaySpA	6 856	51 759	61 354
Vestas Wind Systems A/S	1 697	202 264	235 243	Recordati SpA	3 289	176 000	223 640
Total du Danemark		3 647 989	4 764 397	Reply SpA	170	15 808	18 685
Finlande – 3,3 %				Total de l'Italie	497 020	639 658	
Kone Oyj	9 601	752 100	899 135	Japon – 23,1 %			
Metsa Board Oyj	13 420	92 775	123 585	Advantest Corp.	4 400	177 734	339 954
Neste Oyj	10 644	407 143	566 792	Ain Holdings, Inc.	400	32 213	35 652
Nokian Renkaat Oyj	5 214	252 927	155 851	Asahi Intecc Co., Ltd.	600	17 690	23 217
Wartsila Oyj Abp	13 904	314 477	156 500	Astellas Pharma, Inc.	32 882	698 290	747 010
Total de la Finlande		1 819 422	1 901 863	Bandai Namco Holdings, Inc.	3 800	255 285	271 865

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Benefit One, Inc.	1 300	28 520	35 532	SMS Co., Ltd.	400	10 678	12 205
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	13 116	386 705	954 590	Systemex Corp.	1 200	122 073	124 680
Daifuku Co., Ltd.	1 400	109 652	166 493	Systema Corp.	800	13 104	14 352
Daito Trust Construction Co., Ltd.	2 000	340 463	250 193	TechnoPro Holdings, Inc.	600	40 526	46 585
Digital Arts, Inc.	100	12 194	10 983	Toei Animation Co., Ltd.	500	26 711	31 751
Disco Corp.	432	103 145	142 290	Tokai Carbon Co., Ltd.	3 400	45 269	43 396
Elecom Co., Ltd.	500	20 571	33 203	Tokuyama Corp.	1 000	32 210	31 965
en-japan, Inc.	500	30 351	16 765	Tokyo Electron Ltd	5 306	1 277 863	1 771 107
Fast Retailing Co., Ltd.	400	324 680	311 574	Tosho Co., Ltd.	600	9 369	9 665
Funai Soken Holdings, Inc.	700	21 221	21 430	Trend Micro, Inc.	3 000	210 069	227 999
GMO Payment Gateway, Inc.	100	10 024	14 190	Ulvac, Inc.	1 000	44 360	39 262
Harmonic Drive Systems, Inc.	500	26 046	37 306	United Arrows Ltd.	834	29 336	19 184
Haseko Corp.	13 700	226 619	234 875	USS Co., Ltd.	5 000	131 231	108 761
Hikari Tsushin, Inc.	409	86 752	126 763	Workman Co., Ltd.	400	29 222	47 822
Hoya Corp.	2 800	229 163	362 678	ZOZO, Inc.	2 400	77 073	72 596
Infocom Corp.	400	12 658	14 897	Total du Japon	10 970 598	13 410 895	
Japan Lifeline Co., Ltd.	1 200	32 044	21 558	Kazakhstan – 0,1 %			
Japan Material Co., Ltd.	800	16 579	17 068	KAZ Minerals PLC	4 100	38 328	34 499
JINS Holdings, Inc.	200	15 437	16 538	Macao – 0,9 %			
Kakaku.com, Inc.	2 300	59 305	79 241	Galaxy Entertainment Group Ltd.	53 507	533 603	496 002
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	1 046	75 514	72 761	Mexique – 0,2 %			
Kao Corp.	4 600	478 705	495 943	Fresnillo PLC	8 279	118 003	117 229
Keyence Corp.	534	223 146	303 570	Pays-Bas – 4,9 %			
Kobe Bussan Co., Ltd.	600	33 665	46 054	ASM International N.V.	711	75 017	149 605
Konami Holdings Corp.	2 800	163 050	126 902	ASML Holding N.V.	3 440	974 474	1 720 237
Kose Corp.	400	83 158	65 446	Corbion N.V.	695	29 313	34 074
Koshidaka Holdings Co., Ltd.	1 300	10 548	6 827	Euronext N.V.	1 094	113 029	149 362
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	200	13 069	11 148	Koninklijke DSM N.V.	2 490	400 059	469 272
Kusuri no Aoki Holdings Co., Ltd.	100	10 019	10 680	TKH Group N.V.	653	43 381	35 042
Lasertec Corp.	600	13 244	76 959	Wolters Kluwer N.V.	2 676	260 460	284 584
M3, Inc.	1 500	43 275	86 825	Total des Pays-Bas	1 895 733	2 842 176	
Mani, Inc.	500	14 852	17 958	Nouvelle-Zélande – 0,5 %			
Maruwa Unyu Kikan Co., Ltd.	200	4 840	7 638	Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	6 958	96 740	217 185
McDonald's Holdings Co., Japan Ltd.	600	38 259	44 085	Mainfreight Ltd.	864	22 028	29 847
Meitec Corp.	942	58 731	61 721	Ryman Healthcare Ltd.	5 877	61 022	67 400
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	300	10 897	8 559	Total de la Nouvelle-Zélande	179 790	314 432	
Mixi, Inc.	2 500	92 034	60 061	Norvège – 2,3 %			
MonotaRO Co., Ltd.	1 000	35 537	54 538	Borregaard ASA	1 276	15 818	18 411
Murata Manufacturing Co., Ltd.	8 800	592 322	701 683	Grieg Seafood ASA	2 607	38 462	36 236
Nidec Corp.	2 822	274 299	256 368	Mowi ASA	16 644	514 972	429 203
Nihon M&A Center, Inc.	1 100	45 225	67 630	Telenor ASA	42 162	1 172 816	833 958
Nintendo Co., Ltd.	1 900	918 440	1 151 599	Total de la Norvège	1 742 068	1 317 808	
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	300	29 324	33 215	Portugal – 0,5 %			
Nissan Chemical Corp.	1 651	101 877	115 054	Altri, SGPS, S.A.	6 691	78 349	43 685
Obic Co., Ltd.	700	114 822	166 758	Jeronimo Martins, SGPS, S.A.	9 081	196 871	216 499
Open House Co., Ltd.	2 000	67 149	93 169	Total Portugal	275 220	260 184	
Oracle Corp.	1 400	151 868	224 818	Singapour – 0,6 %			
Outsourcing, Inc.	2 400	26 986	20 603	SATS Ltd.	23 700	120 101	66 176
Pigeon Corp.	1 340	74 608	70 544	Sheng Siong Group Ltd.	31 700	34 349	51 066
Pilot Corp.	500	28 981	20 673	Singapore Technologies Engineering Ltd.	73 700	290 866	237 448
Recruit Holdings Co., Ltd.	8 700	378 292	404 407	Total de Singapour	445 316	354 690	
Relo Group, Inc.	1 000	34 742	25 603	Espagne – 4,7 %			
Round One Corp.	1 400	17 678	13 768	Cie Automotive S.A.	2 381	89 216	56 893
SCSK Corp.	1 200	79 741	79 383				
Seria Co., Ltd.	1 000	41 242	48 415				
Shimano, Inc.	600	116 802	157 176				
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	5 900	726 749	938 137				
Shionogi & Co., Ltd.	3 100	234 414	264 169				
Showa Denko K.K.	3 700	140 059	112 853				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Ence Energia y Celulosa S.A.	10 140	52 504	45 200	John Laing Group PLC	5 327	28 870	31 233
Faes Farma S.A.	5 544	32 407	30 701	Moneysupermarket.com Group PLC	7 536	42 782	41 040
Grifols S.A.	4 519	175 049	186 854	NMC Health PLC	698	39 860	–
Industria de Diseno Textil S.A	65 878	2 749 823	2 375 280	RELXPLC	17 452	507 094	549 214
Prosegur Cash S.A.	37 314	116 619	42 696	Rio Tinto PLC	27 733	2 148 446	2 123 088
Total de l'Espagne		3 215 618	2 737 624	Rotork PLC	8 417	46 871	39 662
Suède – 1,8 %				Safestore Holdings PLC	2 570	28 376	31 400
AAK AB	1 622	40 181	37 963	Spirax-Sarco Engineering PLC	359	39 787	60 271
AddTech AB	864	29 071	47 290	SSP Group PLC	4 641	32 259	20 088
Atlas Copco AB	6 198	277 756	312 237	Unilever N.V.	31 811	2 526 674	2 299 291
Beijer Ref AB	1 003	25 447	41 261	Unilever PLC	15 552	1 262 904	1 139 802
Epiroc AB	8 878	122 719	149 803	Total du Royaume-Uni		12 538 417	11 149 036
Evolution Gaming Group AB	1 579	35 559	128 251	Commissions et autres coûts de			
Fagerhult AB	3 469	38 178	17 471	transaction du portefeuille (note 2)		(70 393)	
Hexpol AB	6 518	82 387	65 748	TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES		53 907 978	57 617 547
Lifco AB	486	25 674	41 918	TITRES – 99,4 %			
Loomis AB	1 453	64 599	47 283	Contrats de change (annexe 1) – 0,3 %			164 703
Mycronic AB	1 457	24 093	37 424	Autres actifs en excédent du			
Paradox Interactive AB	833	21 812	24 477	passif – 0,3 %			179 676
Sectra AB	281	14 276	21 772	ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE			
Sweco AB	1 407	46 938	86 060	PARTS RACHETABLES – 100,0 %			57 961 926 \$
Total de la Suède		848 690	1 058 958	INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS			
Suisse – 8,3 %				ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE			
Givaudan S.A.	131	511 971	664 316				
Kuehne + Nagel International AG	3 460	697 733	782 809				
Logitech International S.A.	2 123	117 013	188 771				
Partners Group Holding AG	518	515 292	639 882				
Roche Holding AG	2 730	1 062 959	1 275 325				
Schindler Holding AG	1 356	400 855	434 888				
SFS Group AG	595	67 451	75 860				
SGS S.A.	144	500 747	479 169				
Sonova Holding AG	461	110 153	125 338				
Straumann Holding AG	61	59 849	71 372				
Temenos AG	214	38 333	45 264				
Total de la Suisse		4 082 356	4 782 994				
Royaume-Uni – 19,2 %							
Abcam PLC	1 217	27 548	27 301				
Ashmore Group PLC	12 141	99 450	85 242				
Ashtead Group PLC	4 077	154 071	186 554				
Brewin Dolphin Holdings PLC	9 096	45 434	39 876				
British American Tobacco PLC	45 948	3 007 451	2 400 565				
Craneware PLC	96	4 650	2 754				
Cranwick PLC	456	26 804	27 764				
Croda International PLC	955	79 645	84 472				
Diageo PLC	23 844	1 162 399	1 076 000				
Diversified Gas & Oil PLC	17 926	33 761	28 961				
Electrocomponents PLC	4 415	49 026	49 855				
Evraz PLC	69 312	687 251	336 402				
Ferrexpo PLC	7 797	32 868	22 753				
Fevertree Drinks PLC	300	14 276	10 330				
Games Workshop Group PLC	388	26 503	52 335				
Gamma Communications PLC	606	12 506	13 105				
Halma PLC	1 324	45 018	51 314				
Hargreaves Lansdown PLC	4 472	144 684	122 559				
HomeServe PLC	2 454	38 988	53 894				
Intertek Group PLC	1 325	124 900	121 303				
James Halstead PLC	2 364	17 261	20 608				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *	Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	57 772 CAD	37 499 EUR	(409)\$	A+	7/3/2020	271 613 CAD	1 545 570 HKD	(7)\$	A+
7/2/2020	95 176 CAD	651 076 SEK	5	A+	7/3/2020	271 613 CAD	1 545 578 HKD	(6)	A+
7/2/2020	97 634 HKD	17 257 CAD	99	A+	7/3/2020	7 306 939 HKD	1 300 716 CAD	16 655	A+
7/2/2020	123 939 CAD	877 856 NOK	—	A+	8/4/2020	30 437 ILS	11 986 CAD	—	A+
7/2/2020	124 918 CAD	854 509 SEK	3	A+	8/4/2020	31 564 NZD	27 673 CAD	(1)	A+
7/2/2020	124 918 CAD	854 534 SEK	6	A+	8/4/2020	36 031 SGD	35 172 CAD	(5)	A+
7/2/2020	124 918 CAD	854 514 SEK	3	A+	8/4/2020	39 919 ILS	15 727 CAD	7	A+
7/2/2020	124 918 CAD	854 466 SEK	(4)	A+	8/4/2020	39 932 ILS	15 727 CAD	2	A+
7/2/2020	162 668 CAD	1 152 114 NOK	(8)	A+	8/4/2020	39 936 ILS	15 727 CAD	—	A+
7/2/2020	162 668 CAD	1 152 137 NOK	(5)	A+	8/4/2020	39 936 ILS	15 727 CAD	—	A+
7/2/2020	162 668 CAD	1 152 143 NOK	(4)	A+	8/4/2020	41 419 NZD	36 315 CAD	—	A+
7/2/2020	162 668 CAD	1 152 150 NOK	(3)	A+	8/4/2020	41 419 NZD	36 315 CAD	1	A+
7/2/2020	184 964 NZD	157 799 CAD	4 375	A+	8/4/2020	41 420 NZD	36 315 CAD	(1)	A+
7/2/2020	196 976 CAD	210 055 AUD	—	A+	8/4/2020	41 420 NZD	36 315 CAD	—	A+
7/2/2020	217 372 SGD	212 213 CAD	(9)	A+	8/4/2020	47 281 SGD	46 159 CAD	(1)	A+
7/2/2020	221 344 ILS	87 109 CAD	3	A+	8/4/2020	47 282 SGD	46 159 CAD	(2)	A+
7/2/2020	258 525 CAD	275 682 AUD	(8)	A+	8/4/2020	47 286 SGD	46 159 CAD	(6)	A+
7/2/2020	258 525 CAD	275 682 AUD	(8)	A+	8/4/2020	47 286 SGD	46 159 CAD	(5)	A+
7/2/2020	258 525 CAD	275 684 AUD	(6)	A+	8/4/2020	303 431 CHF	436 485 CAD	(36)	A+
7/2/2020	258 525 CAD	275 684 AUD	(6)	A+	8/4/2020	398 217 CHF	572 884 CAD	2	A+
7/2/2020	425 496 CAD	296 035 CHF	22	A+	8/4/2020	398 220 CHF	572 884 CAD	(2)	A+
7/2/2020	440 945 CAD	2 148 377 DKK	—	A+	8/4/2020	398 232 CHF	572 884 CAD	(18)	A+
7/2/2020	558 458 CAD	388 522 CHF	—	A+	8/4/2020	398 235 CHF	572 884 CAD	(23)	A+
7/2/2020	558 458 CAD	388 533 CHF	16	A+	8/4/2020	490 927 GBP	826 238 CAD	(38)	A+
7/2/2020	558 458 CAD	388 526 CHF	7	A+	8/4/2020	644 296 GBP	1 084 437 CAD	27	A+
7/2/2020	558 458 CAD	388 536 CHF	20	A+	8/4/2020	644 298 GBP	1 084 437 CAD	23	A+
7/2/2020	578 737 CAD	2 819 588 DKK	(29)	A+	8/4/2020	644 300 GBP	1 084 437 CAD	20	A+
7/2/2020	578 737 CAD	2 819 728 DKK	—	A+	8/4/2020	644 314 GBP	1 084 437 CAD	(4)	A+
7/2/2020	578 737 CAD	2 819 644 DKK	(17)	A+	8/4/2020	671 387 SEK	98 174 CAD	(6)	A+
7/2/2020	578 737 CAD	2 819 653 DKK	(15)	A+	8/4/2020	852 061 NOK	120 299 CAD	(2)	A+
7/2/2020	846 054 CAD	502 740 GBP	1	A+	8/4/2020	881 086 SEK	128 850 CAD	5	A+
7/2/2020	1 110 440 CAD	659 818 GBP	(40)	A+	8/4/2020	881 135 SEK	128 850 CAD	(2)	A+
7/2/2020	1 110 440 CAD	659 842 GBP	1	A+	8/4/2020	881 141 SEK	128 850 CAD	(3)	A+
7/2/2020	1 110 440 CAD	659 818 GBP	(41)	A+	8/4/2020	881 187 SEK	128 850 CAD	(10)	A+
7/2/2020	1 110 440 CAD	659 824 GBP	(30)	A+	8/4/2020	1 082 868 EUR	1 657 410 CAD	(91)	A+
7/2/2020	1 194 784 CAD	94 644 456 JPY	60	A+	8/4/2020	1 118 261 NOK	157 891 CAD	5	A+
7/2/2020	1 351 607 AUD	1 238 042 CAD	(29 409)	A+	8/4/2020	1 118 284 NOK	157 891 CAD	2	A+
7/2/2020	1 568 153 CAD	124 217 319 JPY	35	A+	8/4/2020	1 118 288 NOK	157 891 CAD	2	A+
7/2/2020	1 568 153 CAD	124 218 103 JPY	45	A+	8/4/2020	1 118 296 NOK	157 891 CAD	—	A+
7/2/2020	1 568 153 CAD	124 210 733 JPY	(48)	A+	8/4/2020	1 168 671 HKD	205 315 CAD	(11)	A+
7/2/2020	1 568 153 CAD	124 217 633 JPY	39	A+	8/4/2020	1 421 172 EUR	2 175 349 CAD	22	A+
7/2/2020	1 633 489 CAD	1 067 881 EUR	82	A+	8/4/2020	1 421 184 EUR	2 175 349 CAD	3	A+
7/2/2020	1 861 465 CHF	2 674 376 CAD	(1 277)	A+	8/4/2020	1 421 188 EUR	2 175 349 CAD	(4)	A+
7/2/2020	2 143 950 CAD	1 401 540 EUR	29	A+	8/4/2020	1 421 193 EUR	2 175 349 CAD	(11)	A+
7/2/2020	2 143 950 CAD	1 401 531 EUR	15	A+	8/4/2020	1 533 772 HKD	269 472 CAD	1	A+
7/2/2020	2 143 950 CAD	1 401 545 EUR	36	A+	8/4/2020	1 533 819 HKD	269 472 CAD	(8)	A+
7/2/2020	2 143 950 CAD	1 401 522 EUR	—	A+	8/4/2020	1 533 934 HKD	269 472 CAD	(28)	A+
7/2/2020	3 130 255 GBP	5 317 736 CAD	49 868	A+	8/4/2020	1 534 034 HKD	269 472 CAD	(46)	A+
7/2/2020	4 087 967 SEK	598 214 CAD	595	A+	8/4/2020	2 140 281 DKK	439 527 CAD	1	A+
7/2/2020	4 621 576 JPY	58 776 CAD	431	A+	8/4/2020	2 809 009 DKK	576 878 CAD	22	A+
7/2/2020	5 496 091 NOK	778 994 CAD	3 035	A+	8/4/2020	2 809 103 DKK	576 878 CAD	3	A+
7/2/2020	6 701 181 EUR	10 267 061 CAD	16 060	A+	8/4/2020	2 809 113 DKK	576 878 CAD	1	A+
7/2/2020	13 482 181 DKK	2 771 488 CAD	4 329	A+	8/4/2020	2 809 161 DKK	576 878 CAD	(9)	A+
7/2/2020	586 183 159 JPY	7 509 652 CAD	109 351	A+	8/4/2020	97 565 256 JPY	1 231 967 CAD	(127)	A+
7/3/2020	7 319 CAD	41 407 HKD	(42)	A+	8/4/2020	128 040 604 JPY	1 616 954 CAD	5	A+
7/3/2020	206 945 CAD	1 177 583 HKD	(6)	A+	8/4/2020	128 043 191 JPY	1 616 954 CAD	(27)	A+
7/3/2020	271 613 CAD	1 545 548 HKD	(11)	A+	8/4/2020	128 044 485 JPY	1 616 954 CAD	(44)	A+
7/3/2020	271 613 CAD	1 545 568 HKD	(8)	A+	8/4/2020	128 044 970 JPY	1 616 954 CAD	(50)	A+

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
8/5/2020	209 969 AUD	196 908 CAD	(4)\$	A+
8/5/2020	275 566 AUD	258 438 CAD	7	A+
8/5/2020	275 570 AUD	258 438 CAD	3	A+
8/5/2020	275 575 AUD	258 438 CAD	(2)	A+
8/5/2020	275 575 AUD	258 438 CAD	(1)	A+
164 703 \$				

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVISES

AUD	Dollar australien
CHF	Franc suisse
DKK	Couronne danoise
EUR	Euro
GBP	Livre sterling
HKD	Dollar de Hong Kong
ILS	Nouveau shekel israélien
JPY	Yen japonais
NOK	Couronne norvégienne
NZD	Dollar néo-zélandais
SEK	Couronne suédoise
SGD	Dollar de Singapour

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	19 354 823 \$	23 003 419 \$
Trésorerie	39 469	19 792
Plus-value latente des contrats de change	60 381	118 178
Créances :		
Titres de placement vendus	83 764	—
Dividendes	26 750	22 205
Remboursements au titre de l'impôt étranger	42 032	38 108
Total de l'actif	19 607 219	23 201 702
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	13 928	37 177
Créditeurs :		
Distributions	112 000	158 400
Frais de gestion	2 486	5 455
Total du passif	128 414	201 032
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	19 478 805 \$	23 000 670 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	19 478 805	23 000 670
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	800 000	900 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	24,35 \$	25,56 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	284 174 \$	347 295 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(217 835)	(1 804 042)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(89 648)	3 112 456
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(23 309)	1 655 709
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(623 179)	(280 318)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(34 548)	1 018 188
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(657 727)	737 870
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(681 036)	2 393 579
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(9 082)	(27 487)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	1 374	(4 759)
Total des autres revenus (pertes)	(7 708)	(32 246)
Total des revenus (pertes)	(688 744)	2 361 333
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	68 439	61 634
Retenues d'impôt étranger	28 854	39 056
Coûts de transaction (note 2)	3 169	33 111
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	545	582
Total des charges	101 007	134 383
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(545)	(582)
Charges nettes	100 462	133 801
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(789 206)\$	2 227 532 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	814 835	782 873
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	(0,97)\$	2,85 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	23 000 670 \$	24 406 937 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(789 206)	2 227 532
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(164 000)	(135 000)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(164 000)	(135 000)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	—	8 947 885
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(2 568 659)	(14 447 525)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(2 568 659)	(5 499 640)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	19 478 805 \$	20 999 829 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(789 206)\$	2 227 532 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	217 835	1 804 042
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	89 648	(3 112 456)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	34 548	(1 018 188)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(1 374)	4 759
Achat de placements ¹	(1 578 014)	(15 817 046)
Produit de la vente de placements ¹	4 919 127	17 655 932
Variation des créances	(92 233)	563 155
Variation des créditeurs	(2 969)	83 133
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	2 797 362	2 390 863
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	–	4 373 166
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(2 568 659)	(6 537 788)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(210 400)	(283 500)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(2 779 059)	(2 448 122)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	1 374	(4 759)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	19 677 \$	(62 018)\$
Trésorerie au début de la période	19 792 \$	82 759 \$
Trésorerie à la fin de la période	39 469 \$	20 741 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	246 851 \$	296 184 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %							
Australie – 3,8 %							
Altium Ltd.	239	6 496	7 279	Wartsila Oyj Abp	4 688	98 947	52 767
Appen Ltd.	113	2 672	3 594	Total de la Finlande		607 276	636 156
ARB Corp., Ltd.	455	8 007	7 659	France – 4,8 %			
Aristocrat Leisure Ltd.	2 170	52 605	51 890	Cie Plastic Omnium S.A.	1 101	36 807	30 535
Beach Energy Ltd.	5 078	9 283	7 238	Gaztransport & Technigaz S.A.	299	38 413	31 057
BlueScope Steel Ltd.	1 604	17 357	17 583	Hermès International	171	141 279	194 566
carsales.com Ltd.	1 816	23 237	30 210	Ipsen S.A.	165	26 526	19 094
Computershare Ltd.	2 901	49 164	36 045	Kering S.A.	587	452 402	434 833
Corporate Travel Management Ltd.	369	8 800	3 353	Rubis SCA	662	47 407	43 323
CSL Ltd.	1 143	215 857	307 616	Sartorius Stedim Biotech	88	18 901	30 289
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	535	23 985	34 461	Teleperformance	141	38 565	48 725
IDP Education Ltd.	529	8 740	7 684	Trigano S.A.	110	14 700	15 691
Invocare Ltd.	692	7 546	6 800	Valeo S.A.	2 606	124 870	93 124
Magellan Financial Group Ltd.	1 330	41 490	72 349	Total de la France		939 870	941 237
NIB Holdings Ltd.	2 739	18 935	11 840	Allemagne – 7,6 %			
Northern Star Resources Ltd.	1 626	12 999	20 371	Bechtle AG	100	13 292	24 017
Pendal Group Ltd.	4 414	37 749	24 711	CANCOM SE	83	5 257	5 993
Reece Ltd.	2 664	27 203	22 958	Dermapharm Holding SE	259	12 392	17 546
Regis Resources Ltd.	4 221	18 029	20 662	Deutsche Wohnen SE	1 641	83 325	100 286
St Barbara Ltd.	5 535	14 449	16 350	Fuchs Petrolub SE	437	24 339	20 055
Technology One Ltd.	951	5 590	7 839	Hochtief AG	701	111 406	84 661
Viva Energy Group Ltd.	8 500	15 861	14 507	Infinion Technologies AG	4 769	111 322	152 289
Webjet Ltd.	748	5 494	2 329	MTU Aero Engines AG	156	49 047	36 786
Total de l'Australie		631 548	735 328	Nemetschek SE	153	11 849	14 324
Autriche – 0,0 %				SAP SE	3 536	622 707	672 462
S IMMO AG	268	7 921	6 543	Siemens Healthineers AG	4 099	234 799	267 431
Chine – 2,5 %				Siltronic AG	580	66 897	80 544
Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co., Ltd.	4 000	7 896	7 338	Total de l'Allemagne		1 346 632	1 476 394
China Overseas Land & Investment Ltd.	73 500	337 350	302 887	Hong Kong – 0,5 %			
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	26 800	58 369	68 949	Melco International Development Ltd.	1 700	5 116	4 481
Guangdong Investment Ltd.	42 000	113 436	98 164	Techtronic Industries Co., Ltd.	7 000	61 605	93 243
Total de la Chine		517 051	477 338	Vitasoy International Holdings Ltd.	1 100	5 690	5 732
Danemark – 8,2 %				Total de Hong Kong		72 411	103 456
Ambu A/S	212	7 302	9 068	Indonésie – 0,1 %			
Chr Hansen Holding A/S	258	31 632	36 220	First Resources Ltd.	6 500	10 629	8 821
Coloplast A/S	927	130 663	195 590	Irlande – 0,2 %			
DSV Panalpina A/S	139	14 700	23 103	Hibernia REIT PLC	3 768	7 588	6 456
GN Store Nord A/S	124	6 954	8 994	Kerry Group PLC	242	38 703	40 832
Novo Nordisk A/S	9 988	672 891	880 267	Total de l'Irlande		46 291	47 288
Novozymes A/S	879	53 985	69 187	Israël – 0,2 %			
Orsted A/S	1 554	176 788	244 126	ICL Group Ltd.	10 239	71 483	41 342
Rockwool International A/S	38	14 193	14 000	Italie – 1,1 %			
Royal Unibrew A/S	237	22 839	26 841	Brunello Cucinelli SpA	144	7 373	5 824
SimCorp A/S	89	9 413	13 061	DiaSorin SpA	105	14 679	27 370
Vestas Wind Systems A/S	579	69 084	80 263	Ferrari N.V.	309	54 621	71 778
Total du Danemark		1 210 444	1 600 720	Interpump Group SpA	182	7 688	7 361
Finlande – 3,3 %				RAI WaySpA	2 915	21 974	26 086
Kone Oyj	3 224	252 025	301 928	Recordati SpA	1 105	58 512	75 136
Metsa Board Oyj	4 448	31 097	40 961	Reply SpA	58	5 120	6 375
Neste Oyj	3 556	144 259	189 357	Total de l'Italie		169 967	219 930
Nokian Renkaat Oyj	1 711	80 948	51 143	Japon – 23,2 %			
				Advantest Corp.	1 400	58 899	108 167

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Ain Holdings, Inc.	100	7 663	8 913	SCSK Corp.	400	26 473	26 461
Asahi Intecc Co., Ltd.	200	5 869	7 739	Seria Co., Ltd.	200	8 310	9 683
Astellas Pharma, Inc.	11 437	239 735	259 824	Shimano, Inc.	250	49 949	65 490
Bandai Namco Holdings, Inc.	1 200	79 390	85 852	Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	2 000	244 437	318 013
Benefit One, Inc.	500	11 333	13 666	Shionogi & Co., Ltd.	1 000	75 537	85 216
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	4 200	118 646	305 678	Showa Denko K.K.	1 200	46 990	36 601
Daifuku Co., Ltd.	400	29 044	47 569	SMS Co., Ltd.	70	1 724	2 136
Daito Trust Construction Co., Ltd.	700	119 718	87 568	Systemex Corp.	375	31 824	38 963
Digital Arts, Inc.	100	12 194	10 983	Systema Corp.	300	5 456	5 382
Disco Corp.	100	21 954	32 937	TechnoPro Holdings, Inc.	200	12 132	15 528
Elecom Co., Ltd.	300	11 231	19 922	Toei Animation Co., Ltd.	200	11 341	12 700
en-japan, Inc.	200	5 583	6 706	Tokai Carbon Co., Ltd.	1 000	13 793	12 763
Fast Retailing Co., Ltd.	200	162 340	155 787	Tokuyama Corp.	500	15 731	15 983
Funai Soken Holdings, Inc.	200	5 941	6 123	Tokyo Electron Ltd	1 775	376 893	592 483
GMO Payment Gateway, Inc.	70	5 595	9 933	Tosho Co., Ltd.	200	4 609	3 222
Harmonic Drive Systems, Inc.	200	11 115	14 922	Trend Micro, Inc.	1 100	74 706	83 600
Haseko Corp.	4 600	71 373	78 863	Ulvac, Inc.	600	23 911	23 557
Hikari Tsushin, Inc.	100	22 053	30 993	United Arrows Ltd.	300	6 536	6 901
Hoya Corp.	900	76 443	116 575	USS Co., Ltd.	2 000	49 204	43 504
Infocom Corp.	100	2 983	3 724	Workman Co., Ltd.	100	7 772	11 955
Japan Lifeline Co., Ltd.	500	11 068	8 982	ZOZO, Inc.	900	23 155	27 224
Japan Material Co., Ltd.	200	4 482	4 267	Total du Japon		3 612 586	4 515 100
JINS Holdings, Inc.	25	1 824	2 067	Kazakhstan – 0,1 %			
Kakaku.com, Inc.	900	24 216	31 007	KAZ Minerals PLC	1 341	12 454	11 284
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	300	20 134	20 868	Macao – 0,8 %			
Kao Corp.	1 700	176 465	183 283	Galaxy Entertainment Group Ltd.	17 000	156 136	157 587
Keyence Corp.	150	58 005	85 273	Mexique – 0,2 %			
Kobe Bussan Co., Ltd.	200	8 763	15 351	Fresnillo PLC	2 784	39 485	39 421
Konami Holdings Corp.	800	49 559	36 258	Pays-Bas – 4,9 %			
Kose Corp.	100	21 797	16 361	ASM International N.V.	238	22 619	50 079
Koshidaka Holdings Co., Ltd.	400	3 135	2 101	ASML Holding N.V.	1 164	303 144	582 080
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	150	9 687	8 361	Corbion N.V.	190	8 062	9 315
Kusuri no Aoki Holdings Co., Ltd.	100	10 797	10 680	Euronext N.V.	389	40 344	53 110
Lasertec Corp.	300	22 932	38 480	Koninklijke DSM N.V.	840	135 707	158 309
M3, Inc.	400	10 972	23 153	TKH Group N.V.	160	6 792	8 586
Mani, Inc.	200	6 048	7 183	Wolters Kluwer N.V.	901	87 380	95 818
Maruwa Unyu Kikan Co., Ltd.	200	6 129	7 638	Total des Pays-Bas		604 048	957 297
McDonald's Holdings Co., Japan Ltd.	300	19 109	22 043	Nouvelle-Zélande – 0,5 %			
Meitec Corp.	250	14 887	16 380	Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	2 209	30 378	68 951
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	200	7 301	5 706	Mainfreight Ltd.	394	10 710	13 611
Mixi, Inc.	1 300	38 129	31 232	Ryman Healthcare Ltd.	1 997	20 732	22 902
MonotaRO Co., Ltd.	300	10 669	16 361	Total de la Nouvelle-Zélande		61 820	105 464
Murata Manufacturing Co., Ltd.	2 950	198 489	235 223	Norvège – 2,3 %			
Nidec Corp.	900	74 124	81 762	Borregaard ASA	627	8 254	9 047
Nihon M&A Center, Inc.	300	10 937	18 445	Grieg Seafood ASA	879	13 771	12 218
Nintendo Co., Ltd.	600	285 554	363 663	Mowi ASA	5 316	165 883	137 085
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	200	19 360	22 144	Telenor ASA	14 367	396 853	284 177
Nissan Chemical Corp.	400	23 273	27 875	Total de la Norvège		584 761	442 527
Obic Co., Ltd.	200	29 717	47 645	Portugal – 0,4 %			
Open House Co., Ltd.	600	18 180	27 951	Altri, SGPS, S.A.	1 990	22 976	12 992
Oracle Corp.	400	40 613	64 234	Jeronimo Martins, SGPS, S.A.	3 006	64 602	71 666
Outsourcing, Inc.	400	6 277	3 434	Total Portugal		87 578	84 658
Pigeon Corp.	400	21 965	21 058				
Pilot Corp.	300	17 475	12 404				
Recruit Holdings Co., Ltd.	2 900	125 148	134 803				
Relo Group, Inc.	300	10 730	7 681				
Round One Corp.	400	5 051	3 934				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	
Singapour – 0,6 %				Evraz PLC				
SATS Ltd.	8 000	40 874	22 338	Ferrexpo PLC	2 650	11 166	7 733	
Sheng Siong Group Ltd.	9 100	9 822	14 659	Fevertree Drinks PLC	144	3 216	4 958	
Singapore Technologies Engineering Ltd.	25 000	100 091	80 546	Games Workshop Group PLC	116	6 658	15 646	
Total de Singapour		150 787	117 543	Gamma Communications PLC	125	2 593	2 703	
Espagne – 4,7 %				Halma PLC	564	19 202	21 859	
Cie Automotive S.A.	658	20 897	15 723	Hargreaves Lansdown PLC	1 626	49 082	44 562	
Ence Energia y Celulosa S.A.	3 463	19 368	15 437	HomeServe PLC	921	16 144	20 227	
Faes Farma S.A.	1 788	10 091	9 901	Intertek Group PLC	431	39 885	39 458	
Grifols S.A.	1 622	63 060	67 067	James Halstead PLC	804	6 161	7 009	
Industria de Diseno Textil S.A.	22 181	903 859	799 753	John Laing Group PLC	1 942	11 246	11 386	
Prosegur Cash S.A.	12 675	36 972	14 503	Moneysupermarket.com Group PLC	2 067	11 740	11 257	
Total de l'Espagne		1 054 247	922 384	NMC Health PLC	237	12 528	–	
Suède – 1,9 %				RELXPLC	5 970	172 150	187 876	
AAK AB	587	14 501	13 739	Rio Tinto PLC	9 305	716 793	712 340	
AddTech AB	197	5 832	10 782	Rotork PLC	3 250	16 256	15 314	
Atlas Copco AB	2 197	78 906	110 678	Safestore Holdings PLC	803	8 762	9 811	
Beijer Ref AB	341	8 266	14 028	Spirax-Sarco Engineering PLC	129	15 222	21 657	
Epiroc AB	3 294	45 386	55 608	SSP Group PLC	972	6 559	4 207	
Evolution Gaming Group AB	507	9 933	41 180	Unilever N.V.	10 623	847 967	767 828	
Fagerhult AB	1 179	12 446	5 938	Unilever PLC	5 139	420 032	376 636	
Hexpol AB	2 211	27 108	22 302	Total du Royaume-Uni		4 087 369	3 739 758	
Lifco AB	166	8 505	14 318	Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)		(21 229)		
Loomis AB	437	20 734	14 221	TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES – 99,4 %		17 689 581	19 354 823	
Mycronic AB	496	8 610	12 740	Contrats de change (annexe 1) – 0,2 %			46 453	
Paradox Interactive AB	273	6 166	8 022	Autres actifs en excédent du passif – 0,4 %			77 529	
Sectra AB	95	4 763	7 361	ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			19 478 805 \$	
Sweco AB	499	16 399	30 522	INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS				
Total de la Suède		267 555	361 439	ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE				
Suisse – 8,3 %				Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
Givaudan S.A.	44	169 653	223 129	7/2/2020	145 CAD	365 ILS	(1)\$	A+
Kuehne + Nagel International AG	1 141	220 309	258 146	7/2/2020	263 CAD	300 NZD	–	A+
Logitech International S.A.	701	37 414	62 331	7/2/2020	354 CAD	360 SGD	(2)	A+
Partners Group Holding AG	181	168 084	223 588	7/2/2020	998 CAD	6 785 SEK	(6)	A+
Roche Holding AG	930	361 705	434 452	7/2/2020	2 599 CAD	18 396 NOK	(2)	A+
Schindler Holding AG	433	127 057	138 868	7/2/2020	2 753 CAD	2 932 AUD	(3)	A+
SFS Group AG	185	21 040	23 587	7/2/2020	4 083 CAD	10 375 ILS	–	A+
SGS S.A.	49	166 209	163 050	7/2/2020	4 623 CAD	22 364 DKK	(33)	A+
Sonova Holding AG	155	37 718	42 142	7/2/2020	5 098 CHF	7 352 CAD	24	A+
Straumann Holding AG	20	19 387	23 401	7/2/2020	5 356 CAD	13 609 ILS	–	A+
Temenos AG	62	10 656	13 114	7/2/2020	5 356 CAD	13 609 ILS	–	A+
Total de la Suisse		1 339 232	1 605 808	7/2/2020	5 356 CAD	13 610 ILS	–	A+
Royaume-Uni – 19,2 %				7/2/2020	5 948 CAD	4 124 CHF	(20)	A+
Abcam PLC	338	6 620	7 582	7/2/2020	7 394 CAD	8 433 NZD	–	A+
Ashmore Group PLC	4 202	33 720	29 502	7/2/2020	8 870 CAD	5 278 GBP	12	A+
Ashtead Group PLC	1 411	47 308	64 564	7/2/2020	8 981 GBP	15 093 CAD	(21)	A+
Brewin Dolphin Holdings PLC	2 286	11 541	10 022	7/2/2020	9 703 CAD	11 066 NZD	–	A+
British American Tobacco PLC	15 394	899 438	804 263	7/2/2020	9 703 CAD	11 066 NZD	–	A+
Craneware PLC	37	1 276	1 062					
Cranswick PLC	171	9 103	10 412					
Croda International PLC	335	27 635	29 632					
Diageo PLC	7 864	393 010	354 876					
Diversified Gas & Oil PLC	6 090	11 509	9 839					
Electrocomponents PLC	1 791	18 628	20 224					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *	Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	9 703 CAD	11 066 NZD	– \$	A+	7/2/2020	730 888 CHF	1 050 070 CAD	(501)\$	A+
7/2/2020	9 703 CAD	11 066 NZD	–	A+	7/2/2020	921 796 GBP	1 565 964 CAD	14 685	A+
7/2/2020	9 946 CAD	10 188 SGD	1	A+	7/2/2020	1 192 761 JPY	15 169 CAD	111	A+
7/2/2020	12 526 CAD	984 909 JPY	(92)	A+	7/2/2020	1 203 824 SEK	176 162 CAD	175	A+
7/2/2020	13 048 CAD	13 365 SGD	–	A+	7/2/2020	1 973 360 EUR	3 023 438 CAD	4 729	A+
7/2/2020	13 048 CAD	13 365 SGD	1	A+	7/2/2020	3 236 968 NOK	458 795 CAD	1 788	A+
7/2/2020	13 048 CAD	13 365 SGD	–	A+	7/2/2020	3 970 224 DKK	816 146 CAD	1 275	A+
7/2/2020	13 048 CAD	13 365 SGD	–	A+	7/2/2020	172 618 879 JPY	2 211 438 CAD	32 202	A+
7/2/2020	15 341 EUR	23 635 CAD	167	A+	7/3/2020	2 170 CAD	12 277 HKD	(13)	A+
7/2/2020	15 501 NOK	2 190 CAD	1	A+	7/3/2020	60 940 CAD	346 768 HKD	(2)	A+
7/2/2020	17 125 CAD	11 116 EUR	(121)	A+	7/3/2020	79 981 CAD	455 112 HKD	(3)	A+
7/2/2020	24 781 DKK	5 122 CAD	36	A+	7/3/2020	79 981 CAD	455 118 HKD	(2)	A+
7/2/2020	28 028 CAD	191 733 SEK	1	A+	7/3/2020	79 981 CAD	455 119 HKD	(2)	A+
7/2/2020	36 784 CAD	251 623 SEK	1	A+	7/3/2020	79 981 CAD	455 121 HKD	(2)	A+
7/2/2020	36 784 CAD	251 610 SEK	(1)	A+	7/3/2020	2 151 743 HKD	383 034 CAD	4 905	A+
7/2/2020	36 784 CAD	251 631 SEK	2	A+	8/4/2020	3 107 NZD	2 724 CAD	–	A+
7/2/2020	36 784 CAD	251 625 SEK	1	A+	8/4/2020	4 077 NZD	3 575 CAD	–	A+
7/2/2020	54 469 NZD	46 469 CAD	(1 288)	A+	8/4/2020	4 077 NZD	3 575 CAD	–	A+
7/2/2020	64 011 SGD	62 492 CAD	(3)	A+	8/4/2020	4 078 NZD	3 575 CAD	–	A+
7/2/2020	65 182 ILS	25 652 CAD	1	A+	8/4/2020	4 078 NZD	3 575 CAD	–	A+
7/2/2020	72 992 CAD	517 000 NOK	–	A+	8/4/2020	8 995 ILS	3 542 CAD	–	A+
7/2/2020	77 337 CAD	82 472 AUD	–	A+	8/4/2020	10 644 SGD	10 390 CAD	(1)	A+
7/2/2020	88 327 HKD	15 612 CAD	90	A+	8/4/2020	11 787 ILS	4 644 CAD	2	A+
7/2/2020	95 801 CAD	678 521 NOK	(5)	A+	8/4/2020	11 791 ILS	4 644 CAD	–	A+
7/2/2020	95 801 CAD	678 535 NOK	(3)	A+	8/4/2020	11 793 ILS	4 644 CAD	–	A+
7/2/2020	95 801 CAD	678 538 NOK	(2)	A+	8/4/2020	11 793 ILS	4 644 CAD	–	A+
7/2/2020	95 801 CAD	678 542 NOK	(2)	A+	8/4/2020	13 962 SGD	13 631 CAD	–	A+
7/2/2020	101 504 CAD	108 240 AUD	(3)	A+	8/4/2020	13 963 SGD	13 631 CAD	(1)	A+
7/2/2020	101 504 CAD	108 240 AUD	(3)	A+	8/4/2020	13 964 SGD	13 631 CAD	(2)	A+
7/2/2020	101 504 CAD	108 241 AUD	(3)	A+	8/4/2020	13 964 SGD	13 631 CAD	(2)	A+
7/2/2020	101 504 CAD	108 241 AUD	(2)	A+	8/4/2020	115 049 HKD	20 212 CAD	(1)	A+
7/2/2020	129 847 CAD	632 642 DKK	–	A+	8/4/2020	119 479 CHF	171 870 CAD	(14)	A+
7/2/2020	167 062 CAD	116 232 CHF	8	A+	8/4/2020	144 981 GBP	244 006 CAD	(11)	A+
7/2/2020	170 419 CAD	830 292 DKK	(5)	A+	8/4/2020	150 986 HKD	26 527 CAD	–	A+
7/2/2020	170 419 CAD	830 276 DKK	(9)	A+	8/4/2020	150 990 HKD	26 527 CAD	(1)	A+
7/2/2020	170 419 CAD	830 295 DKK	(5)	A+	8/4/2020	151 002 HKD	26 527 CAD	(3)	A+
7/2/2020	170 419 CAD	830 317 DKK	–	A+	8/4/2020	151 011 HKD	26 527 CAD	(4)	A+
7/2/2020	219 265 CAD	152 546 CHF	3	A+	8/4/2020	156 802 CHF	225 579 CAD	1	A+
7/2/2020	219 265 CAD	152 548 CHF	6	A+	8/4/2020	156 803 CHF	225 579 CAD	(1)	A+
7/2/2020	219 265 CAD	152 544 CHF	–	A+	8/4/2020	156 808 CHF	225 579 CAD	(7)	A+
7/2/2020	219 265 CAD	152 549 CHF	8	A+	8/4/2020	156 809 CHF	225 579 CAD	(9)	A+
7/2/2020	249 138 CAD	148 042 GBP	–	A+	8/4/2020	190 272 GBP	320 254 CAD	8	A+
7/2/2020	326 989 CAD	194 302 GBP	–	A+	8/4/2020	190 273 GBP	320 254 CAD	6	A+
7/2/2020	326 989 CAD	194 295 GBP	(12)	A+	8/4/2020	190 273 GBP	320 254 CAD	7	A+
7/2/2020	326 989 CAD	194 297 GBP	(9)	A+	8/4/2020	190 278 GBP	320 254 CAD	(1)	A+
7/2/2020	326 989 CAD	194 295 GBP	(12)	A+	8/4/2020	198 269 SEK	28 992 CAD	(2)	A+
7/2/2020	351 828 CAD	27 869 949 JPY	18	A+	8/4/2020	260 202 SEK	38 052 CAD	1	A+
7/2/2020	461 771 CAD	36 578 035 JPY	10	A+	8/4/2020	260 217 SEK	38 052 CAD	(1)	A+
7/2/2020	461 771 CAD	36 578 127 JPY	12	A+	8/4/2020	260 219 SEK	38 052 CAD	(1)	A+
7/2/2020	461 771 CAD	36 578 266 JPY	13	A+	8/4/2020	260 232 SEK	38 052 CAD	(3)	A+
7/2/2020	461 771 CAD	36 576 095 JPY	(14)	A+	8/4/2020	319 792 EUR	489 465 CAD	(27)	A+
7/2/2020	481 013 CAD	314 459 EUR	24	A+	8/4/2020	419 698 EUR	642 421 CAD	6	A+
7/2/2020	530 696 AUD	486 106 CAD	(11 547)	A+	8/4/2020	419 702 EUR	642 421 CAD	1	A+
7/2/2020	631 325 CAD	412 710 EUR	10	A+	8/4/2020	419 703 EUR	642 421 CAD	(1)	A+
7/2/2020	631 325 CAD	412 706 EUR	4	A+	8/4/2020	419 705 EUR	642 421 CAD	(3)	A+
7/2/2020	631 325 CAD	412 709 EUR	8	A+	8/4/2020	503 265 NOK	71 054 CAD	(1)	A+
7/2/2020	631 325 CAD	412 704 EUR	–	A+	8/4/2020	632 082 DKK	129 804 CAD	–	A+

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
8/4/2020	660 484 NOK	93 256 CAD	3 \$	A+
8/4/2020	660 498 NOK	93 256 CAD	1	A+
8/4/2020	660 500 NOK	93 256 CAD	1	A+
8/4/2020	660 505 NOK	93 256 CAD	–	A+
8/4/2020	829 549 DKK	170 362 CAD	7	A+
8/4/2020	829 577 DKK	170 362 CAD	1	A+
8/4/2020	829 579 DKK	170 362 CAD	–	A+
8/4/2020	829 594 DKK	170 362 CAD	(3)	A+
8/4/2020	28 813 090 JPY	363 826 CAD	(37)	A+
8/4/2020	37 812 725 JPY	477 516 CAD	2	A+
8/4/2020	37 813 489 JPY	477 516 CAD	(8)	A+
8/4/2020	37 813 871 JPY	477 516 CAD	(13)	A+
8/4/2020	37 814 014 JPY	477 516 CAD	(15)	A+
8/5/2020	41 341 AUD	38 769 CAD	(1)	A+
8/5/2020	54 252 AUD	50 880 CAD	1	A+
8/5/2020	54 253 AUD	50 880 CAD	1	A+
8/5/2020	54 254 AUD	50 880 CAD	–	A+
8/5/2020	54 254 AUD	50 880 CAD	–	A+
46 453 \$				

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

AUD	Dollar australien
CAD	Dollar canadien
CHF	Franc suisse
DKK	Couronne danoise
EUR	Euro
GBP	Livre sterling
HKD	Dollar de Hong Kong
ILS	Nouveau shekel israélien
JPY	Yen japonais
NOK	Couronne norvégienne
NZD	Dollar néo-zélandais
SEK	Couronne suédoise
SGD	Dollar de Singapour

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	17 471 068 \$	16 991 876 \$
Trésorerie	55 848	5 194
Plus-value latente des contrats de change	69 391	90 268
Créances :		
Titres de placement vendus	—	96 896
Dividendes	47 299	45 072
Total de l'actif	17 643 606	17 229 306
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	283	667
Créditeurs :		
Distributions	68 000	134 300
Frais de gestion	8 699	8 987
Total du passif	76 982	143 954
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	17 566 624 \$	17 085 352 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		
Parts couvertes	4 120 571	4 826 693
Parts non couvertes	13 446 053	12 258 659
	17 566 624 \$	17 085 352 \$
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)		
Parts couvertes	200 000	200 000
Parts non couvertes	600 000	500 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part		
Parts couvertes	20,60 \$	24,13 \$
Parts non couvertes	22,41 \$	24,52 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	266 741 \$	250 516 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(474 806)	(308 136)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(1 166 618)	156 360
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(1 374 683)	98 740
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(215 466)	(316 623)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(20 493)	405 488
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(235 959)	88 865
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(1 610 642)	187 605
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	(30 931)	17 452
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	(347)	(2 440)
Total des autres revenus (pertes)	(31 278)	15 012
Total des revenus (pertes)	(1 641 920)	202 617
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	42 732	39 541
Retenues d'impôt étranger	40 011	37 604
Coûts de transaction (note 2)	985	5 508
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	721	964
Total des charges	84 449	83 617
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(721)	(964)
Charges nettes	83 728	82 653
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 725 648)\$	119 964 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par catégorie		
Parts couvertes	(668 236)	189 922
Parts non couvertes	(1 057 412)	(69 958)
	(1 725 648)\$	119 964 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables		
Parts couvertes	200 000	197 790
Parts non couvertes	510 989	437 017
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part		
Parts couvertes	(3,34)\$	0,96 \$
Parts non couvertes	(2,07)\$	(0,16)\$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	17 085 352 \$	10 946 829 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 725 648)	119 964
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(141 500)	(148 800)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(141 500)	(148 800)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	2 348 420	11 439 385
Sommes versées au rachat de parts rachetables	–	(4 454 620)
Opérations sur parts rachetables, montant net	2 348 420	6 984 765
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	17 566 624 \$	17 902 758 \$
PARTS COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	4 826 693 \$	4 199 581 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(668 236)	189 922
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(38 000)	(43 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(38 000)	(43 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	114	4 461 247
Sommes versées au rachat de parts rachetables	–	(4 455 197)
Opérations sur parts rachetables, montant net	114	6 050
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	4 120 571 \$	4 352 153 \$
PARTS NON COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	12 258 659 \$	6 747 248 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 057 412)	(69 958)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(103 500)	(105 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(103 500)	(105 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	2 348 306	6 978 138
Sommes versées au rachat de parts rachetables	–	577
Opérations sur parts rachetables, montant net	2 348 306	6 978 715
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	13 446 053 \$	13 550 605 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(1 725 648)\$	119 964 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	474 806	308 136
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	1 166 618	(156 360)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	20 493	(405 488)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	347	2 440
Achat de placements ¹	(3 287 226)	(13 713 026)
Produit de la vente de placements ¹	1 166 610	6 837 290
Variation des créances	94 669	164 639
Variation des créditeurs	(288)	2 047
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(2 089 619)	(6 840 358)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	2 348 420	11 439 385
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	—	(4 454 620)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(207 800)	(106 900)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	2 140 620	6 877 865
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	(347)	(2 440)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	50 654 \$	35 067 \$
Trésorerie au début de la période	5 194 \$	4 366 \$
Trésorerie à la fin de la période	55 848 \$	39 433 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	224 503 \$	196 517 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,5 %				Institutions financières – 7,6 %			
Japon – 99,5 %				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 104 400 728 512 555 671			
Fret aérien et logistique – 0,0 %				Mizuho Financial Group, Inc. 216 400 454 828 361 164			
Kintetsu World Express, Inc. 200 3 389 4 704				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 11 000 528 680 421 054			
Composantes d'automobile – 5,5 %				Total institutions financières 1 712 020 1 337 889			
Aisan Industry Co., Ltd. 600 5 515 4 007				Boissons – 1,4 %			
Aisin Seiki Co., Ltd. 2 100 106 331 83 246				Asahi Group Holdings Ltd. 1 700 96 051 81 040			
Bridgestone Corp. 5 200 258 028 227 732				Kirin Holdings Co., Ltd. 3 600 109 369 103 372			
Daido Metal Co., Ltd. 300 2 420 2 068				Suntory Beverage & Food Ltd. 900 50 985 47 778			
Daikyonishikawa Corp. 600 8 047 3 643				Takara Holdings, Inc. 600 9 221 7 302			
Denso Corp. 4 200 247 212 222 962				Total boissons 265 626 239 492			
Eagle Industry Co., Ltd. 300 3 807 2 727				Biotechnologie – 0,0 %			
Exedy Corp. 300 10 506 6 064				Takara Bio, Inc. 100 2 468 3 857			
FCC Co., Ltd. 500 12 922 11 653				Produits de construction – 1,8 %			
Futaba Industrial Co., Ltd. 700 4 804 3 968				AGC, Inc. 1 300 58 447 50 303			
G-Tekt Corp. 200 3 900 2 631				Aica Kogyo Co., Ltd. 300 13 958 13 388			
H-One Co., Ltd. 300 2 881 2 094				Central Glass Co., Ltd. 200 6 175 4 623			
JTEKT Corp. 2 300 36 068 24 304				Daikin Industries Ltd. 600 98 063 131 308			
Kasai Kogyo Co., Ltd. 300 3 214 1 719				LXIL Group Corp. 2 500 51 138 47 532			
Koito Manufacturing Co., Ltd. 500 32 506 27 395				Nitto Boseki Co., Ltd. 100 2 752 6 779			
Musashi Seimitsu Industry Co., Ltd. 600 8 477 7 272				Noritz Corp. 300 4 974 4 969			
NGKSpark Plug Co., Ltd. 1 300 35 171 25 340				Okabe Co., Ltd. 700 7 698 7 185			
NHKSpring Co., Ltd. 1 400 16 827 12 337				Sanwa Holdings Corp. 1 100 16 387 13 359			
Nifco, Inc. 300 10 262 8 707				TOTO Ltd. 700 35 824 36 365			
Nippon Piston Ring Co., Ltd. 100 1 870 1 526				Total produits de construction 295 416 315 811			
NOK Corp. 900 18 455 15 146				Marchés financiers – 0,7 %			
Pacific Industrial Co., Ltd. 300 6 040 3 583				GCA Corp. 600 5 917 4 673			
Piolax, Inc. 200 4 249 4 060				Monex Group, Inc. 800 3 943 2 202			
Press Kogyo Co., Ltd. 800 5 271 2 949				Nomura Holdings, Inc. 10 900 61 432 66 382			
Sanoh Industrial Co., Ltd. 500 3 309 4 255				SBI Holdings, Inc. 1 600 49 471 47 024			
Stanley Electric Co., Ltd. 600 23 585 19 656				Spax Group Co., Ltd. 1 400 4 174 3 818			
Sumitomo Electric Industries Ltd. 4 700 87 520 73 546				Total marchés financiers 124 937 124 099			
Sumitomo Riko Co., Ltd. 800 7 717 6 302				Produits chimiques – 7,7 %			
Sumitomo Rubber Industries Ltd. 2 100 35 869 28 155				ADEKA Corp. 700 14 418 12 611			
T. RAD Co., Ltd. 100 2 303 1 680				Arakawa Chemical Industries Ltd. 100 1 829 1 563			
Tachi-S Co., Ltd. 200 3 370 2 187				Asahi Kasei Corp. 7 400 110 327 81 800			
Taiho Kogyo Co., Ltd. 200 2 102 1 331				Asahi Yukizai Corp. 100 1 744 1 803			
Tokai Rika Co., Ltd. 700 16 911 13 777				Chugoku Marine Paints Ltd. 800 9 121 8 080			
Topre Corp. 300 6 410 4 549				Daicel Corp. 2 000 27 325 21 032			
Toyo Tire Corp. 700 12 651 12 734				Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd. 100 3 617 2 947			
Toyoda Gosei Co., Ltd. 700 20 748 19 813				Denka Co., Ltd. 700 27 624 23 304			
Toyota Boshoku Corp. 1 300 25 650 23 748				DIC Corp. 800 32 560 27 279			
TPR Co., Ltd. 200 4 445 3 383				Fujimi, Inc. 200 5 766 8 370			
TS Tech Co., Ltd. 300 11 919 11 199				Fujimori Kogyo Co., Ltd. 100 3 438 4 740			
Unipres Corp. 200 4 823 2 371				Fuso Chemical Co., Ltd. 100 2 593 4 961			
Yokohama Rubber Co., Ltd. (The) 900 23 252 17 202				Harima Chemicals Group, Inc. 100 1 401 1 242			
Yorozu Corp. 300 4 763 4 015				JCU Corp. 100 2 446 4 242			
Total composantes d'automobile 1 142 130 957 036				JSP Corp. 200 4 489 3 681			
Automobiles – 10,4 %				JSR Corp. 1 500 33 931 39 389			
Honda Motor Co., Ltd. 12 600 470 243 438 316				Kaneka Corp. 200 9 664 7 070			
Isuzu Motors Ltd. 4 400 76 794 54 065				Kansai Paint Co., Ltd. 600 15 060 17 217			
Mazda Motor Corp. 3 700 48 196 30 175				Kumiai Chemical Industry Co., Ltd. 500 4 797 6 319			
Mitsubishi Motors Corp. 10 000 67 904 33 581				Kuraray Co., Ltd. 2 000 35 820 28 405			
Subaru Corp. 7 500 251 586 212 234				Kureha Corp. 100 8 891 5 946			
Suzuki Motor Corp. 1 200 77 709 55 402							
Toyota Motor Corp. 11 000 901 469 939 040							
Yamaha Motor Co., Ltd. 2 900 79 616 61 800							
Total automobiles 1 973 517 1 824 613							

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Lintec Corp.	500	14 652	16 147	Contenants et emballage – 0,0 %			
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	14 000	141 599	110 889	Fuji Seal International, Inc.	100	3 978	2 648
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	2 100	41 701	43 214	Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	200	5 454	3 070
Mitsui Chemicals, Inc.	1 400	45 394	39 714	Total contenants et emballage		9 432	5 718
Moriroku Holdings Co., Ltd.	100	2 928	2 144	Matériel électrique – 2,1 %			
Nihon Nohyaku Co., Ltd.	500	3 286	2 954	Daihen Corp.	100	3 850	4 854
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	500	8 247	6 824	Denyo Co., Ltd.	200	4 295	4 818
Nippon Kayaku Co., Ltd.	700	10 814	9 942	Fuji Electric Co., Ltd.	600	23 196	22 300
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	600	33 945	59 386	Fujikura Ltd.	1 600	9 411	6 262
Nippon Shokubai Co., Ltd.	100	8 690	7 120	Furukawa Electric Co., Ltd.	300	11 589	9 881
Nippon Soda Co., Ltd.	100	3 302	3 565	GS Yuasa Corp.	500	11 998	12 031
Nissan Chemical Corp.	500	32 880	34 844	Helios Techno Holding Co., Ltd.	500	4 027	2 096
Nitto Denko Corp.	1 000	76 804	77 010	Idec Corp.	300	6 922	6 507
NOF Corp.	400	18 459	18 836	Mabuchi Motor Co., Ltd.	500	23 934	21 651
Osaka Soda Co., Ltd.	200	6 813	6 002	Mitsubishi Electric Corp.	10 700	186 052	189 048
Riken Technos Corp.	500	2 955	2 683	Nidec Corp.	800	69 743	72 677
Sakata INX Corp.	300	3 628	3 886	Nissin Electric Co., Ltd.	600	7 308	7 938
Shikoku Chemicals Corp.	600	8 539	8 211	Sinfonia Technology Co., Ltd.	200	2 984	2 586
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	1 600	196 449	254 410	Tatsuta Electric Wire and Cable Co., Ltd.	900	6 475	6 499
Showa Denko K.K.	1 100	41 342	33 551	Toyo Tanso Co., Ltd.	100	2 662	2 140
Sumitomo Bakelite Co., Ltd.	100	4 617	3 806	Total matériel électrique		374 446	371 288
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	13 200	86 766	53 659	Équipement, instruments et composants électroniques – 4,7 %			
Taiyo Holdings Co., Ltd.	200	9 242	12 549	Ai Holdings Corp.	300	6 145	5 886
Taiyo Nippon Sanso Corp.	800	17 085	18 189	Alps Alpine Co., Ltd.	1 000	27 573	17 422
Takasago International Corp.	100	3 677	2 712	Amano Corp.	300	8 678	8 472
Teijin Ltd.	1 300	30 324	28 130	Anritsu Corp.	200	4 446	6 454
Tokai Carbon Co., Ltd.	900	13 311	11 487	Canon Electronics, Inc.	300	6 923	6 094
Tokuyama Corp.	200	6 661	6 393	Citizen Watch Co., Ltd.	1 600	11 570	7 070
Tokyo Ohka Kogyo Co., Ltd.	200	9 104	13 609	CMKCorp.	300	2 552	1 572
Toray Industries, Inc.	5 600	51 719	35 879	Daitron Co., Ltd.	200	3 309	4 191
Tosoh Corp.	2 400	46 685	44 539	Dexerials Corp.	600	6 425	6 393
Toyo Ink SC Holdings Co., Ltd.	500	14 737	12 864	ESPEC Corp.	200	4 770	4 499
Toyobo Co., Ltd.	700	13 540	13 256	Furuno Electric Co., Ltd.	200	2 387	2 457
Ube Industries Ltd.	800	23 760	18 704	Hakuto Co., Ltd.	300	4 114	3 723
Valqua Ltd.	200	4 967	4 896	Hamamatsu Photonics K.K.	300	14 588	17 687
Zeon Corp.	800	10 945	10 009	Hirose Electric Co., Ltd.	150	23 496	22 383
Total produits chimiques		1 406 428	1 344 014	Hitachi Ltd.	3 700	159 780	158 957
Fournitures et services commerciaux – 0,1 %				Horiba Ltd.	200	13 264	14 342
Mitsubishi Pencil Co., Ltd.	200	3 689	3 411	Ibiden Co., Ltd.	600	14 908	23 823
Pilot Corp.	100	5 029	4 135	Innotech Corp.	500	6 204	5 921
Sato Holdings Corp.	200	7 420	5 888	Irigo Electronics Co., Ltd.	100	6 643	4 444
Total fournitures et services commerciaux		16 138	13 434	Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	400	7 867	7 307
Construction et génie – 0,7 %				Kaga Electronics Co., Ltd.	200	5 158	4 939
JGC Holdings Corp.	1 000	19 875	14 316	Keyence Corp.	100	39 799	56 848
Kajima Corp.	2 800	51 934	45 388	Kyosan Electric Manufacturing Co., Ltd.	500	2 960	3 364
Nippon Koei Co., Ltd.	100	2 913	3 800	Macnica Fuji Electronics Holdings, Inc.	500	9 263	9 803
Obayashi Corp.	3 800	48 261	48 357	Marubun Corp.	500	4 090	3 680
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	1 600	11 731	11 696	Meiko Electronics Co., Ltd.	100	2 170	1 733
Taikisha Ltd.	100	4 064	3 748	Murata Manufacturing Co., Ltd.	2 300	157 420	183 394
Total construction et génie		138 778	127 305	Nippon Electric Glass Co., Ltd.	600	21 011	12 763
Matériaux de construction – 0,1 %				Nissha Co., Ltd.	200	2 736	2 553
Taiheiyō Cement Corp.	600	24 593	18 876	Ohara, Inc.	100	1 746	1 358
Crédit à la consommation – 0,1 %				Ok Electric Industry Co., Ltd.	800	12 091	10 483
AEON Financial Service Co., Ltd.	1 500	30 304	22 251	Omron Corp.	600	38 622	54 690
J Trust Co., Ltd.	500	3 009	1 931	Optex Group Co., Ltd.	200	3 291	3 088
Total crédit à la consommation		33 313	24 182	Restar Holdings Corp.	200	3 659	5 252
				Riken Keiki Co., Ltd.	100	2 646	3 011

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Ryosan Co., Ltd.	200	7 802	5 603	Produits ménagers durables - 2,9 %			
Satori Electric Co., Ltd.	200	2 283	2 096	Casio Computer Co., Ltd.	1 600	31 023	37 773
Shimadzu Corp.	600	21 093	21 724	Fujitsu General Ltd.	400	9 514	11 145
Siix Corp.	600	7 787	7 491	JVCKenwood Corp.	800	2 555	1 646
Sumida Corp.	200	3 167	1 934	Nikon Corp.	2 900	53 922	33 023
Taiyo Yuden Co., Ltd.	200	4 598	8 446	Panasonic Corp.	15 100	190 954	179 117
Tamura Corp.	500	3 658	2 866	Rinnai Corp.	150	13 853	17 043
TDK Corp.	500	61 212	67 415	Sekisui Chemical Co., Ltd.	2 300	48 693	44 774
Topcon Corp.	700	9 438	7 653	Sharp Corp.	1 800	29 611	26 042
Yokogawa Electric Corp.	700	17 490	14 847	Sony Corp.	1 400	100 227	130 508
Total équipement, instruments et composants électroniques		780 832	826 131	Sumitomo Forestry Co., Ltd.	900	16 531	15 373
Équipement et services énergétiques - 0,0 %				Zojirushi Corp.	400	7 129	6 878
Modec, Inc.	200	5 540	3 853	Total produits ménagers durables		504 012	503 322
Divertissement - 2,6 %				Produits ménagers - 0,5 %			
Capcom Co., Ltd.	300	8 802	14 847	Lion Corp.	700	19 550	22 862
GungHo Online Entertainment, Inc.	280	7 057	6 794	Pigeon Corp.	300	17 175	15 793
Koei Tecmo Holdings Co., Ltd.	660	18 456	29 121	Unicharm Corp.	800	35 447	44 641
Konami Holdings Corp.	650	36 739	29 459	Total produits ménagers		72 172	83 296
Nintendo Co., Ltd.	600	274 981	363 663	Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants - 0,2 %			
Square Enix Holdings Co., Ltd.	200	8 786	13 736	Electric Power Development Co., Ltd.	1 000	31 369	25 817
Toei Animation Co., Ltd.	100	6 239	6 350	Conglomérats industriels - 0,3 %			
Total divertissement		361 060	463 970	Nisshinbo Holdings, Inc.	1 000	12 023	9 847
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base - 1,0 %				Toshiba Corp.	1 000	40 226	43 365
Ministop Co., Ltd.	200	4 077	3 812	Total conglomerats industriels		52 249	53 212
Seven & I Holdings Co., Ltd.	3 900	205 634	173 310	Assurance - 2,6 %			
Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		209 711	177 122	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	6 900	150 696	111 761
Produits alimentaires - 1,0 %				Sompo Holdings, Inc.	2 100	106 260	98 278
Ajinomoto Co., Inc.	1 800	39 572	40 722	Tokio Marine Holdings, Inc.	4 100	263 968	243 172
Fuji Oil Holdings, Inc.	200	8 524	6 999	Total assurance		520 924	453 211
Kagome Co., Ltd.	300	9 927	12 214	Vente au détail par Internet et par marketing direct - 0,1 %			
Kikkoman Corp.	300	19 982	19 657	Rakuten, Inc.	800	8 574	9 574
Nippon Suisan Kaisha Ltd.	1 000	7 525	5 908	Services de TI - 1,0 %			
Nisshin Oil Group Ltd. (The)	200	8 294	8 509	Fujitsu Ltd.	700	68 757	111 525
Nissin Foods Holdings Co., Ltd.	300	25 202	36 169	NEC Corp.	400	16 440	26 108
Sakata Seed Corp.	200	9 029	8 686	NTT Data Corp.	2 900	46 208	43 897
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	300	14 914	22 838	Total services de TI		131 405	181 530
Yakult Honsha Co., Ltd.	200	16 416	16 033	Produits de loisirs - 0,8 %			
Total produits alimentaires		159 385	177 735	Bandai Namco Holdings, Inc.	1 000	57 988	71 543
Équipement et fournitures de soins de santé - 1,4 %				Mizuno Corp.	100	3 032	2 616
Asahi Intecc Co., Ltd.	200	6 890	7 739	Shimano, Inc.	100	18 749	26 196
Hoya Corp.	700	61 162	90 669	Tomy Co., Ltd.	200	3 259	2 146
Mani, Inc.	100	2 882	3 592	Yamaha Corp.	450	29 440	28 803
Nakanishi, Inc.	300	6 337	5 325	Total produits de loisirs		112 468	131 304
Nihon Kohden Corp.	200	7 311	9 153	Outils et services des sciences de la vie - 0,0 %			
Nipro Corp.	700	11 720	10 516	EPS Holdings, Inc.	200	3 839	2 603
Olympus Corp.	1 400	21 914	36 683	Machinerie - 9,2 %			
Sysmex Corp.	300	26 877	31 170	Aida Engineering Ltd.	600	6 211	5 522
Terumo Corp.	1 100	45 143	56 673	Amada Co., Ltd.	2 500	33 328	27 806
Total équipement et fournitures de soins de santé		190 236	251 520	Asahi Diamond Industrial Co., Ltd.	500	4 302	3 093
Technologies des soins de santé - 0,2 %				Bando Chemical Industries Ltd.	200	2 350	1 651
M3, Inc.	500	17 434	28 942	CKD Corp.	300	3 890	7 219
				Daifuku Co., Ltd.	300	21 199	35 677
				DMG Mori Co., Ltd.	800	14 965	13 200

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Ebara Corp.	300	11 257	9 563	Takeuchi Manufacturing Co., Ltd.	300	6 882	6 779
FANUC Corp.	1 750	423 705	425 511	THKCo., Ltd.	800	25 781	26 905
Fujitec Co., Ltd.	600	10 289	14 990	Tsubaki Nakashima Co., Ltd.	700	13 173	7 432
Furukawa Co., Ltd.	300	5 296	4 147	Tsubakimoto Chain Co.	200	8 446	6 600
Glory Ltd.	300	9 539	9 279	Tsugami Corp.	200	2 228	2 270
Harmonic Drive Systems, Inc.	100	5 004	7 461	Union Tool Co.	100	3 283	3 320
Hino Motors Ltd.	3 400	41 585	31 248	YAMABIKO Corp.	300	3 327	3 405
Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	1 500	52 337	56 432	Yaskawa Electric Corp.	700	29 323	32 919
Hitachi Zosen Corp.	1 300	6 149	6 450	Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	200	2 316	1 800
Hoshizaki Corp.	100	9 959	11 665	Total machinerie		1 707 355	1 612 576
Hosokawa Micron Corp.	100	5 409	7 209	Services maritimes - 0,1 %			
IHI Corp.	800	27 782	15 735	Iino Kaiun Kaisha Ltd.	800	4 165	3 434
Iseki & Co., Ltd.	100	1 935	1 398	Nippon Yusen K.K.	500	11 048	9 569
Iwaki Co., Ltd.	200	2 662	2 697	NS United Kaiun Kaisha Ltd.	200	5 458	3 755
Japan Steel Works Ltd. (The)	400	8 571	7 731	Total services maritimes		20 671	16 758
Juki Corp.	300	4 293	2 091	Médias - 0,2 %			
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	800	26 084	15 654	Dentsu Group, Inc.	1 200	64 513	38 707
Kito Corp.	100	2 025	1 706	Métaux et exploitation minière - 1,0 %			
Kitz Corp.	600	6 197	5 204	Asahi Holdings, Inc.	500	14 821	18 015
Komatsu Ltd.	7 600	245 894	211 418	Daido Steel Co., Ltd.	200	9 934	8 345
Kubota Corp.	4 100	83 346	83 231	Daiki Aluminium Industry Co., Ltd.	500	3 919	3 579
Kurita Water Industries Ltd.	500	17 704	18 880	Dowa Holdings Co., Ltd.	300	12 546	12 385
Makino Milling Machine Co., Ltd.	200	9 400	8 332	Hitachi Metals Ltd.	2 100	30 767	34 014
Makita Corp.	1 000	49 961	49 425	Kyoei Steel Ltd.	100	2 294	1 630
Max Co., Ltd.	400	8 262	7 681	Mitsubishi Materials Corp.	600	21 438	17 233
Meidensha Corp.	300	6 277	6 609	Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	200	6 312	5 525
MINEBEA MITSUMI, Inc.	1 100	24 505	27 121	Nippon LightMetal Holdings Co., Ltd.	3 200	8 960	7 595
MISUMI Group, Inc.	500	16 711	17 005	Nippon Yakin Kogyo Co., Ltd.	90	2 963	1 817
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	1 600	80 000	51 367	Pacific Metals Co., Ltd.	100	2 647	1 935
Mitsubishi Logisnext Co., Ltd.	200	2 898	2 399	Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	1 300	51 627	49 383
Mitsuboshi Belting Ltd.	200	4 589	4 267	Toho Titanium Co., Ltd.	500	5 617	4 078
Miura Co., Ltd.	200	6 682	11 324	Topy Industries Ltd.	100	3 033	1 541
Nabtesco Corp.	500	18 451	20 957	UACJ Corp.	200	4 207	4 868
Nachi-Fujikoshi Corp.	100	5 342	4 280	Total métaux et exploitation minière		181 085	171 943
NGK Insulators Ltd.	1 800	36 844	33 814	Grands magasins - 0,1 %			
Nikkiso Co., Ltd.	200	3 311	2 591	Ryohin Keikaku Co., Ltd.	1 000	21 969	19 252
Nippon Thompson Co., Ltd.	800	5 588	3 414	Pétrole, gaz et autres combustibles - 0,5 %			
Nitta Corp.	100	3 748	2 957	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	1 300	58 621	37 534
Nitto Kohki Co., Ltd.	100	2 652	2 248	Inpex Corp.	6 800	79 142	57 251
NSK Ltd.	4 200	53 852	42 366	Total pétrole, gaz et autres combustibles		137 763	94 785
NTN Corp.	4 400	17 983	11 943	Papier et produits forestiers - 0,2 %			
Obara Group, Inc.	200	7 745	8 256	Hokuetsu Corp.	1 000	7 029	4 822
Oiles Corp.	300	5 703	5 291	Oji Holdings Corp.	3 600	26 866	22 770
OKUMA Corp.	100	6 594	5 820	Total papier et produits forestiers		33 895	27 592
OSG Corp.	500	12 062	10 415	Produits d'hygiène et de beauté - 1,1 %			
Pegasus Sewing Machine Manufacturing Co., Ltd.	100	930	405	Kao Corp.	1 200	120 985	129 376
Rheon Automatic Machinery Co., Ltd.	200	3 881	3 118	Kose Corp.	100	21 797	16 361
Ryobi Ltd.	100	2 479	1 520	Mandom Corp.	200	6 697	5 012
Shibaura Machine Co., Ltd.	100	2 973	2 723	Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	300	12 156	12 953
Shibuya Corp.	400	14 940	14 155	Shiseido Co., Ltd.	300	28 594	25 887
Shima Seiki Manufacturing Ltd.	100	3 825	1 939	Total produits d'hygiène et de beauté		190 229	189 589
Shinmaywa Industries Ltd.	600	9 637	7 650	Produits pharmaceutiques - 9,7 %			
SMC Corp.	100	43 126	69 662	Astellas Pharma, Inc.	8 900	183 794	202 189
Sodick Co., Ltd.	300	3 308	3 015	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	3 600	121 481	262 010
Star Micronics Co., Ltd.	300	5 051	4 541				
Sumitomo Heavy Industries Ltd.	700	30 248	20 723				
Tadano Ltd.	700	9 771	7 945				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	1 400	89 405	155 641	FUJIFILM Holdings Corp.	1 300	76 847	75 659
Eisai Co., Ltd.	1 300	132 699	140 256	Konica Minolta, Inc.	2 400	28 679	11 271
Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	300	18 832	22 005	Maxell Holdings Ltd.	300	5 160	3 802
Kyowa Kirin Co., Ltd.	1 700	45 726	60 715	MCJ Co., Ltd.	600	5 864	6 484
Nichi-iko Pharmaceutical Co., Ltd.	300	4 641	4 935	Ricoh Co., Ltd.	2 800	36 246	27 183
Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	2 200	67 583	87 127	Riso Kagaku Corp.	500	10 101	9 405
Otsuka Holdings Co., Ltd.	2 600	146 371	154 239	Seiko Epson Corp.	2 600	52 378	40 472
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	1 200	25 426	30 041	Toshiba TEC Corp.	200	7 274	10 403
Sawai Pharmaceutical Co., Ltd.	200	14 966	13 988	Wacom Co., Ltd.	800	4 582	5 545
Seikagaku Corp.	500	7 549	7 145	Total matériel informatique, matériel de stockage et périphériques		705 886	544 975
Shionogi & Co., Ltd.	800	64 234	68 173	Textiles, vêtements et articles de luxe - 0,2 %			
Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	900	26 780	16 930	Asics Corp.	800	14 178	12 382
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	9 800	505 041	476 077	Komatsu Matere Co., Ltd.	200	1 975	1 869
ZERIA Pharmaceutical Co., Ltd.	300	7 519	7 579	Kurabo Industries Ltd.	100	2 441	2 854
Total produits pharmaceutiques		1 462 047	1 709 050	Morito Co., Ltd.	200	1 940	1 674
Services professionnels - 0,6 %				Onward Holdings Co., Ltd.	1 000	7 444	4 015
Outsourcing, Inc.	600	7 532	5 151	Seiko Holdings Corp.	300	9 031	6 469
Recruit Holdings Co., Ltd.	2 300	90 267	106 912	Seiren Co., Ltd.	200	3 625	3 436
Total services professionnels		97 799	112 063	Wacoal Holdings Corp.	300	10 370	7 548
Transport routier et ferroviaire - 0,2 %				Total textiles, vêtements et articles de luxe		51 004	40 247
Hitachi Transport System Ltd.	200	8 075	7 272	Tabac - 3,1 %			
Nippon Express Co., Ltd.	500	37 730	35 222	Japan Tobacco, Inc.	21 200	682 675	535 683
Total transport routier et ferroviaire		45 805	42 494	Sociétés commerciales et de distribution - 6,2 %			
Matériel et produits semi-conducteurs - 4,7 %				Alconix Corp.	200	3 177	2 936
Advantest Corp.	1 300	55 977	100 441	Hanwa Co., Ltd.	500	18 637	12 441
Disco Corp.	100	19 428	32 937	Inabata & Co., Ltd.	500	8 849	8 212
Ferrotec Holdings Corp.	200	2 698	1 639	ITOCHU Corp.	11 600	290 268	339 972
Lasertec Corp.	100	2 450	12 827	Marubeni Corp.	14 500	140 542	89 240
Optorun Co., Ltd.	300	9 495	9 499	Mitsubishi Corp.	11 800	431 052	338 161
Rohm Co., Ltd.	500	43 241	45 070	Nagase & Co., Ltd.	600	11 910	10 173
Sanken Electric Co., Ltd.	100	2 673	2 675	Nippon Steel Trading Corp.	300	17 303	12 858
SCREEN Holdings Co., Ltd.	200	13 873	12 700	Sojitz Corp.	10 400	45 734	30 854
Shibaura Mechatronics Corp.	100	3 247	3 585	Sumitomo Corp.	10 300	201 871	160 526
Shindengen Electric Manufacturing Co., Ltd.	100	4 574	2 711	Toyota Tsusho Corp.	2 150	90 446	74 073
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	700	8 827	12 911	Yamazen Corp.	500	6 105	5 732
SUMCO Corp.	2 600	45 653	54 127	Total sociétés commerciales et de distribution		1 265 894	1 085 178
Tokyo Electron Ltd	1 450	302 051	484 000	Infrastructures de transport - 0,0 %			
Tokyo Seimitsu Co., Ltd.	500	19 786	21 714	Nissin Corp.	100	2 106	1 915
Ulvac, Inc.	200	8 276	7 852	Services de télécommunications sans fil - 0,6 %			
Yamaichi Electronics Co., Ltd.	700	12 317	12 407	SoftBank Group Corp.	1 600	93 613	110 086
Total matériel et produits semi-conducteurs		554 566	817 095	Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)			(3 980)
Logiciels - 0,3 %				TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,5 %		18 197 315	17 471 068
Trend Micro, Inc.	800	57 747	60 800	Contrats de change (annexe 1) - 0,4 %			69 108
Commerce de détail spécialisé - 0,9 %				Autres actifs en excédent du passif - 0,1 %			26 448
ABC-Mart, Inc.	300	22 994	23 898	ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %			17 566 624 \$
Fast Retailing Co., Ltd.	150	103 266	116 840				
IDOM, Inc.	600	2 406	3 765				
Sanrio Co., Ltd.	300	7 345	6 317				
VT Holdings Co., Ltd.	900	4 821	4 000				
Total commerce de détail spécialisé		140 832	154 820				
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques - 3,1 %							
Brother Industries Ltd.	1 500	36 939	36 775				
Canon, Inc.	11 800	441 816	317 976				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	1 347 861 CAD	17 142 JPY	(126)\$	A+
7/2/2020	3 979 890 JPY	50 559 CAD	314	AA-
7/2/2020	52 518 943 JPY	674 288 CAD	11 260	A+
7/2/2020	53 196 314 CAD	671 546 JPY	34	A+
7/2/2020	68 904 882 JPY	884 998 CAD	15 105	A+
7/2/2020	68 953 380 JPY	884 998 CAD	14 492	A+
7/2/2020	68 983 735 JPY	884 998 CAD	14 109	A+
7/2/2020	68 991 789 JPY	884 998 CAD	14 007	A+
7/2/2020	69 814 037 CAD	881 398 JPY	(27)	A+
7/2/2020	69 817 739 CAD	881 398 JPY	20	A+
7/2/2020	69 817 915 CAD	881 398 JPY	22	A+
7/2/2020	69 818 179 CAD	881 398 JPY	25	A+
8/4/2020	51 722 058 JPY	653 100 CAD	(67)	A+
8/4/2020	67 877 704 JPY	857 190 CAD	3	A+
8/4/2020	67 879 076 JPY	857 190 CAD	(14)	A+
8/4/2020	67 879 761 JPY	857 190 CAD	(23)	A+
8/4/2020	67 880 018 JPY	857 190 CAD	(26)	A+
69 108 \$				

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVISES

CAD Dollar canadien
JPY Yen japonais

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	11 936 064 \$	17 481 306 \$
Trésorerie	26 695	23 783
Plus-value latente des contrats de change	151 235	363 248
Créances :		
Titres de placement vendus	31 343	83 236
Dividendes	19 029	31 527
Total de l'actif	12 164 366	17 983 100
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	765	7 157
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	79 355	–
Distributions	76 841	136 411
Frais de gestion	788	4 001
Total du passif	157 749	147 569
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	12 006 617 \$	17 835 531 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		
Parts couvertes	10 844 921	16 348 768
Parts non couvertes	1 161 696	1 486 763
	12 006 617 \$	17 835 531 \$
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)		
Parts couvertes	541 082	591 082
Parts non couvertes	50 000	50 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part		
Parts couvertes	20,04 \$	27,66 \$
Parts non couvertes	23,23 \$	29,74 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	264 393 \$	370 619 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(1 704 119)	141 141
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(2 331 609)	1 745 511
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(3 771 335)	2 257 271
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(670 930)	(395 189)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(205 621)	1 072 721
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(876 551)	677 532
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(4 647 886)	2 934 803
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	4 468	(8 430)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	723	(1 256)
Total des autres revenus (pertes)	5 191	(9 686)
Total des revenus (pertes)	(4 642 695)	2 925 117
CHARGES		
Retenues d'impôt étranger	40 837	36 708
Frais de gestion (note 5)	28 253	39 201
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	390	634
Coûts de transaction (note 2)	564	209
Total des charges	70 044	76 752
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(390)	(634)
Charges nettes	69 654	76 118
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 712 349)\$	2 848 999 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables `liée à l'exploitation par catégorie		
Parts couvertes	(4 402 282)	2 600 614
Parts non couvertes	(310 067)	248 385
	(4 712 349)\$	2 848 999 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables		
Parts couvertes	579 544	642 739
Parts non couvertes	50 000	91 160
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part		
Parts couvertes	(7,60)\$	4,05 \$
Parts non couvertes	(6,20)\$	2,72 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	17 835 531 \$	21 166 982 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 712 349)	2 848 999
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(185 825)	(221 146)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(185 825)	(221 146)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	–	1 261 591
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(930 740)	(6 647 163)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(930 740)	(5 385 572)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	12 006 617 \$	18 409 263 \$
PARTS COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	16 348 768 \$	18 543 897 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 402 282)	2 600 614
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(170 825)	(197 396)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(170 825)	(197 396)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	–	1 261 576
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(930 740)	(5 237 091)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(930 740)	(3 975 515)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	10 844 921 \$	16 971 600 \$
PARTS NON COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	1 486 763 \$	2 623 085 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(310 067)	248 385
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(15 000)	(23 750)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(15 000)	(23 750)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	–	15
Sommes versées au rachat de parts rachetables	–	(1 410 072)
Opérations sur parts rachetables, montant net	–	(1 410 057)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	1 161 696 \$	1 437 663 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(4 712 349)\$	2 848 999 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	1 704 119	(141 141)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	2 331 609	(1 745 511)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	205 621	(1 072 721)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(723)	1 256
Achat de placements ¹	(2 028 716)	(1 582 313)
Produit de la vente de placements ¹	2 608 132	1 052 849
Variation des créances	64 391	473 152
Variation des créditeurs	76 142	518 937
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	248 226	353 507
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	–	(2 453)
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(642)	(55 972)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(245 395)	(285 422)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(246 037)	(343 847)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	723	(1 256)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	2 912 \$	8 404 \$
Trésorerie au début de la période	23 783 \$	33 224 \$
Trésorerie à la fin de la période	26 695 \$	41 628 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	236 054 \$	293 539 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %							
Puerto Rico – 0,2 %							
Institutions financières – 0,2 %							
Popular, Inc.	469	32 250	23 667	UMB Financial Corp.	209	18 379	14 627
États-Unis – 99,2 %							
Aérospatiale et défense – 0,6 %							
BWX Technologies, Inc.	247	16 832	18 993	Umpqua Holdings Corp.	2 485	58 001	35 895
Curtiss-Wright Corp.	47	7 336	5 697	United Bankshares, Inc.	882	41 679	33 120
Huntington Ingalls Industries, Inc.	159	46 489	37 665	Valley National Bancorp	3 690	49 476	39 175
Spirit AeroSystems Holdings, Inc.	143	15 095	4 648	Webster Financial Corp.	664	43 697	25 790
Textron, Inc.	99	5 742	4 423	Western Alliance Bancorp	436	31 101	22 416
Total aérospatiale et défense				91 494 71 426			
Fret aérien et logistique – 1,2 %							
C.H. Robinson Worldwide, Inc.	856	86 781	91 876	Wintrust Financial Corp.	198	17 822	11 725
Expeditors International of Washington, Inc.	531	53 417	54 816	Zions Bancorp N.A.	1 076	64 753	49 666
Total fret aérien et logistique				140 198 146 692			
Composantes d'automobile – 0,6 %							
BorgWarner, Inc.	757	43 693	36 278	Total institutions financières			
Gentex Corp.	997	28 619	34 880	1 505 198 1 066 533			
Total composantes d'automobile				72 312 71 158			
Automobiles – 0,8 %							
Harley-Davidson, Inc.	1 472	77 606	47 502	Produits de construction – 1,9 %			
Thor Industries, Inc.	304	31 731	43 966	A.O. Smith Corp.	672	44 012	42 988
Total automobiles				109 337 91 468			
Institutions financières – 8,9 %							
Associated Banc-Corp.	1 216	34 450	22 584	Armstrong World Industries, Inc.	99	8 676	10 478
Bank of Hawaii Corp.	278	30 449	23 177	Fortune Brands Home & Security, Inc.	447	32 030	38 796
Bank OZK	975	39 083	31 066	Lennox International, Inc.	110	30 756	34 794
BankUnited, Inc.	520	23 275	14 296	Masco Corp.	780	33 783	53 169
BOK Financial Corp.	399	42 511	30 573	Owens Corning	382	30 024	28 917
CIT Group, Inc.	684	38 482	19 250	Simpson Manufacturing Co., Inc.	124	12 927	14 201
Comerica, Inc.	1 275	112 130	65 949	Total produits de construction			
Commerce Bancshares, Inc.	398	31 807	32 133	192 208 223 343			
Community Bank System, Inc.	292	24 935	22 604	Marchés financiers – 5,0 %			
Cullen/Frost Bankers, Inc.	437	54 255	44 323	Affiliated Managers Group, Inc.	176	22 526	17 815
East West Bancorp, Inc.	796	51 171	39 163	Ares Management Corp.	1 071	49 289	57 724
First Citizens BancShares, Inc.	7	4 048	3 849	CBOE Global Markets, Inc.	328	47 255	41 537
First Financial Bankshares, Inc.	441	18 524	17 296	E*TRADE Financial Corp.	666	39 803	44 964
First Hawaiian, Inc.	1 112	38 759	26 026	Eaton Vance Corp.	852	49 918	44 648
First Horizon National Corp.	2 513	50 129	33 980	FactSet Research Systems, Inc.	96	31 195	42 810
FNB Corp.	2 953	46 765	30 067	Federated Hermes, Inc.	772	32 055	24 839
Glacier Bancorp, Inc.	566	31 966	27 117	Franklin Resources, Inc.	4 729	154 985	134 629
Hancock Whitney Corp.	520	28 032	14 966	Interactive Brokers Group, Inc.	153	10 243	8 676
Iberiabank Corp.	295	27 553	18 238	Legg Mason, Inc.	921	47 057	62 205
Investors Bancorp, Inc.	2 385	37 052	27 522	LPL Financial Holdings, Inc.	205	17 897	21 819
PacWest Bancorp	1 768	87 390	47 309	Morningstar, Inc.	76	13 069	14 545
People's United Financial, Inc.	4 487	96 821	70 479	Raymond James Financial, Inc.	537	59 358	50 179
Pinnacle Financial Partners, Inc.	179	14 015	10 204	SEI Investments Co.	356	28 602	26 572
Prosperity Bancshares, Inc.	580	52 552	46 756	Stifel Financial Corp.	159	11 566	10 238
Signature Bank	211	32 833	30 628	Total marchés financiers			
Sterling Bancorp	639	17 500	10 167	614 818 603 200			
Synovus Financial Corp.	1 070	50 754	29 823	Produits chimiques – 4,7 %			
TCF Financial Corp.	1 116	63 049	44 574	Albemarle Corp.	556	54 451	58 280
				Ashland Global Holdings, Inc.	209	19 830	19 606
				Balchem Corp.	35	4 667	4 507
				CF Industries Holdings, Inc.	1 373	69 879	52 453
				Eastman Chemical Co.	1 085	101 000	102 579
				FMC Corp.	496	56 563	67 081
				Huntsman Corp.	1 466	44 883	35 765
				Mosaic Co. (The)	961	25 749	16 321
				NewMarket Corp.	42	22 102	22 835
				RPM International, Inc.	591	44 648	60 224
				Scotts Miracle-Gro Co. (The)	302	36 619	55 132
				Valvoline, Inc.	940	26 182	24 668
				W.R. Grace & Co.	258	22 876	17 797
				Westlake Chemical Corp.	454	44 701	33 067
				Total produits chimiques			
				574 150 570 315			
				Fournitures et services commerciaux – 1,0 %			
				ADT, Inc.	2 897	24 392	31 385
				Brink's Co. (The)	77	7 485	4 757
				MSA Safety, Inc.	121	14 319	18 799

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Rollins, Inc.	991	44 857	57 031	Matériel électrique - 0,8 %			
Tetra Tech, Inc.	91	6 791	9 775	Acuity Brands, Inc.	37	6 894	4 809
Total fournitures et services commerciaux		97 844	121 747	GrafTech International Ltd.	1 901	27 278	20 595
Matériel de communications - 0,8 %				Hubbell, Inc.	321	50 638	54 630
Juniper Networks, Inc.	2 502	86 323	77 649	Regal Beloit Corp.	141	14 242	16 715
Ubiquiti, Inc.	98	14 164	23 224	Total matériel électrique		99 052	96 749
Total matériel de communications		100 487	100 873	Équipement, instruments et composants électroniques - 1,1 %			
Construction et génie - 0,3 %				Avnet, Inc.	478	24 536	18 095
EMCOR Group, Inc.	49	4 940	4 400	Cognex Corp.	165	10 159	13 378
Jacobs Engineering Group, Inc.	237	21 606	27 284	Dolby Laboratories, Inc.	197	16 170	17 617
Quanta Services, Inc.	131	7 068	6 977	FLIR Systems, Inc.	405	25 362	22 306
Total construction et génie		33 614	38 661	Jabil, Inc.	291	10 766	12 674
Crédit à la consommation - 1,5 %				Littelfuse, Inc.	59	14 257	13 667
Ally Financial, Inc.	1 950	67 520	52 496	National Instruments Corp.	727	40 678	38 206
FirstCash, Inc.	137	14 245	12 551	Total équipement, instruments et composants électroniques		141 928	135 943
OneMain Holdings, Inc.	741	40 363	24 687	Équipement et services énergétiques - 0,4 %			
Santander Consumer USA Holdings, Inc.	3 022	78 878	75 530	Helmerich & Payne, Inc.	1 737	115 072	46 008
SLM Corp.	1 347	15 780	12 856	Titres participatifs de fiducies de placement immobilier (« FPI ») - 15,5 %			
Total crédit à la consommation		216 786	178 120	American Campus Communities, Inc.	653	35 139	30 992
Contenants et emballage - 3,3 %				American Homes 4 Rent	275	7 861	10 043
AptarGroup, Inc.	192	24 318	29 189	Americold Realty Trust	540	21 027	26 612
Avery Dennison Corp.	353	50 417	54 676	Apartment Investment & Management Co.	528	30 052	26 981
Graphic Packaging Holding Co.	1 246	22 922	23 665	Brixmor Property Group, Inc.	1 891	41 315	32 912
Packaging Corp. of America	639	86 693	86 577	Camden Property Trust	344	41 548	42 601
Sealed Air Corp.	614	34 050	27 383	CoreSite Realty Corp.	192	28 068	31 555
Silgan Holdings, Inc.	382	15 744	16 797	Corporate Office Properties Trust	513	19 593	17 648
Sonoco Products Co.	667	46 762	47 350	Cousins Properties, Inc.	502	23 948	20 330
WestRock Co.	2 784	135 336	106 810	CubeSmart	959	36 979	35 139
Total contenants et emballage		416 242	392 447	CyrusOne, Inc.	434	35 109	42 864
Distributeurs - 0,3 %				Douglas Emmett, Inc.	539	26 743	22 435
Pool Corp.	102	20 308	37 647	Duke Realty Corp.	1 180	45 389	56 694
Services aux consommateurs diversifiés - 0,6 %				EastGroup Properties, Inc.	101	12 625	16 263
H&R Block, Inc.	2 111	67 429	40 925	Equity LifeStyle Properties, Inc.	374	24 374	31 724
Service Corp. International	681	34 526	35 955	Extra Space Storage, Inc.	532	63 843	66 714
Total services aux consommateurs diversifiés		101 955	76 880	Federal Realty Investment Trust	291	46 347	33 663
Services financiers diversifiés - 1,1 %				First Industrial Realty Trust, Inc.	333	14 480	17 378
Equitable Holdings, Inc.	2 689	68 292	70 420	Gaming and Leisure Properties, Inc.	1 718	79 610	80 699
Jefferies Financial Group, Inc.	1 647	44 987	34 769	Healthcare Realty Trust, Inc.	578	23 776	22 984
Voya Financial, Inc.	330	25 418	20 900	Healthcare Trust of America, Inc.	1 055	39 534	37 984
Total services financiers diversifiés		138 697	126 089	Highwoods Properties, Inc.	497	29 943	25 187
Services publics d'électricité - 3,6 %				Host Hotels & Resorts, Inc.	3 713	87 198	54 390
ALLETE, Inc.	364	35 970	26 986	Hudson Pacific Properties, Inc.	507	21 791	17 318
Alliant Energy Corp.	1 554	92 789	100 929	Iron Mountain, Inc.	2 628	118 676	93 119
Hawaiian Electric Industries, Inc.	727	35 953	35 590	JBG SMITH Properties	361	16 837	14 492
IDACORP, Inc.	305	38 384	36 177	Kilroy Realty Corp.	295	27 495	23 509
NRG Energy, Inc.	178	7 026	7 868	Kimco Realty Corp.	2 722	59 526	47 449
OGE Energy Corp.	1 700	79 966	70 069	Lamar Advertising Co.	451	42 438	40 876
Pinnacle West Capital Corp.	970	109 962	96 514	Life Storage, Inc.	208	25 085	26 812
PNM Resources, Inc.	437	24 359	22 805	Macerich Co. (The)	1 895	88 970	23 077
Portland General Electric Co.	594	37 393	33 716	Medical Properties Trust, Inc.	3 164	67 723	80 754
Total services publics d'électricité		461 802	430 654	National Health Investors, Inc.	273	26 538	22 504
				National Retail Properties, Inc.	799	45 297	38 486
				Omega Healthcare Investors, Inc.	1 668	66 494	67 323
				Outfront Media, Inc.	952	31 184	18 314

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Park Hotels & Resorts, Inc.	2 025	67 470	27 189	Hôtellerie, restauration et loisirs - 1,3 %			
Pebblebrook Hotel Trust	884	29 156	16 394	Aramark	592	28 676	18 139
Physicians Realty Trust	1 103	24 540	26 235	Churchill Downs, Inc.	40	4 615	7 231
PS Business Parks, Inc.	80	13 938	14 380	Domino's Pizza, Inc.	86	27 252	43 133
Rayonier, Inc.	515	20 449	17 332	Wendy's Co. (The)	1 194	25 815	35 305
Regency Centers Corp.	753	60 831	46 912	Wyndham Destinations, Inc.	776	42 210	29 688
Rexford Industrial Realty, Inc.	211	9 357	11 868	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	439	26 823	25 401
Ryman Hospitality Properties, Inc.	254	22 617	11 931	Total hôtellerie, restauration et loisirs		155 391	158 897
Sabra Health Care REIT, Inc.	1 983	49 550	38 847	Produits ménagers durables - 2,4 %			
Service Properties Trust	1 752	56 035	16 864	Leggett & Platt, Inc.	986	54 480	47 052
SL Green Realty Corp.	372	44 078	24 893	Newell Brands, Inc.	4 812	116 270	103 740
Spirit Realty Capital, Inc.	586	30 990	27 733	PulteGroup, Inc.	760	31 189	35 111
STAG Industrial, Inc.	729	29 479	29 018	Toll Brothers, Inc.	368	18 446	16 282
STORE Capital Corp.	1 025	35 910	33 132	Whirlpool Corp.	485	88 554	85 287
Terreno Realty Corp.	157	11 038	11 220	Total produits ménagers durables		308 939	287 472
VEREIT, Inc.	7 501	73 458	65 479	Produits ménagers - 0,2 %			
VICI Properties, Inc.	2 635	68 952	72 225	Energizer Holdings, Inc.	391	25 583	25 209
Vornado Realty Trust	902	75 006	46 790	Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants - 1,9 %			
Weingarten Realty Investors	781	29 279	20 071	AES Corp. (The)	4 547	75 472	89 447
Total titres participatifs de fiducies de placement immobilier (« FPI »)		2 204 688	1 856 338	Ormat Technologies, Inc.	69	6 903	5 947
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base - 0,1 %				TerraForm Power, Inc.	2 855	58 516	71 472
Casey's General Stores, Inc.	73	11 988	14 818	Vistra Energy Corp.	2 440	74 950	61 680
Produits alimentaires - 3,8 %				Total producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants		215 841	228 546
Campbell Soup Co.	2 090	108 681	140 819	Conglomérats industriels - 0,2 %			
Flowers Foods, Inc.	1 779	47 548	54 003	Carlisle Cos., Inc.	168	25 499	27 294
Ingredion, Inc.	456	65 684	51 382	Assurance - 5,9 %			
J&J Snack Foods Corp.	47	10 990	8 112	American Financial Group, Inc.	349	46 769	30 068
J.M. Smucker Co. (The)	938	129 127	134 742	American National Insurance Co.	175	26 625	17 122
Lamb Weston Holdings, Inc.	331	26 584	28 728	Assurant, Inc.	277	39 968	38 843
Lancaster Colony Corp.	117	21 652	24 619	Brown & Brown, Inc.	582	25 251	32 205
Sanderson Farms, Inc.	40	8 950	6 293	CNA Financial Corp.	2 031	114 924	88 647
Seaboard Corp.	1	5 422	3 983	Erie Indemnity Co.	234	47 720	60 962
Total produits alimentaires		424 638	452 681	Fidelity National Financial, Inc.	1 831	94 476	76 214
Services publics de gaz - 2,6 %				First American Financial Corp.	738	52 311	48 112
Atmos Energy Corp.	608	74 949	82 195	Globe Life, Inc.	167	20 363	16 829
National Fuel Gas Co.	765	53 182	43 547	Hanover Insurance Group, Inc. (The)	179	28 517	24 624
New Jersey Resources Corp.	611	34 695	27 083	Kemper Corp.	235	23 072	23 137
ONE Gas, Inc.	277	28 869	28 975	Lincoln National Corp.	1 261	93 837	62 982
Southwest Gas Holdings, Inc.	366	38 694	34 310	Old Republic International Corp.	2 571	70 643	56 928
Spire, Inc.	378	38 502	33 720	Primerica, Inc.	97	15 073	15 355
UGI Corp.	1 467	87 582	63 333	Reinsurance Group of America, Inc.	251	49 308	26 729
Total services publics de gaz		356 473	313 163	RLI Corp.	107	11 354	11 926
Équipement et fournitures de soins de santé - 0,6 %				Selective Insurance Group, Inc.	198	16 261	14 177
CONMED Corp.	49	6 898	4 789	Unum Group	1 841	75 964	41 464
Dentsply Sirona, Inc.	373	19 632	22 311	W.R. Berkley Corp.	277	20 886	21 544
Hill-Rom Holdings, Inc.	121	14 060	18 034	Total assurance		873 322	707 868
West Pharmaceutical Services, Inc.	77	11 822	23 747	Services de TI - 3,1 %			
Total équipement et fournitures de soins de santé		52 412	68 881	Alliance Data Systems Corp.	249	42 399	15 252
Fournisseurs et services de soins de santé - 0,3 %				Booz Allen Hamilton Holding Corp.	511	32 818	53 965
Chemed Corp.	11	4 299	6 736	DXC Technology Co.	1 353	62 115	30 308
Encompass Health Corp.	373	28 509	31 360	Jack Henry & Associates, Inc.	200	34 191	49 968
Total fournisseurs et services de soins de santé		32 808	38 096	KBR, Inc.	362	13 965	11 082

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Leidos Holdings, Inc.	497	46 060	63 202	NorthWestern Corp.	395	33 316	29 236
MAXIMUS, Inc.	231	20 293	22 093	Total services publics multiples		384 688	316 470
Perspecta, Inc.	352	8 890	11 101	Pétrole, gaz et autres combustibles – 4,1 %			
Science Applications International Corp.	239	27 521	25 205	Apache Corp.	4 180	116 139	76 609
Western Union Co. (The)	2 923	75 690	85 794	Cabot Oil & Gas Corp.	2 407	66 422	56 140
Total services de TI		363 942	367 970	Cimarex Energy Co.	400	33 682	14 928
Produits de loisirs – 1,3 %				CVR Energy, Inc.	1 836	78 596	50 125
Brunswick Corp.	310	21 589	26 939	Devon Energy Corp.	1 401	42 906	21 569
Hasbro, Inc.	850	102 367	86 490	Diamondback Energy, Inc.	334	37 175	18 963
Polaris, Inc.	358	46 263	44 981	HollyFrontier Corp.	1 070	67 251	42 417
Total produits de loisirs		170 219	158 410	Murphy Oil Corp.	1 483	50 095	27 784
Outils et services des sciences de la vie – 0,3 %				Noble Energy, Inc.	2 422	75 603	29 461
Bio-Techne Corp.	54	11 405	19 359	Parsley Energy, Inc.	464	10 795	6 728
Bruker Corp.	117	5 278	6 462	Targa Resources Corp.	5 417	286 312	147 597
PerkinElmer, Inc.	77	8 059	10 254	Total pétrole, gaz et autres combustibles		864 976	492 321
Total outils et services des sciences de la vie		24 742	36 075	Papier et produits forestiers – 0,2 %			
Machinerie – 3,7 %				Louisiana-Pacific Corp.	526	15 288	18 317
AGCO Corp.	150	12 693	11 294	Services professionnels – 0,7 %			
Allison Transmission Holdings, Inc.	348	18 692	17 377	Exponent, Inc.	119	11 173	13 074
Crane Co.	260	27 454	20 988	ManpowerGroup, Inc.	316	38 105	29 494
Donaldson Co., Inc.	442	27 976	27 915	Robert Half International, Inc.	555	41 567	39 806
Flowserve Corp.	489	26 321	18 933	Total services professionnels		90 845	82 374
Graco, Inc.	497	29 064	32 380	Gestion et promotion immobilières – 0,1 %			
IDEX Corp.	216	39 969	46 344	Kennedy-Wilson Holdings, Inc.	629	18 042	12 997
ITT, Inc.	170	12 006	13 557	Transport routier et ferroviaire – 0,5 %			
John Bean Technologies Corp.	27	3 923	3 153	JB Hunt Transport Services, Inc.	233	32 779	38 066
Lincoln Electric Holdings, Inc.	303	34 300	34 652	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	261	12 673	14 779
Nordson Corp.	128	22 494	32 966	Landstar System, Inc.	62	8 213	9 454
Oshkosh Corp.	212	21 350	20 613	Total transport routier et ferroviaire		53 665	62 299
Snap-on, Inc.	330	67 897	62 054	Matériel et produits semi-conducteurs – 1,0 %			
Timken Co. (The)	355	21 256	21 924	Brooks Automation, Inc.	159	8 886	9 549
Toro Co. (The)	313	25 900	28 190	Cabot Microelectronics Corp.	84	10 789	15 913
Woodward, Inc.	76	7 935	8 001	Entegris, Inc.	204	9 479	16 354
Xylem, Inc.	529	53 885	46 652	MKS Instruments, Inc.	94	10 594	14 451
Total machinerie		453 115	446 993	Monolithic Power Systems, Inc.	94	16 145	30 245
Médias – 1,5 %				Teradyne, Inc.	216	12 441	24 782
Cable One, Inc.	8	9 697	19 276	Universal Display Corp.	23	3 670	4 672
Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	3 756	100 551	87 501	Total matériel et produits semi-conducteurs		72 004	115 966
New York Times Co. (The)	241	8 265	13 751	Logiciels – 0,2 %			
News Corp.	1 351	24 646	21 753	CDK Global, Inc.	315	23 568	17 713
Nexstar Media Group, Inc.	183	18 924	20 792	Pegasystems, Inc.	29	1 992	3 983
TEGNA, Inc.	888	19 053	13 430	Total logiciels		25 560	21 696
Total médias		181 136	176 503	Commerce de détail spécialisé – 1,2 %			
Métaux et exploitation minière – 0,9 %				Aaron's, Inc.	41	2 322	2 527
Reliance Steel & Aluminum Co.	289	31 841	37 245	Advance Auto Parts, Inc.	24	4 975	4 641
Royal Gold, Inc.	150	17 173	25 317	Lithia Motors, Inc.	40	8 214	8 218
Steel Dynamics, Inc.	1 416	65 506	50 154	Tractor Supply Co.	414	43 111	74 072
Total métaux et exploitation minière		114 520	112 716	Williams-Sonoma, Inc.	511	36 991	56 893
Services publics multiples – 2,6 %				Total commerce de détail spécialisé		95 613	146 351
Black Hills Corp.	403	35 712	30 999				
CenterPoint Energy, Inc.	5 271	177 037	133 601				
MDU Resources Group, Inc.	1 367	47 319	41 163				
NiSource, Inc.	2 639	91 304	81 471				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques - 1,1 %			
NetApp, Inc.	1 644	129 347	99 029
Xerox Holdings Corp.	1 385	50 365	28 750
Total matériel informatique, matériel de stockage et périphériques		179 712	127 779
Textiles, vêtements et articles de luxe - 0,5 %			
Hanesbrands, Inc.	3 578	79 687	54 841
Institutions d'épargne et de financement hypothécaire - 1,4 %			
MGIC Investment Corp.	1 378	24 722	15 322
New York Community Bancorp, Inc.	6 327	95 533	87 613
Radian Group, Inc.	22	544	463
TFS Financial Corp.	3 578	81 465	69 511
Total institutions d'épargne et de financement hypothécaire		202 264	172 909
Sociétés commerciales et de distribution - 1,0 %			
Air Lease Corp.	339	16 746	13 480
MSC Industrial Direct Co., Inc.	432	45 345	42 702
Watsco, Inc.	277	58 343	66 825
Total sociétés commerciales et de distribution		120 434	123 007
Services publics d'aqueduc - 0,5 %			
Essential Utilities, Inc.	1 067	53 048	61 187
Total des États-Unis		13 494 584	11 912 397
Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)		(1 447)	
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,4 %		13 525 387	11 936 064
Contrats de change (annexe 1) - 1,3 %			150 470
Passif en excédent des autres actifs - (0,7)%			(79 917)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %			12 006 617 \$

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	72 664 CAD	53 126 USD	(541)\$	A+
7/2/2020	2 523 379 USD	3 474 112 CAD	48 373	A
7/2/2020	2 681 051 USD	3 691 241 CAD	51 447	A+
7/2/2020	2 681 088 USD	3 691 241 CAD	51 396	A+
7/2/2020	3 450 858 CAD	2 541 881 USD	-	A
7/2/2020	3 666 536 CAD	2 700 709 USD	(54)	A+
7/2/2020	3 666 536 CAD	2 700 695 USD	(73)	A+
8/4/2020	2 522 647 USD	3 424 367 CAD	(76)	A
8/4/2020	2 680 237 USD	3 638 387 CAD	19	A+
8/4/2020	2 680 267 USD	3 638 387 CAD	(21)	A+
150 470 \$				

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

CAD Dollar canadien
USD Dollar américain

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	56 417 331 \$	116 320 637 \$
Trésorerie	80 563	71 268
Plus-value latente des contrats de change	317 460	712 654
Créances :		
Titres de placement vendus	211 703	196 965
Dividendes	70 255	129 886
Renonciation aux honoraires de consultation	8 940	–
Total de l'actif	57 106 252	117 431 410
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	1 283	12 836
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	36 737	300 879
Distributions	340 710	385 555
Frais de gestion	–	12 383
Total du passif	378 730	711 653
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	56 727 522 \$	116 719 757 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables		
Parts couvertes	18 943 092	32 096 220
Parts non couvertes	37 784 430	84 623 537
	56 727 522 \$	116 719 757 \$
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)		
Parts couvertes	704 175	1 104 175
Parts non couvertes	1 300 000	2 850 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part		
Parts couvertes	26,90 \$	29,07 \$
Parts non couvertes	29,06 \$	29,69 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	1 090 034 \$	1 284 319 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	1 367 078	1 010 926
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	(6 380 549)	7 325 916
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	(3 923 437)	9 621 161
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(1 313 870)	(612 612)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(383 641)	1 265 503
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(1 697 511)	652 891
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(5 620 948)	10 274 052
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	11 120	(13 863)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	1 009	(3 059)
Total des autres revenus (pertes)	12 129	(16 922)
Total des revenus (pertes)	(5 608 819)	10 257 130
CHARGES		
Retenues d'impôt étranger	163 467	186 556
Frais de gestion (note 5)	158 865	178 737
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	2 300	3 082
Coûts de transaction (note 2)	1 187	156
Total des charges	325 819	368 531
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(2 300)	(3 082)
Charges nettes	323 519	365 449
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(5 932 338)\$	9 891 681 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par catégorie		
Parts couvertes	(2 417 127)	2 812 853
Parts non couvertes	(3 515 211)	7 078 828
	(5 932 338)\$	9 891 681 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables		
Parts couvertes	1 013 790	872 683
Parts non couvertes	1 912 912	2 698 895
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part		
Parts couvertes	(2,38)\$	3,22 \$
Parts non couvertes	(1,84)\$	2,62 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	116 719 757 \$	85 186 383 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(5 932 338)	9 891 681
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(726 023)	(970 148)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(726 023)	(970 148)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	7 120 423	6 397 415
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(60 454 297)	(8 104 420)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(53 333 874)	(1 707 005)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	56 727 522 \$	92 400 911 \$
PARTS COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	32 096 220 \$	19 862 799 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(2 417 127)	2 812 853
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(275 523)	(241 648)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(275 523)	(241 648)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	2 159 940	1 287 940
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(12 620 418)	(1 324 735)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(10 460 478)	(36 795)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	18 943 092 \$	22 397 209 \$
PARTS NON COUVERTES		
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	84 623 537 \$	65 323 584 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(3 515 211)	7 078 828
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(450 500)	(728 500)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(450 500)	(728 500)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	4 960 483	5 109 475
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(47 833 879)	(6 779 685)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(42 873 396)	(1 670 210)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	37 784 430 \$	70 003 702 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(5 932 338)\$	9 891 681 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(1 367 078)	(1 010 926)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	6 380 549	(7 325 916)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	383 641	(1 265 503)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion de devises	(1 009)	3 059
Achat de placements ¹	(5 688 307)	(2 068 081)
Produit de la vente de placements ¹	7 676 416	1 996 296
Variation des créances	35 953	407 341
Variation des créditeurs	(276 525)	385 344
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	1 211 302	1 013 295
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	(108 595)	23 971
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(323 553)	(28 534)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(770 868)	(1 130 894)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(1 203 016)	(1 135 457)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	1 009	(3 059)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	9 295 \$	(125 221)\$
Trésorerie au début de la période	71 268 \$	231 767 \$
Trésorerie à la fin de la période	80 563 \$	106 546 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	986 198 \$	1 131 268 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,5 %				ACTIONS ORDINAIRES – 99,5 %			
États-Unis – 99,5 %				États-Unis – 99,5 %			
Aérospatiale et défense – 2,5 %				Aérospatiale et défense – 2,5 %			
BWX Technologies, Inc.	256	16 930	19 685	CBOE Global Markets, Inc.	329	46 029	41 664
Curtiss-Wright Corp.	56	9 230	6 788	CME Group, Inc.	1 282	324 447	282 892
General Dynamics Corp.	1 608	379 910	326 274	Eaton Vance Corp.	852	48 856	44 648
HEICO Corp.	80	8 053	9 348	FactSet Research Systems, Inc.	102	29 484	45 485
Huntington Ingalls Industries, Inc.	156	46 270	36 954	Federated Hermes, Inc.	771	31 995	24 807
L3Harris Technologies, Inc.	809	168 215	186 348	Franklin Resources, Inc.	4 907	184 879	139 697
Northrop Grumman Corp.	634	255 728	264 619	KKR & Co., Inc.	2 365	90 102	99 147
Raytheon Technologies Corp.	6 915	685 769	578 477	LPL Financial Holdings, Inc.	210	19 231	22 352
Spirit AeroSystems Holdings, Inc.	140	13 918	4 550	MarketAxess Holdings, Inc.	48	14 252	32 642
Textron, Inc.	98	5 786	4 379	Morningstar, Inc.	72	10 986	13 779
Total aérospatiale et défense		1 589 809	1 437 422	Raymond James Financial, Inc.	533	56 117	49 805
Fret aérien et logistique – 2,1 %				Total marchés financiers			
C.H. Robinson Worldwide, Inc.	877	93 159	94 130			1 627 384	1 733 795
Expeditors International of Washington, Inc.	532	47 148	54 920	Produits chimiques – 2,4 %			
FedEx Corp.	1 004	229 091	191 124	Air Products & Chemicals, Inc.	1 081	256 796	354 358
United Parcel Service, Inc.	5 543	807 087	836 649	Celanese Corp.	573	77 575	67 164
Total fret aérien et logistique		1 176 485	1 176 823	CF Industries Holdings, Inc.	1 407	84 474	53 751
Composantes d'automobile – 0,1 %				Eastman Chemical Co.	1 141	107 363	107 874
Gentex Corp.	1 004	29 070	35 125	Ecolab, Inc.	714	148 370	192 848
Automobiles – 0,2 %				FMC Corp.	508	58 029	68 704
Harley-Davidson, Inc.	1 463	74 744	47 211	International Flavors & Fragrances, Inc.	582	99 954	96 759
Thor Industries, Inc.	311	28 762	44 979	NewMarket Corp.	44	24 280	23 922
Total automobiles		103 506	92 190	PPG Industries, Inc.	894	128 361	128 725
Institutions financières – 0,3 %				RPM International, Inc.	606	50 829	61 752
Bank OZK	970	39 753	30 907	Scotts Miracle-Gro Co. (The)	320	39 460	58 418
East West Bancorp, Inc.	783	48 867	38 523	Sherwin-Williams Co. (The)	179	105 384	140 424
Pinnacle Financial Partners, Inc.	176	11 165	10 033	Total produits chimiques		1 180 875	1 354 699
TCF Financial Corp.	1 141	66 047	45 572	Fournitures et services commerciaux – 0,8 %			
Western Alliance Bancorp	425	30 415	21 851	Brink's Co. (The)	71	8 233	4 387
Total institutions financières		196 247	146 886	Cintas Corp.	253	61 074	91 487
Boissons – 3,9 %				MSA Safety, Inc.	122	15 592	18 954
Brown-Forman Corp.	1 266	85 544	105 636	Rollins, Inc.	1 015	44 826	58 412
Constellation Brands, Inc.	678	166 017	161 033	Tetra Tech, Inc.	84	6 554	9 023
Keurig Dr. Pepper, Inc.	7 166	307 966	276 291	Waste Management, Inc.	1 897	238 389	272 757
PepsiCo, Inc.	9 413	1 470 348	1 690 162	Total fournitures et services commerciaux		374 668	455 020
Total boissons		2 029 875	2 233 122	Matériel de communications – 0,0 %			
Biotechnologie – 4,2 %				Ubiquiti, Inc.	87	16 626	20 618
Amgen, Inc.	3 540	1 118 955	1 133 520	Construction et génie – 0,1 %			
Gilead Sciences, Inc.	11 790	1 072 017	1 231 510	EMCOR Group, Inc.	37	3 411	3 322
Total biotechnologie		2 190 972	2 365 030	Jacobs Engineering Group, Inc.	234	27 321	26 939
Produits de construction – 0,2 %				Quanta Services, Inc.	137	7 255	7 297
A.O. Smith Corp.	661	42 115	42 284	Total construction et génie		37 987	37 558
Armstrong World Industries, Inc.	102	8 890	10 796	Matériaux de construction – 0,1 %			
Fortune Brands Home & Security, Inc.	463	31 480	40 184	Martin Marietta Materials, Inc.	121	32 879	33 933
Simpson Manufacturing Co., Inc.	123	12 630	14 087	Vulcan Materials Co.	270	41 268	42 465
Total produits de construction		95 115	107 351	Total matériaux de construction		74 147	76 398
Marchés financiers – 3,1 %				Crédit à la consommation – 1,0 %			
Blackstone Group, Inc. (The)	5 848	418 898	449 838	American Express Co.	2 746	361 040	354 903
				Discover Financial Services	1 589	125 157	108 055
				SLM Corp.	1 329	15 555	12 684
				Synchrony Financial	3 733	166 126	112 305
				Total crédit à la consommation		667 878	587 947

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Contenants et emballage – 0,3 %							
AptarGroup, Inc.	189	24 566	28 733	Tyson Foods, Inc.	1 383	122 068	112 109
Avery Dennison Corp.	351	50 302	54 366	Total produits alimentaires		1 098 239	1 234 085
Graphic Packaging Holding Co.	1 409	26 169	26 761	Services publics de gaz – 0,1 %			
Packaging Corp. of America	656	87 541	88 880	National Fuel Gas Co.	761	46 599	43 319
Total contenants et emballage		188 578	198 740	Équipement et fournitures de soins de santé – 1,1 %			
Distributeurs – 0,1 %							
Pool Corp.	104	21 954	38 386	CONMED Corp.	55	7 695	5 375
Services aux consommateurs diversifiés – 0,1 %							
Service Corp. International	684	36 788	36 113	Danaher Corp.	802	122 282	192 532
Services de télécommunications diversifiés – 5,3 %							
Verizon Communications, Inc.	40 419	3 104 181	3 025 139	Hill-Rom Holdings, Inc.	122	15 299	18 183
Services publics d'électricité – 1,4 %							
NextEra Energy, Inc.	2 510	794 917	818 398	ResMed, Inc.	363	51 536	94 619
Matériel électrique – 1,1 %							
Acuity Brands, Inc.	27	4 912	3 509	Stryker Corp.	1 037	242 938	253 677
AMETEK, Inc.	319	30 305	38 704	Teleflex, Inc.	48	17 670	23 719
Emerson Electric Co.	3 914	333 255	329 605	West Pharmaceutical Services, Inc.	89	12 402	27 448
Hubbell, Inc.	321	50 219	54 631	Total équipement et fournitures de soins de santé		469 822	615 553
Regal Beloit Corp.	138	15 279	16 359	Fournisseurs et services de soins de santé – 3,2 %			
Rockwell Automation, Inc.	573	127 768	165 694	Anthem, Inc.	698	238 106	249 201
Total matériel électrique		561 738	608 502	Chemed Corp.	11	4 252	6 736
Équipement, instruments et composants électroniques – 0,3 %							
Amphenol Corp.	508	57 193	66 076	Cigna Corp.	21	5 273	5 350
CDW Corp.	294	32 033	46 372	Encompass Health Corp.	375	29 932	31 529
Cognex Corp.	135	7 597	10 945	Humana, Inc.	206	80 532	108 440
Dolby Laboratories, Inc.	144	12 082	12 877	UnitedHealth Group, Inc.	3 487	1 155 686	1 396 279
FLIR Systems, Inc.	294	19 455	16 193	Total fournisseurs et services de soins de santé		1 513 781	1 797 535
Littelfuse, Inc.	41	10 433	9 498	Technologies des soins de santé – 0,1 %			
Total équipement, instruments et composants électroniques		138 793	161 961	Cerner Corp.	787	75 195	73 241
Divertissement – 0,2 %							
Activision Blizzard, Inc.	1 177	88 141	121 280	Hôtellerie, restauration et loisirs – 0,1 %			
Titres participatifs de fiducies de placement immobilier (« FPI ») – 0,0 %							
Ryman Hospitality Properties, Inc.	515	47 718	24 191	Aramark	580	27 634	17 772
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base – 1,4 %							
Casey's General Stores, Inc.	82	14 714	16 645	Churchill Downs, Inc.	40	6 813	7 231
Costco Wholesale Corp.	955	297 588	393 114	Wendy's Co. (The)	1 195	28 144	35 334
Kroger Co. (The)	4 485	172 198	206 107	Total hôtellerie, restauration et loisirs		62 591	60 337
Sysco Corp.	2 691	227 376	199 690	Produits ménagers durables – 0,4 %			
Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		711 876	815 556	D.R. Horton, Inc.	1 179	65 592	88 754
Produits alimentaires – 2,2 %							
Campbell Soup Co.	2 178	141 948	146 748	Leggett & Platt, Inc.	977	55 327	46 622
Conagra Brands, Inc.	3 611	164 575	172 414	Lennar Corp.	200	12 787	16 731
General Mills, Inc.	5 589	374 852	467 777	PulteGroup, Inc.	765	29 749	35 342
Hershey Co. (The)	765	116 120	134 619	Toll Brothers, Inc.	340	16 374	15 043
Ingredion, Inc.	480	56 524	54 087	Total produits ménagers durables		179 829	202 492
J&J Snack Foods Corp.	55	13 240	9 492	Produits ménagers – 4,7 %			
Lancaster Colony Corp.	113	22 089	23 777	Church & Dwight Co., Inc.	777	61 422	81 541
McCormick & Co., Inc.	439	77 992	106 926	Clorox Co. (The)	857	167 984	255 229
Sanderson Farms, Inc.	39	8 831	6 136	Procter & Gamble Co. (The)	14 451	1 982 946	2 345 805
				Total produits ménagers		2 212 352	2 682 575
				Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants – 0,0 %			
				Ormat Technologies, Inc.	63	6 273	5 430
				Conglomérats industriels – 3,2 %			
				3M Co.	4 771	1 146 421	1 010 364
				Carlisle Cos., Inc.	175	26 932	28 431
				Honeywell International, Inc.	3 550	692 989	696 849
				Roper Technologies, Inc.	149	68 788	78 538
				Total conglomerats industriels		1 935 130	1 814 182
				Assurance – 1,3 %			
				Arthur J. Gallagher & Co.	817	100 932	108 132

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Brown & Brown, Inc.	574	21 927	31 763	Snap-on, Inc.	332	68 763	62 430
Erie Indemnity Co.	234	42 785	60 962	Stanley Black & Decker, Inc.	621	111 380	117 507
Globe Life, Inc.	173	18 225	17 434	Toro Co. (The)	307	25 510	27 649
Marsh & McLennan Cos., Inc.	2 028	235 664	295 612	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	293	29 013	22 900
Travelers Cos., Inc. (The)	1 511	245 086	233 955	Woodward, Inc.	84	8 766	8 844
Total assurance		664 619	747 858	Xylem, Inc.	532	49 431	46 917
Vente au détail par Internet et par marketing direct - 0,4 %				Total machinerie		2 272 594	2 430 754
eBay, Inc.	3 106	147 974	221 166	Médias - 2,4 %			
Services de TI - 3,7 %				Cable One, Inc.	9	12 383	21 686
Automatic Data Processing, Inc.	1 723	297 705	348 275	Comcast Corp.	21 280	1 069 862	1 126 122
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	395	26 880	41 715	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	3 970	109 137	92 487
Broadridge Financial Solutions, Inc.	375	50 590	64 243	Nexstar Media Group, Inc.	180	20 635	20 451
Cognizant Technology Solutions Corp.	1 342	116 366	103 520	TEGNA, Inc.	880	19 255	13 309
Fidelity National Information Services, Inc.	1 149	206 553	209 165	ViacomCBS, Inc.	3 470	185 516	109 857
Global Payments, Inc.	241	44 416	55 497	Total médias		1 416 788	1 383 912
Jack Henry & Associates, Inc.	148	25 418	36 976	Grands magasins - 1,0 %			
KBR, Inc.	264	10 186	8 082	Dollar General Corp.	521	81 275	134 750
Leidos Holdings, Inc.	372	47 339	47 306	Target Corp.	2 551	274 764	415 346
MasterCard, Inc.	992	279 033	398 231	Total grands magasins		356 039	550 096
MAXIMUS, Inc.	180	15 999	17 216	Pétrole, gaz et autres combustibles - 1,4 %			
Paychex, Inc.	1 934	172 415	198 889	Cabot Oil & Gas Corp.	2 562	59 728	59 755
Science Applications International Corp.	177	19 890	18 666	CVR Energy, Inc.	1 971	98 331	53 811
Visa, Inc.	2 051	365 877	537 870	Devon Energy Corp.	1 376	42 922	21 184
Total services de TI		1 678 667	2 085 651	Diamondback Energy, Inc.	332	35 618	18 849
Produits de loisirs - 0,3 %				Marathon Petroleum Corp.	5 751	465 170	291 846
Brunswick Corp.	306	22 099	26 591	Parsley Energy, Inc.	452	10 199	6 554
Hasbro, Inc.	873	104 609	88 830	Pioneer Natural Resources Co.	507	92 717	67 247
Polaris, Inc.	361	44 384	45 358	Valero Energy Corp.	3 843	441 003	306 879
Total produits de loisirs		171 092	160 779	Total pétrole, gaz et autres combustibles		1 245 688	826 125
Outils et services des sciences de la vie - 0,4 %				Produits pharmaceutiques - 7,5 %			
Agilent Technologies, Inc.	635	70 459	76 182	Bristol-Myers Squibb Co.	16 059	1 269 307	1 281 940
Bruker Corp.	138	5 759	7 621	Eli Lilly & Co.	4 957	714 992	1 104 870
PerkinElmer, Inc.	87	8 958	11 585	Merck & Co., Inc.	16 946	2 005 953	1 779 045
Thermo Fisher Scientific, Inc.	234	100 820	115 108	Zoetis, Inc.	603	76 545	112 185
Total outils et services des sciences de la vie		185 996	210 496	Total produits pharmaceutiques		4 066 797	4 278 040
Machinerie - 4,3 %				Services professionnels - 0,3 %			
AGCO Corp.	144	12 711	10 842	Equifax, Inc.	331	60 281	77 237
Allison Transmission Holdings, Inc.	338	19 506	16 877	Exponent, Inc.	113	10 401	12 415
Caterpillar, Inc.	3 801	647 308	652 770	TransUnion	149	16 343	17 607
Cummins, Inc.	1 075	225 858	252 859	Verisk Analytics, Inc.	267	52 721	61 694
Deere & Co.	1 344	271 422	286 738	Total services professionnels		139 746	168 953
Donaldson Co., Inc.	447	28 036	28 231	Transport routier et ferroviaire - 2,7 %			
Dover Corp.	620	70 681	81 276	CSX Corp.	2 531	211 089	239 632
Flowserve Corp.	488	30 346	18 895	JB Hunt Transport Services, Inc.	232	32 976	37 903
Fortive Corp.	295	28 142	27 097	Kansas City Southern	250	50 132	50 669
Graco, Inc.	491	28 402	31 989	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	268	12 110	15 176
IDEX Corp.	217	39 754	46 559	Landstar System, Inc.	61	8 247	9 301
Illinois Tool Works, Inc.	1 892	365 948	449 116	Norfolk Southern Corp.	1 268	261 038	302 233
ITT, Inc.	176	11 690	14 035	Old Dominion Freight Line, Inc.	99	13 242	22 793
John Bean Technologies Corp.	21	2 960	2 452	Union Pacific Corp.	3 718	711 447	853 390
Lincoln Electric Holdings, Inc.	295	32 887	33 737	Total transport routier et ferroviaire		1 300 281	1 531 097
Nordson Corp.	136	23 406	35 027				
Oshkosh Corp.	215	21 176	20 905				
Parker-Hannifin Corp.	543	119 498	135 102				

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Matériel et produits semi-conducteurs - 7,6 %				Watsco, Inc. 296 69 202 71 409			
Analog Devices, Inc.	1 228	149 930	204 457	Total sociétés commerciales et de distribution 344 545 421 047			
Applied Materials, Inc.	2 377	133 031	195 073	Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2) (287)			
Brooks Automation, Inc.	122	6 596	7 327	TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,5 % 49 646 203 56 417 331			
Cabot Microelectronics Corp.	65	8 410	12 314	Contrats de change (annexe 1) - 0,6 % 316 177			
Entegris, Inc.	148	9 858	11 865	Passif en excédent des autres actifs - (0,1)% (5 986)			
Intel Corp.	17 431	1 112 974	1 415 837	ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 % 56 727 522 \$			
KLA Corp.	577	92 730	152 343	INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS			
Lam Research Corp.	436	108 361	191 460	ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE			
Lam Research Corp.	436	108 361	191 460				
Maxim Integrated Products, Inc.	1 637	117 926	134 699				
MKS Instruments, Inc.	71	8 736	10 915				
Monolithic Power Systems, Inc.	72	13 411	23 166				
NVIDIA Corp.	327	87 142	168 655				
QUALCOMM, Inc.	5 953	677 083	737 140				
Skyworks Solutions, Inc.	503	58 319	87 312				
Teradyne, Inc.	160	14 296	18 357				
Texas Instruments, Inc.	4 907	661 309	845 842				
Universal Display Corp.	20	2 494	4 063				
Xilinx, Inc.	711	71 292	94 971				
Total matériel et produits semi-conducteurs		3 333 898	4 315 796				
Logiciels - 7,7 %							
Citrix Systems, Inc.	295	42 190	59 237				
Intuit, Inc.	392	101 705	157 626				
Microsoft Corp.	12 018	1 734 009	3 320 395				
Oracle Corp.	10 673	750 130	800 844				
SS&C Technologies Holdings, Inc.	371	28 798	28 447				
Total logiciels		2 656 832	4 366 549				
Commerce de détail spécialisé - 1,9 %							
Aaron's, Inc.	39	2 230	2 404				
Advance Auto Parts, Inc.	20	3 350	3 868				
Best Buy Co., Inc.	1 512	133 866	179 138				
Lithia Motors, Inc.	40	7 936	8 218				
Lowe's Cos., Inc.	3 502	443 779	642 403				
Tiffany & Co.	507	68 900	83 932				
Tractor Supply Co.	433	47 648	77 471				
Williams-Sonoma, Inc.	525	39 327	58 452				
Total commerce de détail spécialisé		747 036	1 055 886				
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques - 5,9 %							
Apple, Inc.	6 750	1 741 642	3 342 954				
Textiles, vêtements et articles de luxe - 0,8 %							
Hanesbrands, Inc.	3 762	69 184	57 661				
NIKE, Inc.	3 030	301 103	403 332				
Total textiles, vêtements et articles de luxe		370 287	460 993				
Tabac - 2,9 %							
Altria Group, Inc.	30 443	2 120 830	1 622 180				
Sociétés commerciales et de distribution - 0,7 %							
Air Lease Corp.	332	19 829	13 202				
Fastenal Co.	3 343	126 485	194 427				
MSC Industrial Direct Co., Inc.	427	43 617	42 207				
W.W. Grainger, Inc.	234	85 412	99 802				

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit *
7/2/2020	120 443 CAD	88 058 USD	(896)\$	A+
7/2/2020	155 939 USD	213 142 CAD	1 439	A+
7/2/2020	1 320 905 CAD	973 412 USD	599	A+
7/2/2020	2 641 810 CAD	1 946 739 USD	1 082	A+
7/2/2020	5 244 899 USD	7 221 019 CAD	100 545	A
7/2/2020	5 572 627 USD	7 672 331 CAD	106 933	A+
7/2/2020	5 572 704 USD	7 672 331 CAD	106 829	A+
7/2/2020	5 914 409 CAD	4 356 518 USD	-	A
7/2/2020	6 284 057 CAD	4 628 730 USD	(93)	A+
7/2/2020	6 284 057 CAD	4 628 707 USD	(125)	A+
8/4/2020	4 402 058 USD	5 975 573 CAD	(132)	A
8/4/2020	4 677 058 USD	6 349 046 CAD	33	A+
8/4/2020	4 677 110 USD	6 349 046 CAD	(37)	A+
316 177 \$				

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVISES

CAD Dollar canadien
USD Dollar américain

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	44 526 705 \$	38 449 960 \$
Trésorerie	60 842	18 153
Plus-value latente des contrats de change	298 418	441 397
Créances :		
Titres de placement vendus	63 327	54 136
Dividendes	52 351	43 290
Total de l'actif	45 001 643	39 006 936
PASSIF		
Passifs courants		
Moins-value latente des contrats de change	3 648	18 951
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	50 039	301 383
Distributions	168 000	109 200
Frais de gestion	4 237	6 197
Total du passif	225 924	435 731
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	44 775 719 \$	38 571 205 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	44 775 719	38 571 205
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	1 600 000	1 300 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	27,98 \$	29,67 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Dividendes	521 904 \$	441 352 \$
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(233 956)	198 656
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	509 770	2 573 118
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	797 718	3 213 126
Profit net (perte nette) sur les dérivés		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change	(1 076 726)	(154 312)
Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change	(127 676)	283 639
Total du profit net (de la perte nette) sur les dérivés	(1 204 402)	129 327
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements et les dérivés	(406 684)	3 342 453
Autres revenus (pertes)		
Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les opérations en devises	4 339	(1 779)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	227	(1 103)
Total des autres revenus (pertes)	4 566	(2 882)
Total des revenus (pertes)	(402 118)	3 339 571
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	90 651	74 810
Retenues d'impôt étranger	78 286	65 197
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	1 093	1 052
Coûts de transaction (note 2)	661	48
Total des charges	170 691	141 107
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(1 093)	(1 052)
Charges nettes	169 598	140 055
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(571 716)\$	3 199 516 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	1 419 780	1 214 088
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	(0,40)\$	2,64 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	38 571 205 \$	23 174 104 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(571 716)	3 199 516
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(337 000)	(331 250)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(337 000)	(331 250)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	11 473 465	8 810 920
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(4 360 235)	(1 366 040)
Opérations sur parts rachetables, montant net	7 113 230	7 444 880
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	44 775 719 \$	33 487 250 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

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

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	(571 716)\$	3 199 516 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	233 956	(198 656)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(509 770)	(2 573 118)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des dérivés	127 676	(283 639)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(227)	1 103
Achat de placements ¹	(14 799 076)	(571 266)
Produit de la vente de placements ¹	8 998 145	580 039
Variation des créances	(18 252)	(111 493)
Variation des créditeurs	(253 304)	71 064
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(6 792 568)	113 550
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	11 473 465	25 001
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(4 360 235)	(833)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(278 200)	(162 500)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	6 835 030	(138 332)
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	227	(1 103)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	42 689 \$	(25 885)\$
Trésorerie au début de la période	18 153 \$	64 637 \$
Trésorerie à la fin de la période	60 842 \$	38 752 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	434 557 \$	379 436 \$

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

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

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
ACTIONS ORDINAIRES – 99,4 %				Marchés financiers – 3,1 %			
États-Unis – 99,4 %				Blackstone Group, Inc. (The)			
Aérospatiale et défense – 2,5 %				4 632 327 890 356 301			
BWX Technologies, Inc.	207	14 074	15 917	CBOE Global Markets, Inc.			
Curtiss-Wright Corp.	33	5 073	4 000	259 35 767 32 799			
General Dynamics Corp.	1 279	293 439	259 518	CME Group, Inc.			
HEICO Corp.	34	3 739	3 974	1 025 257 454 226 181			
Huntington Ingalls Industries, Inc.	127	36 959	30 085	Eaton Vance Corp.			
L3Harris Technologies, Inc.	634	140 576	146 038	682 37 742 35 739			
Northrop Grumman Corp.	498	205 229	207 855	74 22 348 32 999			
Raytheon Technologies Corp.	5 432	520 595	454 416	FactSet Research Systems, Inc.			
Spirit AeroSystems Holdings, Inc.	119	10 463	3 868	614 24 234 19 755			
Textron, Inc.	84	4 675	3 753	Federated Hermes, Inc.			
Total aérospatiale et défense		1 234 822	1 129 424	3 948 137 233 112 395			
Fret aérien et logistique – 2,1 %				Franklin Resources, Inc.			
C.H. Robinson Worldwide, Inc.	682	70 372	73 200	1 773 66 743 74 329			
Expeditors International of Washington, Inc.	425	38 585	43 874	LPL Financial Holdings, Inc.			
FedEx Corp.	789	172 059	150 196	162 13 963 17 243			
United Parcel Service, Inc.	4 379	614 155	660 957	MarketAxess Holdings, Inc.			
Total fret aérien et logistique		895 171	928 227	38 13 328 25 842			
Composantes d'automobile – 0,1 %				Morningstar, Inc.			
Gentex Corp.	800	23 434	27 988	59 9 088 11 291			
Automobiles – 0,2 %				Raymond James Financial, Inc.			
Harley-Davidson, Inc.	1 174	54 390	37 885	429 45 266 40 087			
Thor Industries, Inc.	245	21 743	35 433	S&P Global, Inc.			
Total automobiles		76 133	73 318	399 114 081 178 473			
Institutions financières – 0,3 %				SEI Investments Co.			
Bank OZK	781	30 106	24 885	285 21 202 21 273			
East West Bancorp, Inc.	629	36 568	30 946	T. Rowe Price Group, Inc.			
Pinnacle Financial Partners, Inc.	136	8 540	7 753	1 107 152 422 185 604			
TCF Financial Corp.	880	47 804	35 148	Total marchés financiers			
Western Alliance Bancorp	344	23 154	17 686	1 278 761 1 370 311			
Total institutions financières		146 172	116 418	Produits chimiques – 2,4 %			
Boissons – 3,9 %				Air Products & Chemicals, Inc.			
Brown-Forman Corp.	1 017	69 078	84 802	853 208 208 279 619			
Constellation Brands, Inc.	524	125 904	124 456	Celanese Corp.			
Keurig Dr. Pepper, Inc.	5 662	236 253	218 303	460 58 692 53 919			
PepsiCo, Inc.	7 440	1 186 159	1 335 898	CF Industries Holdings, Inc.			
Total boissons		1 617 394	1 763 459	1 085 61 755 41 450			
Biotechnologie – 4,2 %				Eastman Chemical Co.			
Amgen, Inc.	2 795	868 930	894 969	921 84 177 87 074			
Gilead Sciences, Inc.	9 308	863 060	972 255	Ecolab, Inc.			
Total biotechnologie		1 731 990	1 867 224	562 120 145 151 793			
Produits de construction – 0,2 %				FMC Corp.			
A.O. Smith Corp.	534	33 261	34 160	396 46 132 53 557			
Armstrong World Industries, Inc.	72	6 511	7 620	International Flavors & Fragrances, Inc.			
Fortune Brands Home & Security, Inc.	355	24 423	30 811	454 76 259 75 478			
Simpson Manufacturing Co., Inc.	97	9 881	11 109	NewMarket Corp.			
Total produits de construction		74 076	83 700	33 18 093 17 942			
Crédit à la consommation – 1,0 %				PPG Industries, Inc.			
American Express Co.	2 172	287 315	280 717	723 99 231 104 103			
Discover Financial Services	1 202	92 809	81 739	RPM International, Inc.			
				471 39 184 47 995			

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
SLM Corp.	1 067	12 372	10 183	J&J Snack Foods Corp.	37	8 499	6 386
Synchrony Financial	2 877	120 064	86 553	Lancaster Colony Corp.	94	18 187	19 779
Total crédit à la consommation		512 560	459 192	McCormick & Co., Inc.	345	60 658	84 031
Contenants et emballage – 0,3 %				Sanderson Farms, Inc.	32	6 858	5 035
AptarGroup, Inc.	154	20 217	23 412	Tyson Foods, Inc.	1 078	90 559	87 385
Avery Dennison Corp.	279	39 854	43 214	Total produits alimentaires		860 478	971 738
Graphic Packaging Holding Co.	1 132	20 195	21 500	Services publics de gaz – 0,1 %			
Packaging Corp. of America	508	67 270	68 828	National Fuel Gas Co.	610	36 317	34 724
Total contenants et emballage		147 536	156 954	Équipement et fournitures de soins de santé – 1,1 %			
Distributeurs – 0,1 %				CONMED Corp.	37	4 888	3 616
Pool Corp.	84	19 090	31 004	DanaHER Corp.	633	101 740	151 961
Services aux consommateurs diversifiés – 0,1 %				Hill-Rom Holdings, Inc.	97	12 766	14 456
Service Corp. International	548	29 772	28 933	ResMed, Inc.	278	42 011	72 463
Services de télécommunications diversifiés – 5,3 %				Stryker Corp.	811	190 954	198 392
Verizon Communications, Inc.	31 931	2 431 649	2 389 859	Teleflex, Inc.	35	12 522	17 295
Services publics d'électricité – 1,4 %				West Pharmaceutical Services, Inc.	61	10 275	18 813
NextEra Energy, Inc.	1 981	635 990	645 915	Total équipement et fournitures de soins de santé		375 156	476 996
Matériel électrique – 1,1 %				Fournisseurs et services de soins de santé – 3,1 %			
Acuity Brands, Inc.	28	4 544	3 639	Anthem, Inc.	546	189 930	194 934
AMETEK, Inc.	254	24 864	30 818	Chemed Corp.	7	2 689	4 287
Emerson Electric Co.	3 110	256 795	261 899	Cigna Corp.	20	5 094	5 095
Hubbell, Inc.	255	39 812	43 398	Encompass Health Corp.	298	24 740	25 055
Regal Beloit Corp.	116	12 536	13 751	Humana, Inc.	156	63 552	82 120
Rockwell Automation, Inc.	444	100 737	128 391	UnitedHealth Group, Inc.	2 753	946 966	1 102 367
Total matériel électrique		439 288	481 896	Total fournisseurs et services de soins de santé		1 232 971	1 413 858
Équipement, instruments et composants électroniques – 0,3 %				Technologies des soins de santé – 0,1 %			
Amphenol Corp.	398	44 375	51 768	Cerner Corp.	589	55 933	54 814
CDW Corp.	218	24 762	34 384	Hôtellerie, restauration et loisirs – 0,1 %			
Cognex Corp.	100	5 769	8 108	Aramark	472	20 699	14 463
Dolby Laboratories, Inc.	120	9 948	10 731	Churchill Downs, Inc.	32	5 353	5 784
FLIR Systems, Inc.	245	15 615	13 494	Wendy's Co. (The)	958	22 383	28 327
Littelfuse, Inc.	35	8 355	8 108	Total hôtellerie, restauration et loisirs		48 435	48 574
Total équipement, instruments et composants électroniques		108 824	126 593	Produits ménagers durables – 0,3 %			
Divertissement – 0,2 %				D.R. Horton, Inc.	894	47 611	67 299
Activision Blizzard, Inc.	948	74 737	97 684	Leggett & Platt, Inc.	788	41 289	37 603
Titres participatifs de fiducies de placement immobilier (« FPI ») – 0,0 %				Lennar Corp.	159	10 008	13 301
Ryman Hospitality Properties, Inc.	411	35 882	19 306	PulteGroup, Inc.	612	23 212	28 274
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base – 1,4 %				Toll Brothers, Inc.	280	12 802	12 389
Casey's General Stores, Inc.	59	10 420	11 976	Total produits ménagers durables		134 922	158 866
Costco Wholesale Corp.	755	239 740	310 787	Produits ménagers – 4,7 %			
Kroger Co. (The)	3 508	137 577	161 209	Church & Dwight Co., Inc.	602	49 305	63 175
Sysco Corp.	2 148	174 520	159 396	Clorox Co. (The)	672	139 343	200 133
Total vente au détail de produits alimentaires et de produits de base		562 257	643 368	Procter & Gamble Co. (The)	11 382	1 594 945	1 847 620
Produits alimentaires – 2,2 %				Total produits ménagers		1 783 593	2 110 928
Campbell Soup Co.	1 734	113 696	116 833	Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants – 0,0 %			
Conagra Brands, Inc.	2 810	127 017	134 168	Ormat Technologies, Inc.	57	5 592	4 913
General Mills, Inc.	4 408	295 746	368 932	Conglomérats industriels – 3,2 %			
Hershey Co. (The)	616	96 635	108 399	3M Co.	3 768	882 127	797 957
Ingredion, Inc.	362	42 623	40 790	Carlisle Cos., Inc.	133	20 227	21 608
				Honeywell International, Inc.	2 810	546 952	551 590
				Roper Technologies, Inc.	116	53 228	61 144
				Total conglomerats industriels		1 502 534	1 432 299

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Assurance – 1,3 %							
Arthur J. Gallagher & Co.	641	79 254	84 838	Oshkosh Corp.	163	16 019	15 849
Brown & Brown, Inc.	455	18 487	25 178	Parker-Hannifin Corp.	428	92 282	106 490
Erie Indemnity Co.	187	35 364	48 718	Snap-on, Inc.	260	52 136	48 891
Globe Life, Inc.	132	13 875	13 302	Stanley Black & Decker, Inc.	506	87 955	95 746
Marsh & McLennan Cos., Inc.	1 614	192 870	235 265	Toro Co. (The)	249	22 086	22 426
Travelers Cos., Inc. (The)	1 197	191 050	185 337	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	229	21 630	17 898
Total assurance		530 900	592 638	Woodward, Inc.	63	6 405	6 633
Vente au détail par Internet et par marketing direct – 0,4 %				Xylem, Inc.	423	39 216	37 304
eBay, Inc.	2 490	118 790	177 303	Total machinerie		1 788 111	1 920 549
Services de TI – 3,7 %				Médias – 2,4 %			
Automatic Data Processing, Inc.	1 360	245 661	274 901	Cable One, Inc.	6	10 302	14 457
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	309	22 663	32 633	Comcast Corp.	16 804	836 798	889 255
Broadridge Financial Solutions, Inc.	299	40 118	51 223	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	3 185	85 468	74 199
Cognizant Technology Solutions Corp.	1 018	86 180	78 527	Nexstar Media Group, Inc.	148	16 579	16 816
Fidelity National Information Services, Inc.	910	164 152	165 657	TEGNA, Inc.	706	14 656	10 677
Global Payments, Inc.	187	35 056	43 062	ViacomCBS, Inc.	2 770	132 276	87 696
Jack Henry & Associates, Inc.	122	22 297	30 480	Total médias		1 096 079	1 093 100
KBR, Inc.	216	8 083	6 613	Grands magasins – 1,0 %			
Leidos Holdings, Inc.	301	39 025	38 277	Dollar General Corp.	419	68 694	108 369
MasterCard, Inc.	784	235 735	314 731	Target Corp.	2 022	222 349	329 216
MAXIMUS, Inc.	143	12 630	13 677	Total grands magasins		291 043	437 585
Paychex, Inc.	1 517	136 363	156 005	Pétrole, gaz et autres combustibles – 1,4 %			
Science Applications International Corp.	148	16 725	15 608	Cabot Oil & Gas Corp.	1 901	44 102	44 338
Visa, Inc.	1 611	307 056	422 481	CVR Energy, Inc.	1 454	67 636	39 696
Total services de TI		1 371 744	1 643 875	Devon Energy Corp.	1 108	30 813	17 058
Produits de loisirs – 0,3 %				Diamondback Energy, Inc.	268	25 836	15 216
Brunswick Corp.	249	17 258	21 638	Marathon Petroleum Corp.	4 532	331 799	229 986
Hasbro, Inc.	680	80 696	69 192	Parsley Energy, Inc.	369	7 509	5 350
Polaris, Inc.	285	32 576	35 809	Pioneer Natural Resources Co.	393	67 179	52 126
Total produits de loisirs		130 530	126 639	Valero Energy Corp.	3 010	319 529	240 361
Outils et services des sciences de la vie – 0,4 %				Total pétrole, gaz et autres combustibles		894 403	644 131
Agilent Technologies, Inc.	497	54 480	59 626	Produits pharmaceutiques – 7,6 %			
Bruker Corp.	105	4 466	5 799	Bristol-Myers Squibb Co.	12 678	995 256	1 012 045
PerkinElmer, Inc.	67	7 005	8 922	Eli Lilly & Co.	3 915	609 368	872 617
Thermo Fisher Scientific, Inc.	190	81 503	93 463	Merck & Co., Inc.	13 418	1 560 770	1 408 665
Total outils et services des sciences de la vie		147 454	167 810	Zoetis, Inc.	503	68 525	93 581
Machinerie – 4,3 %				Total produits pharmaceutiques		3 233 919	3 386 908
AGCO Corp.	120	10 148	9 035	Services professionnels – 0,3 %			
Allison Transmission Holdings, Inc.	278	15 689	13 881	Equifax, Inc.	255	46 405	59 503
Caterpillar, Inc.	3 003	507 823	515 724	Exponent, Inc.	93	8 799	10 218
Cummins, Inc.	844	172 871	198 524	TransUnion	124	13 548	14 652
Deere & Co.	1 061	216 702	226 361	Verisk Analytics, Inc.	207	41 389	47 830
Donaldson Co., Inc.	352	21 885	22 231	Total services professionnels		110 141	132 203
Dover Corp.	477	52 374	62 530	Transport routier et ferroviaire – 2,7 %			
Flowserve Corp.	384	22 251	14 868	CSX Corp.	1 977	165 588	187 180
Fortive Corp.	239	22 338	21 953	JB Hunt Transport Services, Inc.	186	26 392	30 387
Graco, Inc.	397	24 003	25 865	Kansas City Southern	195	38 851	39 522
IDEX Corp.	175	33 059	37 547	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	220	10 991	12 458
Illinois Tool Works, Inc.	1 492	293 965	354 165	Landstar System, Inc.	52	7 203	7 929
ITT, Inc.	130	9 090	10 367	Norfolk Southern Corp.	1 001	209 025	238 592
John Bean Technologies Corp.	23	3 047	2 686	Old Dominion Freight Line, Inc.	85	12 379	19 570
Lincoln Electric Holdings, Inc.	241	26 997	27 562	Union Pacific Corp.	2 923	580 059	670 915
Nordson Corp.	101	18 140	26 013	Total transport routier et ferroviaire		1 050 488	1 206 553

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

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

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Matériel et produits semi-conducteurs - 7,6 %			
Analog Devices, Inc.	981	122 273	163 333
Applied Materials, Inc.	1 926	114 151	158 061
Brooks Automation, Inc.	96	5 081	5 766
Cabot Microelectronics Corp.	59	8 056	11 177
Entegris, Inc.	123	8 214	9 860
Intel Corp.	13 812	917 434	1 121 883
KLA Corp.	464	79 145	122 508
Lam Research Corp.	341	88 728	149 743
Maxim Integrated Products, Inc.	1 296	93 985	106 640
MKS Instruments, Inc.	54	6 766	8 302
Monolithic Power Systems, Inc.	56	10 338	18 018
NVIDIA Corp.	257	75 080	132 552
QUALCOMM, Inc.	4 707	527 281	582 852
Skyworks Solutions, Inc.	391	47 652	67 871
Teradyne, Inc.	128	11 280	14 686
Texas Instruments, Inc.	3 875	533 613	667 951
Universal Display Corp.	11	1 729	2 234
Xilinx, Inc.	556	59 929	74 267
Total matériel et produits semi-conducteurs		2 710 735	3 417 704
Logiciels - 7,7 %			
Citrix Systems, Inc.	239	36 534	47 992
Intuit, Inc.	311	87 490	125 055
Microsoft Corp.	9 494	1 528 072	2 623 052
Oracle Corp.	8 433	593 810	632 766
SS&C Technologies Holdings, Inc.	308	23 430	23 617
Total logiciels		2 269 336	3 452 482
Commerce de détail spécialisé - 1,9 %			
Aaron's, Inc.	32	1 710	1 972
Advance Auto Parts, Inc.	23	3 859	4 448
Best Buy Co., Inc.	1 225	110 174	145 135
Lithia Motors, Inc.	32	5 942	6 574
Lowe's Cos., Inc.	2 750	355 604	504 457
Tiffany & Co.	396	57 076	65 556
Tractor Supply Co.	331	36 221	59 222
Williams-Sonoma, Inc.	408	29 376	45 426
Total commerce de détail spécialisé		599 962	832 790
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques - 5,9 %			
Apple, Inc.	5 332	1 484 882	2 640 686
Textiles, vêtements et articles de luxe - 0,8 %			
Hanesbrands, Inc.	2 831	49 246	43 391
NIKE, Inc.	2 403	251 503	319 870
Total textiles, vêtements et articles de luxe		300 749	363 261
Tabac - 2,9 %			
Altria Group, Inc.	24 110	1 584 211	1 284 721
Sociétés commerciales et de distribution - 0,7 %			
Air Lease Corp.	271	15 069	10 776
Fastenal Co.	2 627	104 177	152 785
MSC Industrial Direct Co., Inc.	345	33 991	34 102
W.W. Grainger, Inc.	177	63 445	75 491

Placements	Actions	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Watsco, Inc.	219	51 175	52 833
Total sociétés commerciales et de distribution		267 857	325 987
Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille (note 2)		(445)	
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,4 %		39 418 583	44 526 705
Contrats de change (annexe 1) - 0,7 %			294 770
Passif en excédent des autres actifs - (0,1)%			(45 756)
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %			44 775 719 \$

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

ANNEXE 1 : CONTRATS DE CHANGE

Date de règlement	Contrats à livrer	En échange de	Profit (perte) latent(e)	Note de crédit*
7/2/2020	46 646 USD	63 757 CAD	430 \$	A+
7/2/2020	84 857 CAD	62 040 USD	(631)	A+
7/2/2020	510 307 USD	690 102 CAD	(2 691)	A+
7/2/2020	4 972 376 USD	6 845 818 CAD	95 320	A
7/2/2020	5 283 075 USD	7 273 680 CAD	101 377	A+
7/2/2020	5 283 148 USD	7 273 680 CAD	101 278	A+
7/2/2020	7 039 497 CAD	5 185 251 USD	-	A
7/2/2020	7 479 463 CAD	5 509 246 USD	(110)	A+
7/2/2020	7 479 463 CAD	5 509 218 USD	(149)	A+
8/4/2020	1 740 303 USD	2 362 374 CAD	(52)	A
8/4/2020	1 849 020 USD	2 510 020 CAD	13	A+
8/4/2020	1 849 040 USD	2 510 020 CAD	(15)	A+
			294 770 \$	

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

LÉGENDE DES DEVICES

CAD Dollar canadien
USD Dollar américain

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	153 314 749 \$	160 978 674 \$
Trésorerie	992 197	1 341 145
Créances :		
Titres de placement vendus	5 375 506	1 336 475
Intérêts	815 494	1 022 507
Total de l'actif	160 497 946	164 678 801
PASSIF		
Passifs courants		
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	5 947 725	2 256 843
Distributions	346 666	324 529
Frais de gestion	11 019	18 678
Total du passif	6 305 410	2 600 050
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	154 192 536 \$	162 078 751 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	154 192 536	162 078 751
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	2 913 163	3 213 163
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	52,93 \$	50,44 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	1 572 844 \$	1 180 674 \$
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	6 068 389	7 576 267
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	7 641 233	8 756 941
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	2 437 796	2 210 905
Variation de la plus-value (moins-value) latente des opérations en devises	164	(149)
Total des autres revenus (pertes)	2 437 960	2 210 756
Total des revenus (pertes)	10 079 193	10 967 697
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	154 402	129 665
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	4 417	4 366
Retenues d'impôt étranger	627	(15)
Total des charges	159 446	134 016
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(4 417)	(4 366)
Charges nettes	155 029	129 650
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	9 924 164 \$	10 838 047 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	3 059 317	2 704 876
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	3,24 \$	4,01 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	162 078 751 \$	115 006 909 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	9 924 164	10 838 047
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(2 267 499)	(2 205 088)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(2 267 499)	(2 205 088)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	—	29 458 598
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(15 542 880)	(15 157 160)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(15 542 880)	14 301 438
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	154 192 536 \$	137 941 306 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	9 924 164 \$	10 838 047 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(1 572 844)	(1 180 674)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(6 068 389)	(7 576 267)
(Plus-value) moins-value latente à la conversion des devises	(164)	149
Achat de placements ¹	(29 562 056)	(31 484 095)
Produit de la vente de placements ¹	29 436 616	25 445 943
Variation des créances	(3 832 018)	(643 483)
Variation des créditeurs	3 683 223	1 324 773
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	2 008 532	(3 275 607)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	–	5 755 449
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(112 282)	(136 638)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(2 245 362)	(2 196 272)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	(2 357 644)	3 422 539
(Plus-value) moins-value latente des opérations en devises	164	(149)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(348 948)\$	146 783 \$
Trésorerie au début de la période	1 341 145 \$	861 258 \$
Trésorerie à la fin de la période	992 197 \$	1 008 041 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	(627)\$	– \$
Intérêts reçus	2 644 809	2 101 410

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS - 31,2 %									
407 International, Inc.					4,09 %, 6/30/45	A	166 000	198 975	215 288
3,43 %, 6/1/33	A	19 000	19 048	21 619	3,72 %, 12/3/46	A	109 000	115 658	135 600
5,96 %, 12/3/35	A	119 000	159 448	172 378	4,45 %, 7/11/53	A	83 000	105 136	117 870
5,75 %, 2/14/36	BBB	49 000	62 469	65 371	ATCO Ltd.				
4,45 %, 11/15/41	A	46 000	55 232	59 712	5,50 %, 11/1/78	BBB	63 000	62 730	68 026
4,19 %, 4/25/42	A	86 000	99 602	109 157	Banque de Montréal				
3,65 %, 9/8/44	A	27 000	27 188	31 959	2,57 %, 6/1/27	BBB+	16 000	16 146	16 324
3,30 %, 3/27/45	A	37 000	34 703	41 984	La Banque de Nouvelle-Écosse				
3,83 %, 5/11/46	A	178 000	199 166	217 554	2,58 %, 3/30/27	BBB+	145 000	146 282	147 772
3,60 %, 5/21/47	A	45 000	44 215	53 471	3,89 %, 1/18/29	BBB+	233 000	244 922	249 163
3,72 %, 5/11/48	A	122 000	131 261	148 432	2,84 %, 7/3/29	BBB+	121 000	121 698	125 342
3,67 %, 3/8/49	A	235 000	256 439	284 552	Bell Canada, Inc.				
2,84 %, 3/7/50	A	100 000	98 917	105 411	3,15 %, 9/29/21	BBB+	47 000	47 004	48 169
3,98 %, 9/11/52	A	162 000	184 476	208 447	2,00 %, 10/1/21	BBB+	67 000	66 618	67 842
4,68 %, 10/7/53	A	88 000	103 950	128 848	3,00 %, 10/3/22	BBB+	18 000	17 896	18 700
55 Ontario School Board Trust (The)					3,35 %, 3/22/23	BBB+	96 000	96 698	100 892
5,90 %, 6/2/33	A+	240 000	325 023	349 740	4,70 %, 9/11/23	BBB+	65 000	69 426	71 265
Aéroports de Montréal					2,70 %, 2/27/24	BBB+	80 000	79 364	83 462
6,95 %, 4/16/32	Non noté	117 027	154 568	153 680	2,75 %, 1/29/25	BBB+	28 000	28 476	29 452
6,55 %, 10/11/33	Non noté	13 000	17 709	19 008	3,35 %, 3/12/25	BBB+	131 000	129 223	141 143
5,17 %, 9/17/35	Non noté	50 000	62 091	66 475	3,55 %, 3/2/26	BBB+	283 000	285 079	310 359
5,47 %, 4/16/40	Non noté	119 000	155 518	170 908	2,90 %, 8/12/26	BBB+	64 000	61 796	68 032
3,03 %, 4/21/50	Non noté	200 000	202 780	218 023	3,60 %, 9/29/27	BBB+	253 000	253 682	280 900
Alberta Powerline L.P.					3,80 %, 8/21/28	BBB+	302 000	303 745	340 899
4,07 %, 12/1/53	Non noté	192 060	220 581	229 404	2,90 %, 9/10/29	BBB+	129 000	128 056	137 760
4,07 %, 3/1/54	Non noté	129 802	136 174	152 426	7,85 %, 4/2/31	BBB+	105 000	147 048	154 401
Alectra, Inc.					7,65 %, 12/30/31	BBB	38 000	49 933	55 261
5,30 %, 4/29/41	A	58 000	72 625	85 462	7,30 %, 2/23/32	BBB+	100 000	134 037	143 192
3,96 %, 7/30/42	A	131 000	147 152	165 777	6,10 %, 3/16/35	BBB+	111 000	136 800	149 644
Algonquin Power Co.					4,45 %, 2/27/47	BBB+	29 000	30 956	35 171
4,65 %, 2/15/22	BBB	13 000	13 483	13 630	Bridging North America G.P.				
4,09 %, 2/17/27	BBB	70 000	71 672	77 344	4,34 %, 8/31/53	BBB-	145 000	169 850	175 718
4,60 %, 1/29/29	BBB	88 000	90 892	99 535	British Columbia Ferry Services, Inc.				
Alimentation Couche-Tard Inc.					5,02 %, 3/20/37	AA-	76 000	94 616	101 981
3,90 %, 11/1/22	BBB	36 000	36 801	38 131	5,58 %, 1/11/38	AA-	72 000	98 836	102 909
3,06 %, 7/26/24	BBB	19 000	19 276	20 018	4,70 %, 10/23/43	AA-	48 000	57 343	65 786
3,60 %, 6/2/25	BBB	273 000	281 239	295 305	4,29 %, 4/28/44	AA-	94 000	117 408	122 631
Alliance Pipeline L.P.					Brookfield Asset Management, Inc.				
7,18 %, 6/30/23	BBB+	11 889	13 111	13 098	5,95 %, 6/14/35	A-	86 000	100 931	107 988
Fonds de placement immobilier					Brookfield Infrastructure Finance ULC				
Allied					3,45 %, 3/11/22	BBB+	66 000	66 167	67 761
3,93 %, 11/14/22	Non noté	11 000	11 115	11 516	4,19 %, 9/11/28	BBB+	245 000	239 472	269 131
3,64 %, 4/21/25	Non noté	57 000	54 542	60 193	3,41 %, 10/9/29	BBB+	184 000	187 898	189 435
3,39 %, 8/15/29	Non noté	145 000	145 149	150 237	Brookfield Property Finance ULC				
3,12 %, 2/21/30	Non noté	250 000	253 805	252 214	4,12 %, 10/19/21	BBB-	23 000	23 606	23 165
AltaGas Ltd.					4,35 %, 7/3/23	BBB-	14 000	14 080	14 190
3,57 %, 6/12/23	BBB-	29 000	28 561	30 488	4,30 %, 3/1/24	BBB-	21 000	21 110	21 212
4,40 %, 3/15/24	BBB-	61 000	63 357	66 314	3,93 %, 1/15/27	BBB-	150 000	154 194	147 501
3,84 %, 1/15/25	BBB-	148 000	153 550	159 818	Brookfield Renewable Partners ULC				
3,98 %, 10/4/27	BBB-	68 000	67 904	75 331	4,79 %, 2/7/22	BBB+	40 000	41 844	42 080
AlliaLink L.P.					3,75 %, 6/2/25	BBB+	135 000	139 370	145 789
5,25 %, 9/22/36	A	83 000	102 953	113 746	3,63 %, 1/15/27	BBB+	176 000	175 682	191 895
4,87 %, 11/15/40	A	48 000	62 102	66 278	4,25 %, 1/15/29	BBB+	88 000	87 876	99 738
4,46 %, 11/8/41	A	31 000	37 162	41 136	3,38 %, 1/15/30	BBB+	142 000	143 491	152 202
3,99 %, 6/30/42	A	113 000	126 983	141 787	5,84 %, 11/5/36	BBB+	58 000	66 677	74 807
4,92 %, 9/17/43	A	96 000	119 583	137 136	4,29 %, 11/5/49	BBB+	36 000	36 734	40 322
4,05 %, 11/21/44	A	67 000	70 934	85 901					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Bruce Power L.P.					Fiducie de capital CIBC				
3,00 %, 6/21/24	BBB	4 000	3 929	4 212	10,25 %, 6/30/08	BBB-	110 000	134 632	124 104
3,97 %, 6/23/26	BBB	73 000	75 539	80 843	Coast Capital Savings Federal Credit Union				
4,01 %, 6/21/29	BBB	241 000	250 771	271 848	5,00 %, 5/3/28	Non noté	18 000	18 274	18 874
4,13 %, 6/21/33	BBB	135 000	139 529	153 226	Cogeco Communications, Inc.				
Corporation Cameco					4,93 %, 2/14/22	BBB-	6 000	6 265	6 304
3,75 %, 11/14/22	BBB-	25 000	24 934	25 821	4,18 %, 5/26/23	BBB-	6 000	6 117	6 333
4,19 %, 6/24/24	BBB-	112 000	111 308	117 473	Comber Wind Financial Corp.				
Canada Life Capital Trust					5,13 %, 11/15/30	Non noté	84 720	92 238	98 442
7,53 %, 6/30/32	A+	145 000	210 222	209 560	Université Concordia				
Banque Canadienne Impériale de Commerce					6,55 %, 9/2/42	Non noté	69 000	104 873	118 930
3,30 %, 5/26/25	A+	357 000	376 353	393 912	Fonds de placement immobilier Crombie				
2,95 %, 6/19/29	BBB	21 000	21 215	21 816	3,96 %, 6/1/21	Non noté	6 000	6 053	6 085
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada					4,80 %, 1/31/25	Non noté	44 000	43 972	47 177
3,95 %, 9/22/45	A	147 000	169 806	183 603	Crosslinx Transit Solutions G.P.				
3,60 %, 8/1/47	A	95 000	96 951	113 697	4,65 %, 9/30/46	Non noté	295 000	314 913	358 052
3,60 %, 7/31/48	A	188 000	202 995	225 734	CSS FSCC Partnership				
3,60 %, 2/8/49	A	188 000	199 361	224 839	6,92 %, 7/31/42	A-	30 681	40 156	46 160
Canadian Natural Resources Ltd.					Fiducie de placement immobilier CT				
3,31 %, 2/11/22	BBB	42 000	42 383	43 004	2,16 %, 6/1/21	BBB	1 000	980	1 000
3,42 %, 12/1/26	BBB	388 000	386 284	404 593	2,85 %, 6/9/22	BBB	5 000	4 931	5 067
Compagnie des chemins de fer Canadien Pacifique					3,53 %, 6/9/25	BBB	32 000	31 632	33 011
3,15 %, 3/13/29	BBB+	126 000	127 550	139 098	3,29 %, 6/1/26	BBB	121 000	116 174	122 947
Société Canadian Tire Limitée					3,47 %, 6/16/27	BBB	47 000	43 851	48 242
3,17 %, 7/6/23	BBB	38 000	37 601	39 339	3,87 %, 12/7/27	BBB	80 000	77 504	83 776
6,38 %, 4/13/28	BBB	73 000	87 405	87 744	CU, Inc.				
5,61 %, 9/4/35	BBB	56 000	65 885	64 683	5,90 %, 11/20/34	A-	36 000	45 723	49 925
Capital City Link G.P.					5,18 %, 11/21/35	A-	96 000	113 838	127 139
4,39 %, 3/31/46	A-	125 592	133 876	152 739	5,03 %, 11/20/36	A-	69 000	84 147	91 721
Capital Power Corp.					5,56 %, 10/30/37	A-	158 000	211 131	224 284
4,28 %, 9/18/24	BBB-	318 000	323 053	337 578	4,54 %, 10/24/41	A-	117 000	139 903	154 777
CCL Industries, Inc.					3,81 %, 9/10/42	A-	42 000	42 114	50 566
3,86 %, 4/13/28	BBB	91 000	90 924	100 236	4,72 %, 9/9/43	A-	175 000	218 396	239 862
Chartwell, résidences pour retraités					4,09 %, 9/2/44	A-	241 000	273 786	306 030
3,79 %, 12/11/23	Non noté	90 000	89 776	91 358	3,96 %, 7/27/45	A-	104 000	117 441	129 691
Propriétés de Choix S.E.C.					3,76 %, 11/19/46	A-	168 000	180 170	204 616
3,60 %, 9/20/21	Non noté	109 000	111 536	111 242	3,55 %, 11/22/47	A-	73 000	75 125	86 704
3,60 %, 9/20/22	Non noté	52 000	52 733	53 964	3,95 %, 11/23/48	A-	36 000	36 180	45 931
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix					2,96 %, 9/7/49	A-	165 000	164 010	177 497
3,01 %, 3/21/22	BBB	13 000	12 841	13 307	4,56 %, 11/7/53	A-	65 000	77 675	92 878
3,20 %, 3/7/23	BBB	5 000	4 945	5 185	4,21 %, 10/29/55	A-	109 000	128 157	149 898
4,90 %, 7/5/23	BBB	16 000	16 792	17 337	4,59 %, 10/24/61	A-	67 000	79 321	99 748
4,29 %, 2/8/24	BBB	57 000	58 214	61 429	3,83 %, 9/11/62	A-	134 000	146 178	172 745
3,56 %, 9/9/24	BBB	31 000	31 100	32 876	Dollarama, Inc.				
4,06 %, 11/24/25	BBB	103 000	104 205	112 385	2,34 %, 7/22/21	Non noté	31 000	30 290	31 399
4,18 %, 3/8/28	BBB	334 000	352 071	371 481	2,20 %, 11/10/22	Non noté	8 000	7 662	8 181
3,53 %, 6/11/29	BBB	315 000	319 823	335 385	3,55 %, 11/6/23	Non noté	31 000	30 996	33 094
CI Financial Corp.					Emera, Inc.				
3,90 %, 9/27/27	BBB	166 000	167 589	169 080	2,90 %, 6/16/23	BBB-	24 000	23 387	24 821
					Enbridge Gas, Inc.				
					6,16 %, 12/16/33	A-	39 000	49 677	56 098
					5,21 %, 2/25/36	A-	66 000	81 923	88 820
					5,46 %, 9/11/36	A-	27 000	33 230	37 158
					6,05 %, 9/2/38	A-	115 000	165 603	172 930
					4,88 %, 6/21/41	A-	99 000	121 629	134 453

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
4,50 %, 11/23/43	A-	92 000	111 243	122 833	3,73 %, 9/18/48	A-	37 000	36 945	45 159
4,20 %, 6/2/44	A-	125 000	133 773	161 386	FortisBC Energy, Inc.				
4,00 %, 8/22/44	A-	73 000	79 497	91 521	5,90 %, 2/26/35	Non noté	39 000	49 790	55 062
3,80 %, 6/1/46	A-	19 000	19 259	23 242	6,00 %, 10/2/37	Non noté	62 000	83 179	92 210
3,59 %, 11/22/47	A-	195 000	209 930	232 371	6,05 %, 2/15/38	Non noté	184 000	266 601	276 059
3,51 %, 11/29/47	A-	78 000	79 616	92 224	3,67 %, 4/9/46	Non noté	14 000	14 017	17 000
3,01 %, 8/9/49	A-	126 000	128 766	137 571	3,78 %, 3/6/47	Non noté	13 000	13 261	16 040
4,95 %, 11/22/50	A-	86 000	108 288	129 240	3,69 %, 10/30/47	Non noté	61 000	67 720	74 644
Enbridge Pipelines, Inc.					3,85 %, 12/7/48	Non noté	131 000	141 987	165 137
2,93 %, 11/30/22	BBB+	43 000	43 495	44 617	2,82 %, 8/9/49	Non noté	48 000	47 051	50 754
3,79 %, 8/17/23	BBB+	26 000	26 779	27 715	Société de financement GE				
3,45 %, 9/29/25	BBB+	115 000	117 902	124 460	Capital Canada				
3,00 %, 8/10/26	BBB+	171 000	168 262	181 674	4,60 %, 1/26/22	BBB+	107 000	110 792	110 669
3,52 %, 2/22/29	BBB+	227 000	240 378	250 833	5,73 %, 10/22/37	BBB+	65 000	68 636	68 625
Enbridge, Inc.					General Motors Financial of				
3,19 %, 12/5/22	BBB+	68 000	69 401	70 649	Canada Ltd.				
3,94 %, 1/13/23	BBB+	13 000	13 308	13 776	2,60 %, 6/1/22	BBB	5 000	4 782	4 966
3,95 %, 11/19/24	BBB+	97 000	103 344	105 540	Genworth MI Canada, Inc.				
3,20 %, 6/8/27	BBB+	79 000	75 683	84 054	4,24 %, 4/1/24	BBB+	37 000	37 022	37 986
2,99 %, 10/3/29	BBB+	200 000	204 190	209 275	George Weston limitée				
7,22 %, 7/24/30	BBB+	56 000	70 912	76 254	4,12 %, 6/17/24	BBB	118 000	120 796	128 356
7,20 %, 6/18/32	BBB+	51 000	65 841	70 932	Gibson Energy, Inc.				
5,57 %, 11/14/35	BBB+	100 000	117 809	124 641	3,60 %, 9/17/29	BBB-	233 000	235 705	241 054
Engrjr, Inc.					Granite REIT Holdings L.P.				
5,70 %, 7/10/36	A	73 000	103 013	105 662	3,79 %, 7/5/21	Non noté	5 000	5 062	5 096
3,53 %, 5/16/47	A	47 000	46 210	57 323	3,87 %, 11/30/23	Non noté	36 000	36 260	38 129
ENMAX Corp.					Great-West Lifeco, Inc.				
3,84 %, 6/5/28	BBB-	119 000	119 475	130 275	6,74 %, 11/24/31	A+	39 000	51 381	55 008
EPCOR Utilities, Inc.					6,67 %, 3/21/33	A+	39 000	51 615	55 373
6,65 %, 4/15/38	A-	139 000	209 209	218 778	6,00 %, 11/16/39	A+	117 000	161 102	164 395
5,75 %, 11/24/39	A-	35 000	47 831	51 930	Fonds de placement immobilier				
4,55 %, 2/28/42	A-	30 000	34 239	39 751	H&R				
3,55 %, 11/27/47	A-	179 000	189 986	212 180	3,37 %, 1/30/24	Non noté	81 000	79 147	80 552
3,95 %, 11/26/48	A-	16 000	16 196	20 459	Administration de l'aéroport				
3,11 %, 7/8/49	A-	70 000	69 875	77 009	international d'Halifax				
Fairfax Financial Holdings Ltd.					5,50 %, 7/19/41	AA-	39 000	56 352	57 430
5,84 %, 10/14/22	BBB-	19 000	20 619	20 294	Heathrow Funding Ltd				
4,50 %, 3/22/23	BBB-	34 000	35 100	35 380	3,78 %, 9/4/32	BBB+	194 000	210 876	203 341
4,95 %, 3/3/25	BBB-	38 000	40 022	40 833	Hospital for Sick Children (The)				
4,70 %, 12/16/26	BBB-	109 000	112 281	116 178	3,42 %, 12/7/57	A+	194 000	220 869	247 507
4,25 %, 12/6/27	BBB-	116 000	116 526	120 446	Hospital Infrastructure Partners				
4,23 %, 6/14/29	BBB-	242 000	242 883	247 415	(NOH) Partnership				
Finning International, Inc.					5,44 %, 1/31/45	BBB+	93 738	120 067	126 081
2,63 %, 8/14/26	BBB+	155 000	155 815	157 371	Husky Energy, Inc.				
5,08 %, 6/13/42	BBB+	40 000	45 388	47 315	3,55 %, 3/12/25	BBB	216 000	216 512	215 252
First Capital Real Estate					3,60 %, 3/10/27	BBB	275 000	276 455	265 565
Investment Trust					Hydro One, Inc.				
4,43 %, 1/31/22	BBB-	8 000	8 257	8 181	2,97 %, 6/26/25	A-	71 000	73 681	76 877
3,95 %, 12/5/22	BBB-	65 000	67 838	66 345	6,93 %, 6/1/32	A-	134 000	191 037	200 333
3,90 %, 10/30/23	BBB-	24 000	25 102	24 511	6,35 %, 1/31/34	A-	160 000	228 512	233 370
4,79 %, 8/30/24	BBB-	40 000	42 467	42 003	5,36 %, 5/20/36	A-	299 000	387 037	410 376
4,32 %, 7/31/25	BBB-	85 000	89 332	88 090	4,89 %, 3/13/37	A-	145 000	177 141	191 488
3,60 %, 5/6/26	BBB-	104 000	104 876	103 259	6,03 %, 3/3/39	A-	102 000	141 977	154 651
3,75 %, 7/12/27	BBB-	224 000	226 265	221 644	5,49 %, 7/16/40	A-	19 000	24 125	27 688
Fortis, Inc.					4,39 %, 9/26/41	A-	74 000	83 027	96 023
2,85 %, 12/12/23	BBB+	110 000	110 401	115 221	6,59 %, 4/22/43	A-	91 000	131 284	153 867
FortisAlberta, Inc.					4,59 %, 10/9/43	A-	75 000	83 388	101 248
4,85 %, 9/11/43	A-	88 000	108 240	121 675	4,17 %, 6/6/44	A-	125 000	130 762	160 257
3,34 %, 9/21/46	A-	84 000	80 167	95 572					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
3,91 %, 2/23/46	A-	35 000	36 226	43 790	3,21 %, 9/29/50	AA-	162 000	170 734	186 389
5,00 %, 10/19/46	A-	31 000	36 650	45 570	2,92 %, 9/29/51	AA-	150 000	165 292	163 994
3,72 %, 11/18/47	A-	192 000	212 705	235 219	North West Redwater Partnership				
3,63 %, 6/25/49	A-	205 000	221 249	249 514	2,10 %, 2/23/22	BBB+	131 000	127 350	132 655
3,64 %, 4/5/50	A-	255 000	270 687	312 639	3,20 %, 7/22/24	BBB+	145 000	145 982	153 373
3,79 %, 7/31/62	A-	19 000	18 991	24 766	3,20 %, 4/24/26	BBB+	24 000	23 658	25 718
Société de portefeuille d'Hydro Ottawa inc.					2,80 %, 6/1/27	BBB+	280 000	267 274	293 888
2,61 %, 2/3/25	Non noté	196 000	189 783	208 017	4,25 %, 6/1/29	BBB+	227 000	245 711	260 954
iA Financial Corp., Inc.					4,15 %, 6/1/33	BBB+	32 000	34 340	36 772
3,07 %, 9/24/31	A-	150 000	151 269	157 809	Northern Courier Pipeline L.P.				
IGM Financial, Inc.					3,37 %, 6/30/42	Non noté	258 116	270 927	283 003
7,11 %, 3/7/33	A	73 000	100 340	100 728	Nouvelle Autoroute 30 Financement, Inc.				
6,00 %, 12/10/40	A	111 000	144 328	148 239	3,74 %, 12/31/32	BBB+	120 786	118 005	134 279
4,56 %, 1/25/47	A	21 000	21 993	24 447	4,11 %, 3/31/42	BBB+	30 981	31 346	37 294
4,17 %, 7/13/48	A	145 000	150 179	159 931	4,12 %, 6/30/42	BBB+	29 947	30 056	35 788
4,21 %, 3/21/50	A	68 000	71 242	75 609	Nova Scotia Power, Inc.				
InPower BC G.P.					6,95 %, 8/25/33	BBB+	56 000	76 287	82 718
4,47 %, 3/31/33	Non noté	101 664	105 467	117 510	5,67 %, 11/14/35	BBB+	59 000	72 151	80 855
Intact Corporation financière					4,15 %, 3/6/42	BBB+	42 500	44 832	51 717
6,40 %, 11/23/39	Non noté	104 000	145 462	153 571	Corporation Immobilière OMERS				
5,16 %, 6/16/42	Non noté	26 000	31 136	34 514	3,33 %, 11/12/24	Non noté	4 000	4 081	4 355
Integrated Team Solutions PCH Partnership					Ontario Power Generation, Inc.				
4,88 %, 5/31/46	A-	116 625	131 166	149 520	3,32 %, 10/4/27	BBB+	123 000	126 587	136 051
Inter Pipeline Ltd.					3,84 %, 6/22/48	BBB+	78 000	84 952	92 708
2,61 %, 9/13/23	BBB-	19 000	18 561	18 960	Original Wempi, Inc.				
2,73 %, 4/18/24	BBB-	98 000	95 306	98 097	4,06 %, 2/13/24	Non noté	2 120	2 161	2 272
3,17 %, 3/24/25	BBB-	193 000	194 799	194 995	Pembina Pipeline Corp.				
3,48 %, 12/16/26	BBB-	121 000	118 746	122 564	3,43 %, 11/10/21	BBB	44 000	44 185	45 085
Keyera Corp.					3,77 %, 10/24/22	BBB	8 000	8 108	8 385
3,93 %, 6/21/28	BBB-	146 000	145 097	154 921	2,99 %, 1/22/24	BBB	41 000	40 041	42 551
Banque Laurentienne du Canada					3,54 %, 2/3/25	BBB	243 000	246 564	258 302
3,00 %, 9/12/22	BBB	15 000	14 695	15 267	3,71 %, 8/11/26	BBB	129 000	128 741	139 306
3,45 %, 6/27/23	BBB	102 000	100 844	105 503	4,24 %, 6/15/27	BBB	171 000	178 809	190 150
Les Compagnies Loblaw limitée					4,02 %, 3/27/28	BBB	121 000	125 775	133 484
4,86 %, 9/12/23	BBB	72 000	78 699	79 512	3,62 %, 4/3/29	BBB	121 000	122 269	130 024
4,49 %, 12/11/28	BBB	139 000	157 212	166 457	3,31 %, 2/1/30	BBB	266 000	266 798	279 980
6,50 %, 1/22/29	BBB	80 000	95 718	106 545	4,75 %, 4/30/43	BBB	61 000	59 603	67 931
Lower Mattagami Energy L.P.					4,54 %, 4/3/49	BBB	63 000	67 687	68 884
3,42 %, 6/20/24	Non noté	119 000	122 324	129 945	Penske Truck Leasing Canada, Inc.				
4,18 %, 4/23/52	Non noté	40 000	43 312	54 534	2,85 %, 12/7/22	BBB	21 000	20 589	21 186
Manulife Finance Delaware L.P.					Plenary Health Care Partnerships Humber L.P.				
5,06 %, 12/15/41	A-	136 000	153 812	161 114	4,90 %, 5/31/39	A-	2 654	2 967	3 306
Université McGill					Plenary Properties LTAP L.P.				
6,15 %, 9/22/42	AA-	45 000	62 883	72 465	6,29 %, 1/31/44	A	256 680	347 373	368 853
Metro, Inc.					Power Corporation du Canada				
3,20 %, 12/1/21	BBB	26 000	25 973	26 767	4,81 %, 1/31/47	A+	107 000	125 837	129 115
2,68 %, 12/5/22	BBB	55 000	54 435	57 011	4,46 %, 7/27/48	A+	41 000	41 855	47 340
3,39 %, 12/6/27	BBB	160 000	161 215	177 436	Corporation Financière Power				
5,97 %, 10/15/35	BBB	82 000	98 289	110 878	6,90 %, 3/11/33	A+	43 000	55 359	57 663
Corporation Morguard					Reliance L.P.				
4,33 %, 9/15/22	Non noté	21 000	20 915	21 108	4,08 %, 8/2/21	BBB-	86 000	87 442	87 538
Banque Nationale du Canada					3,84 %, 3/15/25	BBB-	61 000	59 911	63 977
3,18 %, 2/1/28	BBB	52 000	50 592	53 805	3,75 %, 3/15/26	BBB-	140 000	141 880	145 113
NAV Canada					Fonds de placement immobilier RioCan				
7,56 %, 3/1/27	AA	65 839	77 808	80 778	2,83 %, 10/3/22	BBB	22 000	21 529	22 237
3,53 %, 2/23/46	AA-	56 000	57 907	66 921					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
3,73 %, 4/18/23	BBB	41 000	42 730	42 442	4,75 %, 1/17/45	BBB+	109 000	119 041	134 871
3,21 %, 9/29/23	BBB	31 000	30 856	31 611	Teranet Holdings L.P.				
3,29 %, 2/12/24	BBB	22 000	22 026	22 514	3,65 %, 11/18/22	BBB	15 000	15 353	15 412
2,58 %, 2/12/25	BBB	189 000	188 720	187 546	5,75 %, 12/17/40	BBB	99 000	107 815	108 855
Rogers Communications Inc.					Industries Toromont Ltée				
4,00 %, 6/6/22	BBB+	51 000	52 494	53 872	3,71 %, 9/30/25	Non noté	176 000	178 301	189 322
4,00 %, 3/13/24	BBB+	126 000	131 494	137 525	3,84 %, 10/27/27	Non noté	142 000	143 528	155 606
3,25 %, 5/1/29	BBB+	433 000	438 702	475 995	Toronto Hydro Corp.				
Banque Royale du Canada					3,54 %, 11/18/21	A	156 000	160 849	161 899
3,30 %, 9/26/23	A	300 000	315 426	319 216	5,54 %, 5/21/40	A	22 000	27 822	32 477
2,09 %, 6/30/30	A-	500 000	501 700	501 492	4,08 %, 9/16/44	A	88 000	92 869	114 015
Saputo inc.					TransCanada PipeLines Ltd.				
3,60 %, 8/14/25	Non noté	69 000	69 214	75 210	3,65 %, 11/15/21	BBB+	43 000	44 444	44 419
Fiducie de capital Banque Scotia					3,69 %, 7/19/23	BBB+	57 000	59 661	60 318
5,65 %, 12/31/56	BBB	100 000	122 699	120 913	3,30 %, 7/17/25	BBB+	256 000	261 641	273 933
SEC L.P. and Arci Ltd.					3,80 %, 4/5/27	BBB+	500 000	534 570	551 930
5,19 %, 8/29/33	Non noté	1 695	1 776	1 827	3,39 %, 3/15/28	BBB+	184 000	183 687	199 239
SGTP Highway Bypass L.P.					6,28 %, 5/26/28	BBB+	51 000	60 769	64 524
4,11 %, 1/31/45	Non noté	194 000	213 301	229 348	6,89 %, 8/7/28	BBB+	34 000	42 282	44 412
Shaw Communications, Inc.					3,00 %, 9/18/29	BBB+	305 000	307 583	323 660
3,80 %, 11/2/23	BBB-	52 000	52 423	55 709	4,35 %, 6/6/46	BBB+	96 000	100 837	109 066
4,35 %, 1/31/24	BBB-	37 000	39 433	40 298	4,34 %, 10/15/49	BBB+	74 000	77 240	84 645
3,80 %, 3/1/27	BBB-	100 000	99 982	109 888	Trillium Windpower L.P.				
4,40 %, 11/2/28	BBB-	145 000	145 156	168 111	5,80 %, 2/15/33	Non noté	58 100	64 989	71 335
3,30 %, 12/10/29	BBB-	384 000	384 726	409 832	TriSummit Utilities, Inc.				
4,25 %, 12/9/49	BBB-	110 000	115 813	121 504	3,15 %, 4/6/26	Non noté	88 000	88 532	94 154
SmartCentres REIT					4,26 %, 12/5/28	Non noté	224 000	240 846	258 716
2,88 %, 3/21/22	Non noté	7 000	6 892	7 098	Université de Toronto				
3,73 %, 7/22/22	Non noté	15 000	15 567	15 482	5,84 %, 12/15/43	AA+	17 000	23 831	27 333
3,56 %, 2/6/25	Non noté	47 000	45 790	49 072	4,25 %, 12/7/51	AA+	82 000	96 685	111 642
3,44 %, 8/28/26	Non noté	73 000	69 643	75 886	Université Western Ontario				
3,83 %, 12/21/27	Non noté	69 000	65 646	73 010	Ventas Canada Finance Ltd.				
3,53 %, 12/20/29	Non noté	242 000	243 914	247 930	4,80 %, 5/24/47	AA	25 000	29 760	36 183
SSL Finance, Inc.					Ventas Canada Finance Ltd.				
4,10 %, 10/31/45	Non noté	180 851	204 241	217 093	3,30 %, 2/1/22	BBB+	1 000	1 005	1 009
Fiducie de capital Sun Life					4,13 %, 9/30/24	BBB+	95 000	97 745	97 114
7,09 %, 6/30/52	A+	19 000	25 694	25 563	Waste Management of Canada Corp.				
Financière Sun Life inc.					2,60 %, 9/23/26	A-	189 000	190 317	200 070
5,40 %, 5/29/42	A	123 000	151 500	154 480	Westcoast Energy, Inc.				
Suncor Énergie Inc.					3,12 %, 12/5/22	BBB+	18 000	17 940	18 759
3,10 %, 5/24/29	BBB+	73 000	74 274	75 900	3,43 %, 9/12/24	BBB+	99 000	100 826	106 292
4,34 %, 9/13/46	BBB+	149 000	172 828	164 550	3,77 %, 12/8/25	BBB+	186 000	190 557	204 553
Sysco Canada, Inc.					7,15 %, 3/20/31	BBB+	83 000	107 091	116 658
3,65 %, 4/25/25	BBB-	231 000	241 269	236 359	Université York				
TELUS Communications, Inc.					6,48 %, 3/7/42	A+	39 000	56 160	64 581
9,65 %, 4/8/22	BBB+	6 000	7 176	6 878	TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS		44 985 910	48 106 465	
8,80 %, 9/22/25	BBB+	57 000	73 327	76 479	OBLIGATIONS FÉDÉRALES - 22,2 %				
TELUS Corp.					Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1				
2,35 %, 3/28/22	BBB+	60 000	59 579	61 273	1,25 %, 6/15/21	AAA	2 000	1 974	2 018
3,35 %, 3/15/23	BBB+	40 000	40 948	42 008	3,80 %, 6/15/21	AAA	1 000	1 062	1 033
3,35 %, 4/1/24	BBB+	33 000	33 961	35 205	1,15 %, 12/15/21	AAA	341 000	333 273	345 034
3,75 %, 1/17/25	BBB+	102 000	106 665	111 444	1,50 %, 12/15/21	AAA	481 000	477 679	489 122
3,75 %, 3/10/26	BBB+	146 000	148 565	161 606	2,65 %, 3/15/22	AAA	761 000	787 426	790 603
2,75 %, 7/8/26	BBB+	305 000	309 105	322 600	1,75 %, 6/15/22	AAA	773 000	770 795	793 736
3,63 %, 3/1/28	BBB+	174 000	171 613	193 779	2,40 %, 12/15/22	AAA	1 605 000	1 653 967	1 682 481
3,30 %, 5/2/29	BBB+	380 000	384 479	416 814					
3,15 %, 2/19/30	BBB+	97 000	96 848	105 175					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
2,35 %, 6/15/23	AAA	539 000	546 569	568 618	5,00 %, 2/15/50	AA-	409 000	603 958	690 132
2,35 %, 9/15/23	AAA	40 000	40 112	42 346	4,00 %, 2/15/55	AA-	370 000	474 334	565 216
3,15 %, 9/15/23	AAA	103 000	107 743	111 655	Labrador-Island Link Funding Trust				
2,55 %, 12/15/23	AAA	919 000	948 134	982 517	3,86 %, 12/1/45	AAA	2 000	2 286	2 825
2,90 %, 6/15/24	AAA	1 483 000	1 595 917	1 617 456	Maritime Link Financing Trust				
1,80 %, 12/15/24	AAA	775 000	778 254	815 118	3,50 %, 12/1/52	AAA	179 000	188 959	220 951
2,55 %, 3/15/25	AAA	527 000	540 626	573 563	Newfoundland & Labrador Hydro				
0,95 %, 6/15/25	AAA	850 000	845 419	861 755	6,65 %, 8/27/31	A	39 000	51 768	57 245
1,95 %, 12/15/25	AAA	320 000	313 542	341 280	3,60 %, 12/1/45	A	145 000	165 518	171 423
2,25 %, 12/15/25	AAA	761 000	775 179	823 855	Société financière de l'industrie de l'électricité de l'Ontario				
1,90 %, 9/15/26	AAA	739 000	715 600	790 239	8,90 %, 8/18/22	A+	40 000	53 185	47 090
2,35 %, 6/15/27	AAA	951 000	952 453	1 050 289	8,25 %, 6/22/26	A+	539 000	762 051	762 203
2,35 %, 3/15/28	AAA	559 000	565 587	621 247	Société ontarienne des infrastructures et de l'immobilier				
2,65 %, 3/15/28	AAA	763 000	786 447	865 143	4,70 %, 6/1/37	Non noté	1 000	1 182	1 384
2,65 %, 12/15/28	AAA	657 000	673 761	751 289	OPB Finance Trust				
2,10 %, 9/15/29	AAA	820 000	836 461	905 136	2,95 %, 2/2/26	AA+	88 000	86 335	96 260
1,75 %, 6/15/30	AAA	850 000	906 479	913 185	2,98 %, 1/25/27	AA+	242 000	255 856	266 077
Obligations du gouvernement du Canada					Province d'Alberta				
1,50 %, 8/1/21	AAA	545 000	546 212	552 570	1,35 %, 9/1/21	A+	139 000	135 108	140 651
0,75 %, 9/1/21	AAA	1 309 000	1 283 509	1 317 253	2,55 %, 12/15/22	A+	259 000	262 228	271 817
1,25 %, 11/1/21	AAA	194 000	192 991	196 628	2,65 %, 9/1/23	A+	30 000	29 944	31 877
0,50 %, 3/1/22	AAA	773 000	739 332	776 386	3,40 %, 12/1/23	A+	10 000	10 413	10 914
1,50 %, 5/1/22	AAA	1 225 000	1 249 269	1 252 587	3,10 %, 6/1/24	A+	84 000	85 200	91 422
2,75 %, 6/1/22	AAA	249 000	257 974	261 018	2,35 %, 6/1/25	A+	489 000	492 549	521 934
0,25 %, 8/1/22	AAA	1 000 000	999 060	999 295	2,20 %, 6/1/26	A+	547 000	532 240	581 382
1,00 %, 9/1/22	AAA	1 565 000	1 563 757	1 589 727	2,55 %, 6/1/27	A+	480 000	484 121	521 160
1,75 %, 3/1/23	AAA	1 245 000	1 284 992	1 293 991	2,90 %, 12/1/28	A+	241 000	244 224	269 744
1,50 %, 6/1/23	AAA	541 000	550 705	560 492	2,90 %, 9/20/29	A+	259 000	271 699	290 177
2,25 %, 3/1/24	AAA	311 000	323 373	332 963	2,05 %, 6/1/30	A+	684 000	686 813	714 079
2,50 %, 6/1/24	AAA	142 000	148 577	154 201	3,50 %, 6/1/31	A+	201 000	207 211	238 724
1,50 %, 9/1/24	AAA	323 000	320 513	338 638	3,90 %, 12/1/33	A+	126 000	138 328	156 820
1,25 %, 3/1/25	AAA	300 000	309 465	312 563	4,50 %, 12/1/40	A+	20 000	24 895	27 609
2,25 %, 6/1/25	AAA	1 050 000	1 147 032	1 148 794	3,45 %, 12/1/43	A+	144 000	155 214	175 645
0,50 %, 9/1/25	AAA	1 000 000	1 005 800	1 006 900	3,30 %, 12/1/46	A+	358 000	387 376	433 665
1,50 %, 6/1/26	AAA	700 000	743 495	746 410	3,05 %, 12/1/48	A+	294 000	294 608	345 080
2,25 %, 6/1/29	AAA	1 000 000	1 156 700	1 154 795	3,10 %, 6/1/50	A+	386 000	440 053	463 347
5,75 %, 6/1/29	AAA	1 000 000	1 462 270	1 458 135	Province de la Colombie-Britannique				
1,25 %, 6/1/30	AAA	1 750 000	1 872 133	1 872 404	3,25 %, 12/18/21	AAA	223 000	230 084	232 408
Exportation et développement Canada					2,70 %, 12/18/22	AAA	30 000	30 869	31 662
1,80 %, 9/1/22	AAA	242 000	242 707	249 336	3,30 %, 12/18/23	AAA	28 000	29 056	30 598
TOTAL DES OBLIGATIONS FÉDÉRALES			33 354 325	34 313 804	2,85 %, 6/18/25	AAA	521 000	540 041	573 269
OBLIGATIONS PROVINCIALES – 41,4 %					2,30 %, 6/18/26	AAA	274 000	269 686	296 073
Société canadienne des postes					2,55 %, 6/18/27	AAA	66 000	64 303	72 694
4,08 %, 7/16/25	Non noté	30 000	33 606	34 842	5,62 %, 8/17/28	AAA	57 000	69 209	76 165
4,36 %, 7/16/40	Non noté	118 000	144 973	169 545	2,95 %, 12/18/28	AAA	438 000	459 999	500 987
CPPIB Capital, Inc.					5,70 %, 6/18/29	AAA	389 000	508 358	535 669
3,00 %, 6/15/28	AAA	219 000	218 941	248 618	2,20 %, 6/18/30	AAA	209 000	208 685	227 390
Financement-Québec					6,35 %, 6/18/31	AAA	148 000	205 153	223 412
5,25 %, 6/1/34	AA-	181 000	232 965	258 858	5,40 %, 6/18/35	AAA	47 000	63 132	70 355
Hydro-Québec					4,70 %, 6/18/37	AAA	183 000	232 547	261 983
9,63 %, 7/15/22	Non noté	63 000	80 730	74 700	4,30 %, 6/18/42	AAA	201 000	241 887	288 388
6,50 %, 1/16/35	AA-	5 000	7 549	7 998	3,20 %, 6/18/44	AAA	255 000	256 754	318 125
6,50 %, 2/15/35	AA-	374 000	553 142	604 939					
6,00 %, 2/15/40	AA-	176 000	256 447	293 366					
5,00 %, 2/15/45	AA-	244 000	337 487	387 260					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
2,80 %, 6/18/48	AAA	356 000	332 832	427 116	Province d'Ontario				
4,90 %, 6/18/48	AAA	5 000	6 765	8 271	1,35 %, 3/8/22	A+	254 000	247 779	258 061
2,95 %, 6/18/50	AAA	219 000	245 452	274 808	3,15 %, 6/2/22	A+	1 013 000	1 059 645	1 065 676
Province du Manitoba					1,95 %, 1/27/23	A+	226 000	226 262	234 333
2,55 %, 6/2/23	A+	390 000	396 168	412 310	2,85 %, 6/2/23	A+	789 000	821 685	841 480
3,30 %, 6/2/24	A+	140 000	144 722	153 917	2,60 %, 9/8/23	A+	224 000	224 938	238 239
2,45 %, 6/2/25	A+	317 000	321 152	340 992	8,10 %, 9/8/23	A+	65 000	81 231	80 392
2,55 %, 6/2/26	A+	392 000	389 136	426 322	7,50 %, 2/7/24	A+	47 000	60 838	58 336
2,60 %, 6/2/27	A+	43 000	41 529	47 128	3,50 %, 6/2/24	A+	437 000	464 445	484 358
3,00 %, 6/2/28	A+	217 000	216 711	245 173	2,30 %, 9/8/24	A+	800 000	818 154	851 580
2,75 %, 6/2/29	Non noté	145 000	152 033	161 903	2,65 %, 2/5/25	A+	452 000	457 194	490 350
2,05 %, 6/2/30	A+	100 000	100 863	105 842	2,60 %, 6/2/25	A+	2 034 000	2 076 917	2 206 971
6,30 %, 3/5/31	A+	18 000	24 166	26 499	1,75 %, 9/8/25	A+	825 000	858 248	862 467
4,60 %, 3/5/38	A+	5 000	5 932	6 942	8,50 %, 12/2/25	A+	39 000	54 664	54 518
4,65 %, 3/5/40	A+	131 000	172 604	185 269	2,40 %, 6/2/26	A+	1 075 000	1 058 303	1 164 042
4,10 %, 3/5/41	A+	107 000	125 360	142 785	8,00 %, 6/2/26	A+	145 000	205 361	203 794
4,05 %, 9/5/45	A+	92 000	103 736	125 922	8,00 %, 12/2/26	A+	109 000	151 307	155 890
2,85 %, 9/5/46	A+	91 000	83 383	103 901	2,60 %, 6/2/27	A+	1 815 000	1 847 942	1 998 342
3,40 %, 9/5/48	A+	102 000	106 327	129 501	7,60 %, 6/2/27	A+	506 000	702 597	725 781
3,20 %, 3/5/50	A+	65 000	63 576	81 043	2,90 %, 6/2/28	A+	1 531 000	1 558 039	1 728 086
3,15 %, 9/5/52	A+	88 000	84 311	109 840	6,50 %, 3/8/29	A+	330 000	442 264	470 897
4,63 %, 3/5/63	A+	50 000	81 834	86 773	2,70 %, 6/2/29	A+	1 025 000	1 064 634	1 148 441
Province du Nouveau-					2,05 %, 6/2/30	A+	1 060 000	1 127 646	1 131 884
Brunswick					6,20 %, 6/2/31	A+	249 000	344 266	371 005
1,55 %, 5/4/22	A+	66 000	63 777	67 345	5,85 %, 3/8/33	A+	322 000	434 493	480 857
2,85 %, 6/2/23	A+	281 000	290 399	299 273	5,60 %, 6/2/35	A+	467 000	627 404	707 939
2,60 %, 8/14/26	A+	70 000	70 974	76 409	4,70 %, 6/2/37	A+	322 000	390 707	458 227
2,35 %, 8/14/27	A+	114 000	110 686	123 105	4,60 %, 6/2/39	A+	498 000	664 915	714 685
3,10 %, 8/14/28	A+	181 000	185 064	205 967	5,70 %, 12/2/39	A+	32 000	45 749	51 595
4,55 %, 3/26/37	A+	40 000	47 317	54 372	4,65 %, 6/2/41	A+	675 000	888 316	993 667
4,80 %, 9/26/39	A+	122 000	156 761	174 327	3,50 %, 6/2/43	A+	596 000	685 103	768 619
4,80 %, 6/3/41	A+	150 000	208 695	217 206	3,45 %, 6/2/45	A+	954 000	1 017 893	1 236 184
3,55 %, 6/3/43	A+	97 000	110 078	121 202	2,90 %, 12/2/46	A+	876 000	843 530	1 047 705
3,55 %, 6/3/55	A+	97 000	119 459	130 418	2,80 %, 6/2/48	A+	755 000	729 707	898 265
Province de Terre-					2,90 %, 6/2/49	A+	724 000	717 689	880 873
Neuve-et-Labrador					2,65 %, 12/2/50	A+	732 000	787 876	861 813
2,30 %, 6/2/25	A	190 000	183 661	200 820	Province de l'Île-du-Prince-				
3,00 %, 6/2/26	A	112 000	113 029	122 767	Édouard				
2,85 %, 6/2/28	Non noté	119 000	115 437	129 966	4,60 %, 5/19/41	A	48 000	62 224	67 829
2,85 %, 6/2/29	Non noté	43 000	43 429	47 221	3,60 %, 1/17/53	A	2 000	2 087	2 667
6,55 %, 10/17/30	A	5 000	6 746	7 190	Province de Québec				
5,60 %, 10/17/33	A	126 000	163 458	176 048	4,25 %, 12/1/21	AA-	586 000	620 193	618 089
4,50 %, 4/17/37	Non noté	62 000	71 094	79 506	1,65 %, 3/3/22	AA-	12 000	11 748	12 259
4,65 %, 10/17/40	A	12 000	14 190	16 068	3,50 %, 12/1/22	AA-	489 000	512 821	524 611
3,30 %, 10/17/46	A	150 000	144 909	168 674	9,38 %, 1/16/23	AA-	93 000	125 766	113 633
3,70 %, 10/17/48	A	136 000	148 810	165 056	9,50 %, 3/30/23	AA-	5 000	6 397	6 209
2,65 %, 10/17/50	A	94 000	90 851	95 316	3,00 %, 9/1/23	AA-	431 000	448 269	463 920
Province de la Nouvelle-Écosse					2,25 %, 2/22/24	AA-	262 000	263 923	277 400
2,15 %, 6/1/25	Non noté	13 000	12 715	13 824	3,75 %, 9/1/24	AA-	721 000	775 029	811 341
2,10 %, 6/1/27	Non noté	118 000	110 837	125 653	5,35 %, 6/1/25	AA-	171 000	201 919	207 935
6,60 %, 6/1/27	AA-	18 000	23 794	24 548	2,60 %, 7/6/25	AA-	43 000	44 144	46 850
5,80 %, 6/1/33	AA-	91 000	122 119	134 416	2,75 %, 9/1/25	AA-	503 000	519 937	551 716
4,90 %, 6/1/35	AA-	12 000	15 208	16 823	8,50 %, 4/1/26	AA-	476 000	665 805	674 978
4,50 %, 6/1/37	AA-	123 000	147 258	168 452	2,50 %, 9/1/26	AA-	799 000	789 319	872 768
4,70 %, 6/1/41	AA-	4 000	4 947	5 804	2,75 %, 9/1/27	AA-	901 000	910 763	1 005 548
4,40 %, 6/1/42	AA-	3 000	3 607	4 241	2,75 %, 9/1/28	AA-	894 000	952 011	1 003 654
3,45 %, 6/1/45	AA-	23 000	23 836	29 088	2,30 %, 9/1/29	AA-	900 000	922 917	981 882
3,15 %, 12/1/51	Non noté	36 000	37 502	45 338	6,00 %, 10/1/29	AA-	546 000	727 302	770 444
3,50 %, 6/2/62	AA-	144 000	176 736	204 301					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
6,25 %, 6/1/32	AA-	342 000	461 827	518 935	3,26 %, 6/1/37	A+	131 000	134 529	143 717
0,00 %, 4/1/35	AA-	262 000	161 326	193 890	5,30 %, 2/25/41	A+	256 000	348 391	365 763
5,75 %, 12/1/36	AA-	116 000	160 903	182 055	Municipal Finance Authority of				
5,00 %, 12/1/38	AA-	290 000	377 483	433 823	British Columbia				
5,00 %, 12/1/41	AA-	284 000	404 083	439 082	2,15 %, 12/1/22	AAA	56 000	55 951	58 160
4,25 %, 12/1/43	AA-	440 000	542 343	632 524	2,60 %, 4/23/23	AAA	23 000	23 096	24 265
3,50 %, 12/1/45	AA-	709 000	765 482	930 520	3,75 %, 9/26/23	AAA	67 000	72 089	73 615
3,50 %, 12/1/48	AA-	566 000	653 039	762 337	2,95 %, 10/14/24	AAA	40 000	41 029	43 594
3,10 %, 12/1/51	AA-	455 000	548 335	588 224	2,50 %, 4/19/26	AAA	209 000	204 660	226 045
Province de la Saskatchewan					4,95 %, 12/1/27	AAA	40 000	47 515	50 466
3,20 %, 6/3/24	AA	79 000	81 847	86 484	3,05 %, 10/23/28	AAA	37 000	36 610	41 946
2,55 %, 6/2/26	AA	128 000	127 365	139 187	2,55 %, 10/9/29	AAA	300 000	329 796	329 163
2,65 %, 6/2/27	AA	228 000	224 683	250 248	Muskrat Falls / Labrador				
3,05 %, 12/2/28	AA	554 000	599 457	630 469	Transmission Assets				
5,75 %, 3/5/29	AA	94 000	115 005	127 095	Funding Trust				
5,00 %, 3/5/37	AA	10 000	13 496	14 233	3,63 %, 6/1/29	AAA	300 000	353 550	363 317
3,40 %, 2/3/42	AA	126 000	130 000	153 624	Administration de l'aéroport				
3,90 %, 6/2/45	AA	47 000	52 812	62 569	international Macdonald-				
2,75 %, 12/2/46	AA	77 000	68 928	85 955	Cartier d'Ottawa				
3,30 %, 6/2/48	Non noté	285 000	303 397	353 696	3,93 %, 6/9/45	A+	145 000	166 750	161 745
3,10 %, 6/2/50	AA	36 000	35 283	43 874	Municipalité régionale de Peel				
3,75 %, 3/5/54	AA	18 000	21 000	25 087	3,85 %, 10/30/42	AAA	39 000	42 076	49 809
PSP Capital, Inc.					Municipalité régionale de York				
1,34 %, 8/18/21	AAA	30 000	29 276	30 337	2,35 %, 6/9/27	AA+	70 000	67 372	75 146
1,73 %, 6/21/22	AAA	140 000	136 456	143 543	2,65 %, 4/18/29	AA+	88 000	90 101	96 716
2,09 %, 11/22/23	AAA	217 000	211 194	227 688	Autorité aéroportuaire de				
3,29 %, 4/4/24	AAA	152 000	158 054	166 733	Vancouver				
2,05 %, 1/15/30	AAA	200 000	203 098	213 047	3,86 %, 11/10/45	AA	131 000	137 157	160 703
Royal Office Finance L.P.					2,87 %, 10/18/49	AA	194 000	197 302	204 537
5,21 %, 11/12/37	AAA	166 556	200 371	216 251	Winnipeg Airports Authority,				
TCHC Issuer Trust					Inc.				
4,88 %, 5/11/37	AA-	126 000	156 555	174 192	5,21 %, 9/28/40	A+	20 798	23 841	25 700
TOTAL DES OBLIGATIONS PROVINCIALES			58 432 647	63 803 945	TOTAL DES OBLIGATIONS MUNICIPALES		4 100 425	4 409 497	
OBLIGATIONS MUNICIPALES - 2,9 %					OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES - 1,3 %				
Ville de Montréal					Australie - 0,5 %				
4,50 %, 12/1/21	AA-	29 000	30 770	30 641	National Australia Bank Ltd.				
3,50 %, 9/1/23	AA-	25 000	26 202	27 159	3,52 %, 6/12/30	BBB+	368 000	369 281	375 231
3,50 %, 9/1/24	AA-	273 000	282 509	301 852	Transurban Finance Co., Pty				
3,00 %, 9/1/27	AA-	196 000	197 077	218 592	Ltd.				
4,25 %, 12/1/32	AA-	57 000	62 219	72 576	4,56 %, 11/14/28	BBB+	333 000	356 030	376 713
4,10 %, 12/1/34	AA-	104 000	126 846	131 259	Total de l'Australie			725 311	751 944
3,15 %, 12/1/36	AA-	78 000	77 288	89 477	Belgique - 0,1 %				
Ville d'Ottawa					Anheuser-Busch InBev				
3,10 %, 7/27/48	AA	223 000	215 930	260 892	Finance, Inc.				
Ville de Toronto					2,60 %, 5/15/24	BBB+	88 000	84 462	90 910
6,80 %, 7/26/21	AA	5 000	5 545	5 340	États-Unis - 0,7 %				
3,40 %, 5/21/24	AA	173 000	178 385	189 959	AT&T, Inc.				
2,45 %, 2/6/25	AA	47 000	46 408	50 233	2,85 %, 5/25/24	BBB	145 000	138 125	151 160
2,40 %, 6/7/27	Non noté	100 000	93 732	107 635	4,00 %, 11/25/25	BBB	302 000	302 316	334 035
3,50 %, 6/2/36	AA	23 000	23 671	27 537	Citigroup, Inc.				
4,70 %, 6/10/41	AA	40 000	49 892	56 043	4,09 %, 6/9/25	BBB	220 000	223 928	238 222
3,80 %, 12/13/42	AA	108 000	118 258	136 514	McDonald's Corp.				
4,15 %, 3/10/44	AA	51 000	59 312	67 835	3,13 %, 3/4/25	BBB+	52 000	53 778	55 835
3,25 %, 6/24/46	AA	12 000	12 078	14 152	Molson Coors International L.P.				
Autorité aéroportuaire du					2,84 %, 7/15/23	BBB-	22 000	21 267	22 398
Grand Toronto					3,44 %, 7/15/26	BBB-	209 000	203 698	216 667
6,45 %, 7/30/29	A+	45 718	54 461	55 901					
6,98 %, 10/15/32	A+	48 000	68 027	71 493					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
États-Unis				
Mondelez International, Inc 3,25 %, 3/7/25	BBB	89 000	87 689	95 146
Wells Fargo & Co. 3,87 %, 5/21/25	BBB+	73 000	75 960	78 398
Total des États-Unis			1 106 761	1 191 861
TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES				
			1 916 534	2 034 715
OBLIGATIONS SUPRANATIONALES – 0,4 %				
Banque asiatique de développement 4,65 %, 2/16/27	AAA	72 000	84 187	89 551
Banque interaméricaine de développement 4,40 %, 1/26/26	AAA	157 000	172 390	187 737
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 2,25 %, 1/17/23	AAA	224 000	224 788	233 829
1,90 %, 1/16/25	AAA	90 000	91 373	94 815
International Finance Corp. 2,38 %, 7/19/23	AAA	13 000	13 231	13 725
TOTAL DES OBLIGATIONS SUPRANATIONALES			585 969	619 657
ORGANISMES DE GOUVERNEMENTS ÉTRANGERS – 0,0 %				
Allemagne – 0,0 %				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,00 %, 2/7/22	AAA	26 000	25 988	26 666
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES – 99,4 %				
			143 401 798	153 314 749
Autres actifs en excédent du passif – 0,6 %				877 787
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %				
				154 192 536 \$

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États de la situation financière (non audité)

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
ACTIF		
Actifs courants		
Placements	89 533 036 \$	102 253 523 \$
Trésorerie	758 408	1 409 067
Créances :		
Titres de placement vendus	10 629 510	6 166 190
Intérêts	504 124	701 019
Remboursements au titre de l'impôt étranger	—	356
Total de l'actif	101 425 078	110 530 155
PASSIF		
Passifs courants		
Créditeurs :		
Titres de placement achetés	11 077 920	7 133 700
Distributions	199 800	281 400
Frais de gestion	2 469	11 530
Total du passif	11 280 189	7 426 630
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	90 144 889 \$	103 103 525 \$
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	90 144 889	103 103 525
Nombre de parts rachetables en circulation (note 4)	1 800 000	2 100 000
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part	50,08 \$	49,10 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États du résultat global (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
REVENUS		
Profit net (perte nette) sur les placements		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	321 020 \$	371 692 \$
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements	1 400 203	1 757 840
Total du profit net (de la perte nette) sur les placements	1 721 223	2 129 532
Autres revenus (pertes)		
Intérêts aux fins de distribution	1 490 225	1 436 649
Total des autres revenus (pertes)	1 490 225	1 436 649
Total des revenus (pertes)	3 211 448	3 566 181
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	97 539	93 147
Honoraires des membres du comité d'examen indépendant (note 5)	2 870	3 153
Total des charges	100 409	96 300
Déduire : Charges visées par une renonciation du gestionnaire/prise en charge par le gestionnaire (note 5)	(2 870)	(3 153)
Charges nettes	97 539	93 147
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	3 113 909 \$	3 473 034 \$
Nombre moyen pondéré de parts rachetables	2 066 209	1 958 564
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation par part	1,51 \$	1,77 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

États de révolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables au début de la période	103 103 525 \$	96 897 744 \$
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	3 113 909	3 473 034
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(1 364 600)	(1 380 400)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 364 600)	(1 380 400)
Opérations sur parts rachetables		
Produit de la vente de parts rachetables	27 284 030	14 739 871
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(41 991 975)	(19 639 410)
Opérations sur parts rachetables, montant net	(14 707 945)	(4 899 539)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la fin de la période	90 144 889 \$	94 090 839 \$

Les notes ci-jointes font partie intégrante des états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Tableaux des flux de trésorerie (non audité)

Pour les périodes closes les 30 juin
(en dollars canadiens, sauf le nombre de parts)

	2020	2019
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée à l'exploitation	3 113 909 \$	3 473 034 \$
Ajustements :		
Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements	(321 020)	(371 692)
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements	(1 400 203)	(1 757 840)
Achat de placements ¹	(43 245 630)	(27 387 553)
Produit de la vente de placements ¹	38 151 138	26 702 478
Variation des créances	(4 266 069)	(1 233 144)
Variation des créditeurs	3 935 159	2 388 206
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités d'exploitation	(4 032 716)	1 813 489
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de la vente de parts rachetables ¹	5 287 590	856 312
Sommes versées au rachat de parts rachetables ¹	(459 333)	(251 486)
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, nettes des réinvestissements	(1 446 200)	(1 494 800)
Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement	3 382 057	(889 974)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie au cours de la période	(650 659)\$	923 515 \$
Trésorerie au début de la période	1 409 067 \$	178 218 \$
Trésorerie à la fin de la période	758 408 \$	1 101 733 \$
INFORMATIONS SUPPLÉMENTAIRES²		
Dividendes reçus, nets des retenues d'impôt étranger	356 \$	(211)\$
Intérêts reçus	1 687 120	1 412 473

¹ Exclut les opérations en nature, le cas échéant.

² Classées dans les activités d'exploitation.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS - 33,9 %									
407 International, Inc.					Brookfield Property Finance ULC				
2,47 %, 9/8/22	BBB	203 000	203 712	208 120	4,12 %, 10/19/21	BBB-	114 000	115 241	114 820
3,35 %, 5/16/24	A	129 000	137 281	139 070	Brookfield Renewable Partners ULC				
AIMCo Realty Investors L.P.					4,79 %, 2/7/22	BBB+	166 000	175 411	174 633
2,27 %, 6/26/24	NR	52 000	52 022	53 790	Corporation Cameco				
Algonquin Power Co.					3,75 %, 11/14/22	BBB-	108 000	107 476	111 545
4,65 %, 2/15/22	BBB	87 000	90 777	91 216	Banque Canadienne Impériale de Commerce				
Alimentation Couche-Tard Inc.					1,64 %, 7/12/21	NR	884	859	893
3,90 %, 11/1/22	BBB	37 000	37 780	39 190	2,43 %, 6/9/23	NR	209 000	210 304	216 247
Alliance Pipeline L.P.					2,97 %, 7/11/23	NR	349 000	357 928	368 848
7,18 %, 6/30/23	BBB+	64 150	70 800	70 670	3,29 %, 1/15/24	BBB+	292 000	300 238	311 355
Fonds de placement immobilier Allied					2,35 %, 8/28/24	BBB+	391 000	390 228	405 303
3,93 %, 11/14/22	NR	68 000	68 666	71 187	2,00 %, 4/17/25	BBB+	300 000	301 110	307 015
AltaGas Ltd.					3,30 %, 5/26/25	A+	200 000	218 242	220 679
3,72 %, 9/28/21	BBB-	204 000	209 576	210 111	3,45 %, 4/4/28	BBB	289 000	289 556	302 277
2,61 %, 12/16/22	NR	159 000	159 672	163 195	Canadian Natural Resources Ltd.				
AltaLink Investments L.P.					3,31 %, 2/11/22	BBB	338 000	340 329	346 083
2,24 %, 3/7/22	A-	140 000	137 335	142 413	Canadian Utilities Ltd.				
AltaLink L.P.					3,12 %, 11/9/22	BBB+	88 000	89 313	92 239
2,98 %, 11/28/22	A	42 000	43 924	44 036	Propriétés de Choix S.E.C.				
3,67 %, 11/6/23	A	128 000	134 826	139 354	3,60 %, 9/20/21	NR	62 000	62 832	63 275
3,40 %, 6/6/24	A	81 000	86 380	87 918	3,60 %, 9/20/22	NR	95 000	96 369	98 588
Banque de Montréal					Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix				
2,89 %, 6/20/23	NR	618 000	625 411	652 151	3,20 %, 3/7/23	BBB	91 000	90 648	94 372
2,85 %, 3/6/24	NR	473 000	481 464	498 568	Coast Capital Savings Federal Credit Union				
2,70 %, 9/11/24	NR	549 000	564 471	584 128	5,00 %, 5/3/28	NR	76 000	77 413	79 689
2,37 %, 2/3/25	NR	300 000	306 822	312 189	Cogeco Communications, Inc.				
2,57 %, 6/1/27	BBB+	159 000	158 157	162 222	4,93 %, 2/14/22	BBB-	110 000	115 207	115 565
La Banque de Nouvelle-Écosse					4,18 %, 5/26/23	BBB-	71 000	73 989	74 945
2,98 %, 4/17/23	A+	250 000	253 792	263 657	Fonds de placement immobilier Crombie				
2,38 %, 5/1/23	A-	323 000	324 554	333 354	4,07 %, 11/21/22	NR	73 000	74 005	75 350
2,29 %, 6/28/24	A+	412 000	416 329	431 133	Fiducie de placement immobilier CT				
2,49 %, 9/23/24	A-	486 000	488 922	507 180	2,85 %, 6/9/22	BBB	88 000	86 926	89 172
2,16 %, 2/3/25	A-	375 000	376 754	386 473	Dollarama, Inc.				
2,58 %, 3/30/27	BBB+	325 000	322 277	331 212	2,34 %, 7/22/21	NR	165 000	163 293	167 121
Bankers Hall L.P.					2,20 %, 11/10/22	NR	150 000	144 572	153 387
4,38 %, 11/20/23	NR	127 998	131 542	136 816	L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie				
Bell Canada, Inc.					3,66 %, 3/15/28	NR	48 000	48 054	49 964
3,15 %, 9/29/21	BBB+	398 000	404 349	407 900	Enbridge Gas, Inc.				
2,00 %, 10/1/21	BBB+	379 000	374 250	383 764	3,79 %, 7/10/23	A-	85 000	88 487	91 377
3,00 %, 10/3/22	BBB+	695 000	700 816	722 032	3,15 %, 8/22/24	A-	78 000	81 372	83 745
3,35 %, 3/22/23	BBB+	381 000	390 656	400 416	Enbridge Pipelines, Inc.				
Bow Centre Street L.P.					2,93 %, 11/30/22	BBB+	109 000	108 846	113 100
3,80 %, 6/13/23	NR	69 000	66 983	68 298	Enbridge, Inc.				
Brookfield Asset Management, Inc.					4,85 %, 2/22/22	BBB+	110 000	116 601	116 040
4,54 %, 3/31/23	A-	71 000	75 174	76 161	3,19 %, 12/5/22	BBB+	312 000	314 532	324 156
5,04 %, 3/8/24	A-	188 000	204 624	206 990					
Brookfield Infrastructure Finance ULC									
3,45 %, 3/11/22	BBB+	77 000	77 536	79 055					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
3,94 %, 1/13/23	BBB+	161 000	166 317	170 613	3,00 %, 9/12/22	BBB	203 000	202 399	206 613
Banque Équitable					Société Financière				
2,95 %, 9/26/22	NR	109 000	109 547	109 499	Manuvie				
Fairfax Financial Holdings Ltd.					3,32 %, 5/9/28	A-	132 000	133 641	138 294
5,84 %, 10/14/22	BBB-	168 000	184 015	179 442	3,05 %, 8/20/29	A-	204 000	210 128	214 244
4,50 %, 3/22/23	BBB-	252 000	263 411	262 227	MCAP Commercial L.P.				
Fédération des Caisses					5,00 %, 12/14/22	NR	112 000	112 542	114 111
Desjardins du Québec					Metro, Inc.				
2,09 %, 1/17/22	A+	80 000	81 228	81 518	3,20 %, 12/1/21	BBB	112 000	114 115	115 305
3,06 %, 9/11/23	A+	228 000	229 802	242 017	2,68 %, 12/5/22	BBB	168 000	168 586	174 144
2,42 %, 10/4/24	A-	174 000	174 324	180 902	Corporation Morguard				
2,86 %, 5/26/30	BBB+	250 000	252 975	258 561	4,33 %, 9/15/22	NR	40 000	40 271	40 206
Finning International, Inc.					Banque Nationale du Canada				
2,84 %, 9/29/21	BBB+	155 000	155 000	158 214	2,98 %, 3/4/24	BBB+	177 000	180 813	187 420
First Capital Real Estate Investment Trust					2,55 %, 7/12/24	BBB+	335 000	338 944	350 284
4,43 %, 1/31/22	BBB-	150 000	155 212	153 397	3,18 %, 2/1/28	BBB	275 000	277 078	284 547
3,95 %, 12/5/22	BBB-	25 000	25 409	25 517	Nissan Canada, Inc.				
FortisAlberta, Inc. 3,30 %, 9/30/24	A-	78 000	81 838	84 462	3,15 %, 9/14/21	NR	280 000	282 451	273 738
Société de financement					Corporation Immobilière OMERS				
GE Capital Canada					3,36 %, 6/5/23	NR	170 000	175 124	181 109
4,60 %, 1/26/22	BBB+	339 000	351 996	350 624	2,86 %, 2/23/24	NR	378 000	391 130	399 805
General Motors Financial of Canada Ltd.					Original Wempi, Inc.				
2,60 %, 6/1/22	BBB	99 000	95 895	98 328	4,06 %, 2/13/24	NR	155 265	159 569	166 374
Granite REIT Holdings L.P. 3,79 %, 7/5/21	NR	44 000	44 553	44 847	Pembina Pipeline Corp.				
Fonds de placement immobilier H&R					3,43 %, 11/10/21	BBB	179 000	181 884	183 415
2,92 %, 5/6/22	NR	86 000	84 962	85 653	3,77 %, 10/24/22	BBB	151 000	155 511	158 258
3,42 %, 1/23/23	NR	78 000	78 646	78 076	Penske Truck Leasing Canada, Inc.				
Honda Canada Finance, Inc.					2,85 %, 12/7/22	BBB	194 000	191 882	195 715
2,54 %, 3/1/23	NR	38 000	37 775	39 116	Fonds de placement immobilier RioCan				
3,18 %, 8/28/23	NR	189 000	191 852	198 665	3,72 %, 12/13/21	BBB	57 000	58 216	58 255
2,50 %, 6/4/24	NR	37 000	37 286	38 262	2,83 %, 10/3/22	BBB	144 000	142 318	145 548
Banque HSBC Canada					3,73 %, 4/18/23	BBB	115 000	117 778	119 045
3,25 %, 9/15/23	A+	248 000	254 137	261 206	Rogers Communications Inc.				
Hydro One, Inc.					4,00 %, 6/6/22	BBB+	249 000	259 988	263 020
3,20 %, 1/13/22	A-	36 000	37 214	37 280	Banque Royale du Canada				
2,54 %, 4/5/24	A-	295 000	301 272	310 129	2,95 %, 5/1/23	AA-	335 000	339 583	353 159
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers inc.					3,30 %, 9/26/23	A	403 000	412 606	428 814
3,30 %, 9/15/28	A+	138 000	137 614	144 881	2,33 %, 12/5/23	AA-	301 000	299 042	313 645
Inter Pipeline Ltd.					2,35 %, 7/2/24	A	492 000	492 763	511 336
3,78 %, 5/30/22	BBB-	108 000	111 894	110 782	2,61 %, 11/1/24	A	314 000	317 775	329 972
Ivanhoe Cambridge II, Inc.					2,74 %, 7/25/29	A-	404 000	404 835	417 663
2,91 %, 6/27/23	NR	128 000	127 462	134 185	2,88 %, 12/23/29	A-	439 000	442 330	456 567
2,30 %, 12/12/24	NR	57 000	57 593	59 379	Saputo inc.				
John Deere Canada Funding, Inc.					1,94 %, 6/13/22	NR	23 000	22 602	23 293
3,02 %, 7/13/23	A	56 000	56 140	59 261	SmartCentres REIT				
Banque Laurentienne du Canada					2,88 %, 3/21/22	NR	131 000	129 568	132 836
2,55 %, 6/20/22	BBB	100 000	100 848	100 879	Financière Sun Life inc.				
					3,05 %, 9/19/28	A	177 000	176 859	185 371
					2,38 %, 8/13/29	A	274 000	275 702	281 562
					Fiducie de capital TD IV				
					6,63 %, 6/30/08	BBB+	19 555	21 512	20 495

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
TELUS Communications, Inc.					2,35 %, 9/15/23	AAA	1 410 000	1 475 891	1 492 704
9,65 %, 4/8/22	BBB+	109 000	130 183	124 954	3,15 %, 9/15/23	AAA	630 000	659 592	682 936
TELUS Corp.					2,55 %, 12/15/23	AAA	1 968 000	2 024 412	2 104 018
2,35 %, 3/28/22	BBB+	494 000	492 608	504 478	2,90 %, 6/15/24	AAA	2 997 000	3 192 131	3 268 723
3,35 %, 3/15/23	BBB+	177 000	180 518	185 885	1,80 %, 12/15/24	AAA	1 878 000	1 881 565	1 975 215
Teranet Holdings L.P.					2,55 %, 3/15/25	AAA	1 200 000	1 288 213	1 306 026
3,65 %, 11/18/22	BBB	88 000	87 957	90 417	0,95 %, 6/15/25	AAA	2 000 000	2 027 440	2 027 660
Groupe TMX Ltée					Obligations du				
4,46 %, 10/3/23	NR	94 000	99 642	102 686	gouvernement du				
Toronto Hydro Corp.					Canada				
3,54 %, 11/18/21	A	6 000	6 150	6 227	10,50 %, 3/15/21	AAA	16 000	19 604	17 152
2,91 %, 4/10/23	A	141 000	145 514	147 950	1,50 %, 8/1/21	AAA	1 698 000	1 714 525	1 721 585
La Banque Toronto-Dominion					0,75 %, 9/1/21	AAA	2 099 000	2 103 383	2 112 234
2,62 %, 12/22/21	AA-	100 000	102 402	102 726	1,25 %, 11/1/21	AAA	564 000	565 903	571 639
3,01 %, 5/30/23	NR	52 000	52 904	55 025	1,50 %, 2/1/22	AAA	509 000	515 072	519 058
1,91 %, 7/18/23	AA-	281 000	272 563	288 642	0,50 %, 3/1/22	AAA	514 000	510 014	516 251
2,85 %, 3/8/24	A	443 000	451 386	467 936	1,50 %, 5/1/22	AAA	350 000	357 839	357 882
3,23 %, 7/24/24	AA-	467 000	492 457	508 056	2,75 %, 6/1/22	AAA	329 000	340 999	344 879
2,50 %, 12/2/24	A	323 000	324 416	338 241	0,25 %, 8/1/22	AAA	710 000	709 510	709 499
1,94 %, 3/13/25	NR	300 000	301 815	306 960	1,00 %, 9/1/22	AAA	761 000	753 407	773 024
3,59 %, 9/14/28	A-	303 000	305 098	320 438	1,75 %, 3/1/23	AAA	965 000	1 001 527	1 002 973
3,22 %, 7/25/29	A-	349 000	356 887	367 832	1,50 %, 6/1/23	AAA	560 000	580 194	580 177
3,11 %, 4/22/30	A-	600 000	617 460	631 719	Exportation et				
Toyota Credit Canada, Inc.					développement				
2,35 %, 7/18/22	A+	1 000	993	1 024	Canada				
2,62 %, 10/11/22	A+	1 000	991	1 032	1,80 %, 9/1/22	AAA	88 000	87 264	90 668
3,04 %, 7/12/23	A+	230 000	232 207	242 311	1,65 %, 7/31/24	AAA	105 000	104 486	109 452
TransCanada PipeLines Ltd.					TOTAL DES OBLIGATIONS FÉDÉRALES		28 064 104	28 495 581	
3,65 %, 11/15/21	BBB+	146 000	150 067	150 819	OBLIGATIONS PROVINCIALES - 26,5 %				
TWDC Enterprises 18 Corp.					Hydro-Québec				
2,76 %, 10/7/24	A-	303 000	312 204	319 350	10,50 %, 10/15/21	AA-	8 000	10 109	9 035
Ventas Canada Finance Ltd.					9,63 %, 7/15/22	AA-	55 000	65 585	65 214
3,30 %, 2/1/22	BBB+	149 000	149 445	150 300	Société financière de				
2,55 %, 3/15/23	BBB+	104 000	103 050	102 409	l'industrie de				
Crédit Volkswagen Canada Inc.					l'électricité de l'Ontario				
3,25 %, 3/29/23	BBB+	80 000	80 577	82 865	10,13 %, 10/15/21	A+	38 000	48 944	42 722
2,85 %, 9/26/24	BBB+	197 000	195 579	202 319	8,90 %, 8/18/22	A+	300 000	354 240	353 178
Westcoast Energy, Inc.					OPB Finance Trust				
3,88 %, 10/28/21	BBB+	95 000	98 011	98 490	1,88 %, 2/24/22	AA+	87 000	85 864	88 718
TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS			29 775 861	30 548 928	Province d'Alberta				
OBLIGATIONS FÉDÉRALES - 31,6 %					1,35 %, 9/1/21	A+	497 000	501 790	502 902
Fiducie du Canada					1,60 %, 9/1/22	A+	17 000	16 686	17 417
pour l'habitation n° 1					2,55 %, 12/15/22	A+	73 000	73 824	76 612
3,35 %, 12/15/20	NR	9 000	9 161	9 126	2,65 %, 9/1/23	A+	157 000	160 323	166 820
3,80 %, 6/15/21	AAA	3 000	3 156	3 100	3,40 %, 12/1/23	A+	183 000	191 749	199 734
1,50 %, 12/15/21	AAA	818 000	830 285	831 812	3,10 %, 6/1/24	A+	392 000	416 741	426 637
2,65 %, 3/15/22	AAA	708 000	735 119	735 541	2,35 %, 6/1/25	A+	650 000	693 050	693 778
1,75 %, 6/15/22	AAA	1 142 000	1 169 355	1 172 634	Province de la Colombie-Britannique				
2,40 %, 12/15/22	AAA	2 148 000	2 247 301	2 251 695	4,80 %, 6/15/21	AAA	6 000	6 631	6 255
2,35 %, 6/15/23	AAA	1 145 000	1 156 756	1 207 918	3,25 %, 12/18/21	AAA	235 000	245 339	244 915
					2,70 %, 12/18/22	AAA	96 000	97 454	101 318
					3,30 %, 12/18/23	AAA	445 000	470 759	486 296
					9,00 %, 8/23/24	AAA	250 000	334 090	334 365
					2,85 %, 6/18/25	AAA	750 000	825 007	825 244

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Province du Manitoba					Municipal Finance				
1,55 %, 9/5/21	A+	60 000	60 011	60 843	Authority of British Columbia				
2,55 %, 6/2/23	A+	318 000	322 937	336 191	1,65 %, 4/19/21	AAA	9 000	8 859	9 094
3,30 %, 6/2/24	A+	349 000	371 787	383 694	4,15 %, 6/1/21	AAA	9 000	9 671	9 314
2,45 %, 6/2/25	A+	500 000	537 525	537 843	2,15 %, 12/1/22	AAA	88 000	87 125	91 394
Province du Nouveau-Brunswick					2,60 %, 4/23/23	AAA	75 000	75 665	79 127
3,35 %, 12/3/21	A+	9 000	9 488	9 378	3,75 %, 9/26/23	AAA	58 000	60 701	63 726
1,55 %, 5/4/22	A+	67 000	65 478	68 366	2,15 %, 6/3/24	AAA	192 000	195 255	202 153
2,85 %, 6/2/23	A+	101 000	103 082	107 568	2,95 %, 10/14/24	AAA	110 000	115 865	119 883
3,65 %, 6/3/24	A+	150 000	166 302	166 796	TOTAL DES OBLIGATIONS MUNICIPALES		1 040 330	1 078 073	
Province de Terre-Neuve-et-Labrador					OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES - 4,2 %				
2,30 %, 6/2/25	A	250 000	263 800	264 236	Australie - 0,2 %				
Province de la Nouvelle-Écosse					BHP Billiton Finance Ltd.				
4,10 %, 6/1/21	AA-	9 000	9 663	9 310	3,23 %, 5/15/23	A	178 000	178 895	186 869
Province d'Ontario					Belgique - 0,1 %				
1,35 %, 3/8/22	A+	554 000	559 620	562 859	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.				
3,15 %, 6/2/22	A+	1 286 000	1 352 955	1 352 872	3,38 %, 1/25/23	BBB+	89 000	90 724	93 263
9,50 %, 7/13/22	A+	73 000	90 960	86 256	Royaume-Uni - 0,3 %				
1,95 %, 1/27/23	A+	29 000	28 938	30 069	HSBC Holdings PLC				
2,85 %, 6/2/23	A+	1 319 000	1 362 923	1 406 733	3,20 %, 12/5/23	A-	258 000	256 185	270 348
2,60 %, 9/8/23	A+	1 130 000	1 150 687	1 201 828	États-Unis - 3,6 %				
8,10 %, 9/8/23	A+	213 000	262 681	263 437	Apple, Inc.				
7,50 %, 2/7/24	A+	223 000	276 953	276 784	2,51 %, 8/19/24	AA+	586 000	600 167	619 426
3,50 %, 6/2/24	A+	2 065 000	2 230 635	2 288 784	Bank of America Corp.				
2,30 %, 9/8/24	A+	490 000	501 096	521 593	3,30 %, 4/24/24	A-	282 000	283 155	296 049
2,65 %, 2/5/25	A+	630 000	670 116	683 452	2,93 %, 4/25/25	A-	96 000	96 952	100 533
2,60 %, 6/2/25	A+	2 400 000	2 602 488	2 604 096	3,41 %, 9/20/25	A-	314 000	325 641	335 457
Province de Québec					Goldman Sachs Group, Inc. (The)				
4,25 %, 12/1/21	AA-	560 000	591 447	590 666	3,31 %, 10/31/25	BBB+	118 000	121 074	125 151
3,50 %, 12/1/22	AA-	1 000 000	1 072 378	1 072 825	John Deere Financial, Inc.				
9,38 %, 1/16/23	AA-	93 000	120 626	113 633	2,46 %, 4/4/24	A	132 000	132 612	137 826
2,45 %, 3/1/23	AA-	315 000	327 411	331 355	Morgan Stanley				
9,50 %, 3/30/23	AA-	93 000	119 317	115 488	3,00 %, 2/7/24	BBB+	257 000	257 969	270 343
3,00 %, 9/1/23	AA-	822 000	853 927	884 784	PepsiCo, Inc.				
2,25 %, 2/22/24	AA-	508 000	529 173	537 860	2,15 %, 5/6/24	A+	225 000	225 420	234 612
3,75 %, 9/1/24	AA-	1 272 000	1 390 830	1 431 382	United Parcel Service, Inc.				
Province de la Saskatchewan					2,13 %, 5/21/24	A-	235 000	233 689	242 502
3,20 %, 6/3/24	AA	174 000	185 457	190 484	Wells Fargo & Co.				
PSP Capital, Inc.					2,51 %, 10/27/23	A-	188 000	182 849	193 628
1,34 %, 8/18/21	AAA	13 000	12 791	13 146	3,18 %, 2/8/24	A-	207 000	209 646	217 720
1,73 %, 6/21/22	AAA	262 000	256 493	268 630	3,87 %, 5/21/25	BBB+	200 000	210 798	214 790
2,09 %, 11/22/23	AAA	270 000	269 305	283 299	2,57 %, 5/1/26	A-	200 000	201 680	205 438
3,29 %, 4/4/24	AAA	198 000	210 464	217 192	Total des États-Unis		3 081 652	3 193 475	
TOTAL DES OBLIGATIONS PROVINCIALES			23 537 929	23 914 892	TOTAL DES OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS ÉTRANGÈRES				
OBLIGATIONS MUNICIPALES - 1,2 %					OBLIGATIONS SUPRANATIONALES - 1,7 %				
Ville de Montréal					Banque asiatique de développement				
4,50 %, 12/1/21	AA-	6 000	6 357	6 339	2,25 %, 9/16/21	AAA	3 000	2 999	3 068
3,50 %, 9/1/23	AA-	78 000	80 651	84 736	Banque interaméricaine de développement				
3,50 %, 9/1/24	AA-	157 000	167 840	173 593	1,70 %, 10/10/24	AAA	150 000	151 495	156 423
Ville de Toronto									
3,50 %, 12/6/21	AA	4 000	4 183	4 174					
3,90 %, 9/29/23	AA	157 000	168 354	173 050					
3,40 %, 5/21/24	AA	56 000	59 804	61 490					

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille (non audité) (suite)

30 juin 2020

Placements	Note de crédit*	Valeur nominale	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
1,25 %, 3/18/21	NR	7 000	6 830	7 047
2,20 %, 1/18/22	AAA	270 000	277 494	277 448
2,25 %, 1/17/23	AAA	167 000	167 353	174 328
2,50 %, 8/3/23	NR	103 000	106 293	109 063
1,80 %, 7/26/24	AAA	349 000	351 682	364 665
1,90 %, 1/16/25	AAA	150 000	152 904	158 025
International Finance Corp.				
2,38 %, 7/19/23	AAA	98 000	100 644	103 465
1,38 %, 9/13/24	AAA	183 000	179 266	188 234
TOTAL DES OBLIGATIONS SUPRANATIONALES			1 496 960	1 541 766
ORGANISMES DE GOUVERNEMENTS ÉTRANGERS - 0,2 %				
Allemagne - 0,2 %				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
2,00 %, 2/7/22	AAA	81 000	83 191	83 075
5,05 %, 2/4/25	AAA	106 000	126 949	126 766
TOTAL DES ORGANISMES DE GOUVERNEMENTS ÉTRANGERS			210 140	209 841
TOTAL DES PLACEMENTS DANS DES TITRES - 99,3 %				
			87 732 780	89 533 036
Autres actifs en excédent du passif - 0,7 %				611 853
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES - 100,0 %				
				90 144 889 \$

* Source : Agence de notation Standard & Poor's.

Les notes ci-jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Notes des états financiers

1. LES FONDS

Les Fonds suivants sont des fonds négociés en Bourse, dont chacun est une fiducie créée sous le régime des lois de la province d'Ontario et régie par une déclaration de fiducie.

Le 19 février 2020, CI Financial Corp. (TSX : CIX) a finalisé l'acquisition de toutes les actions émises et en circulation de WisdomTree Asset Management Canada, Inc.

Le 19 février 2020, le nom du fiduciaire, gestionnaire et promoteur, soit WisdomTree Asset Management Canada, Inc., a été changé pour CI ETF Investment Management Inc..

Le 1^{er} juillet 2020, CI ETF Investment Management Inc. a fusionné avec CI Investments Inc. (« CI »). Le 1^{er} juillet 2020, CI est devenu le fiduciaire (le « fiduciaire ») et le gestionnaire (le « gestionnaire ») des Fonds.

StateStreet Bank est le dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds.

Le siège social des Fonds est situé au 2, rue Queen Est, 20^e étage, Toronto (Ontario) M5C 3G7

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le gestionnaire le 17 août 2020. Le gestionnaire est une filiale de CI Financial Corp.

Le tableau qui suit présente la date d'inscription de chaque catégorie de titres de chaque Fonds à la cote de la Bourse de Toronto (TSX).

Fonds	Symbole boursier à la TSX	Parts couvertes	Symbole boursier à la TSX	Parts non couvertes	Symbole boursier à la TSX	Parts à couverture variable
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	–	–	CHNA.B	1-Aug-18	–	–
FNB d'actions mondiales ONE CI	ONEQ	21-Sep-15	–	–	–	–
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	ONEB	9-Oct-18	–	–	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	–	–	DGRC	19-Sep-17	–	–
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	–	–	EMV.B	19-Sep-17	–	–
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	EHE	12-Jul-16	EHE.B	8-Aug-17	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	IQD	12-Jul-16	IQD.B	12-Jul-16	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	–	–	–	–	DQI	12-Jul-16
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	JAPN	1-Aug-18	JAPN.B	1-Aug-18	–	–
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	UMI	19-Sep-17	UMI.B	19-Sep-17	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	DGR	12-Jul-16	DGR.B	12-Jul-16	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	–	–	–	–	DQD	12-Jul-16
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	–	–	CAGG	22-Jun-17	–	–
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	–	–	CAGS	22-Jun-17	–	–

Les Fonds offrent des parts non couvertes, des parts couvertes et des parts à couverture variable sur une base continue.

L'objectif de chaque Fonds est de regrouper et de gérer les sommes provenant des investisseurs porteurs de parts qui ont des objectifs de placement similaires. Les Fonds peuvent investir dans des actions, des titres à revenu fixe, des dérivés, des fonds

Notes des états financiers (suite)

sous-jacents ou une combinaison de ceux-ci en fonction de leurs objectifs et stratégies de placement spécifiques. Les Fonds peuvent détenir des placements en vue d'obtenir un revenu ou une plus-value en capital ou les deux.

Fonds	Objectif de placement
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice S&P China 500 Index CAD, compte non tenu des frais.
FNB d'actions mondiales ONE CI	Le Fonds cherche à procurer une croissance du capital à long terme en investissant dans un portefeuille de titres de capitaux propres d'émetteurs mondiaux, au moyen d'achats directs de titres de sociétés ouvertes ou de fonds négociés en Bourse qui représentent une catégorie de titres de capitaux propres.
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	Le Fonds cherche à offrir un taux de rendement stable, principalement au moyen de revenus et, dans une moindre mesure, grâce à l'appréciation du capital découlant de placements dans un portefeuille composé essentiellement de titres à revenu fixe nord-américains de qualité émis par des sociétés, des gouvernements (fédéraux, d'État ou provinciaux) et des entités et des organismes reliés à des gouvernements, au moyen d'achats directs ou par l'entremise de FNB.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree Canada Quality Dividend Growth Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree Emerging Markets Dividend Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree Europe Equity Index Hedged to CAD, compte non tenu des frais, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le rendement de l'indice WisdomTree Europe Equity Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Index (CAD), compte non tenu des frais.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Index Variably Hedged to CAD, compte non tenu des frais.
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree Japan Equity Index Hedged to CAD, compte non tenu des frais, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le rendement de l'indice WisdomTree Japan Equity Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend Index Hedged to CAD, compte non tenu des frais, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le rendement de l'indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	En ce qui concerne les parts couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Index Hedged to CAD, compte non tenu des frais, et en ce qui concerne les parts non couvertes, le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le rendement de l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Index Variably Hedged to CAD, compte non tenu des frais.
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Barclays Canadian Aggregate Enhanced Yield Index, compte non tenu des frais.

Notes des états financiers (suite)

Fonds	Objectif de placement
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Le Fonds cherche à reproduire, dans la mesure où c'est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Barclays Canadian Short Aggregate Enhanced Yield Index, compte non tenu des frais.

Les états de la situation financière sont au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019, selon le cas. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et les tableaux des flux de trésorerie visent les périodes closes les 30 juin 2020 et 2019, sauf pour les Fonds créés au cours de l'une ou l'autre de ces périodes, auquel cas l'information est présentée pour la période allant de la date de création aux 30 juin 2020 et 2019, selon le cas.

2. SOMMAIRE DES PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Les présents états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS ») publiées par l'International Accounting Standards Board (« IASB »).

Répercussions du coronavirus 19 (COVID-19) — Depuis l'éclosion de la COVID-19, les mesures d'urgence prises pour lutter contre sa propagation ont entraîné une perturbation importante des activités commerciales dans le monde entier, ce qui a entraîné un ralentissement économique. Les marchés boursiers et financiers mondiaux ont également connu une volatilité et une faiblesse importantes. Les gouvernements ont réagi en prenant des mesures monétaires et budgétaires importantes en vue de stabiliser l'économie. Comme la situation est en constante évolution, la durée et les répercussions de la pandémie de COVID-19 sont très incertaines et ne peuvent être prévues pour le moment, mais pourraient avoir une incidence importante sur le rendement futur des Fonds. Dans le contexte actuel caractérisé par une incertitude et une volatilité des marchés accrues, le gestionnaire maintient sa surveillance étroite de l'incidence de la pandémie sur l'exposition des Fonds au risque lié aux titres en portefeuille.

Un résumé des principales méthodes comptables appliquées par les Fonds est présenté ci-après :

a. Classement et comptabilisation des instruments financiers — Les actifs et passifs financiers sont comptabilisés lorsque l'entité devient partie aux dispositions contractuelles de l'instrument et à la date de transaction. Lors de la comptabilisation initiale, les Fonds évaluent un actif financier ou un passif financier à sa juste valeur, nette des coûts de transaction.

Les portefeuilles de placement des Fonds continuent d'être classés à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »). Le classement des actifs financiers selon l'IFRS 9, *Instruments financiers*, découle du modèle économique que suivent les Fonds pour la gestion des actifs financiers et des caractéristiques de leurs flux de trésorerie contractuels. En ce qui concerne les portefeuilles de placement, le gestionnaire s'intéresse d'abord à la juste valeur et c'est cette information qu'il utilise pour évaluer le rendement des actifs et prendre des décisions. En outre, les Fonds n'ont pas choisi de désigner irrévocablement les titres de capitaux propres à la juste valeur par le biais du résultat global (« JVAERG »). Par conséquent, la majorité des actifs financiers des Fonds, notamment les actifs dérivés et les placements à court terme dont l'échéance est d'au plus un an à compter de la date d'acquisition, sont classés à la JVRN.

Instruments financiers désignés à la JVRN : Tous les placements détenus par les Fonds, y compris les dérivés, sont désignés à la JVRN lors de la comptabilisation initiale. Les placements dans cette catégorie comprennent les actions, les fonds sous-jacents, les titres à revenu fixe et d'autres placements portant intérêt. Ces actifs financiers sont désignés ainsi lors de la comptabilisation initiale, car ils font partie d'un groupe d'actifs financiers qui sont gérés et dont la performance est évaluée à la juste valeur, conformément aux stratégies de gestion du risque et de placement des Fonds, comme il est décrit dans les prospectus des Fonds.

Les prêts et créances et les autres actifs et passifs (autres que ceux classés à la JVRN) sont évalués au coût amorti (qui se rapproche de la juste valeur). Cette catégorie comprend la trésorerie, les dépôts à court terme, les intérêts courus et les dividendes à recevoir, les montants à recevoir des porteurs de parts, des courtiers et des parties liées, les autres actifs, les montants à payer aux porteurs de parts, aux courtiers et aux parties liées, et les autres passifs.

Placements à court terme

Chaque Fonds peut investir une partie de ses actifs dans des instruments du marché monétaire de grande qualité sur une base régulière dans le but de dégager des liquidités et à d'autres fins. Les instruments comprennent des obligations à court terme émises par le gouvernement canadien et ses agences, des organismes gouvernementaux américains, des certificats de dépôt négociables, des dépôts à terme et des acceptations bancaires de banques américaines et étrangères et d'institutions semblables, du papier commercial, des mises en pension de titres et des fonds du marché monétaire. Les certificats de dépôt sont des obligations négociables à court terme de banques commerciales. Les dépôts à terme sont des dépôts non négociables conservés dans des institutions bancaires pour des périodes précises à des taux d'intérêt déterminés. Les acceptations bancaires sont des effets à terme prélevés auprès de banques commerciales par les emprunteurs, généralement dans le cadre de transactions internationales.

Notes des états financiers (suite)

Dépréciation d'actifs financiers

À chaque période de présentation de l'information financière, les Fonds évaluent s'il existe une indication objective de dépréciation d'un actif financier au coût amorti. Si une telle indication existe, les Fonds comptabilisent une perte de valeur, qui correspond à la différence entre le coût amorti de l'actif financier et la valeur actualisée des flux de trésorerie futurs estimés, déterminée à l'aide du taux d'intérêt effectif initial de l'instrument. Un actif ayant subi une perte de valeur est radié lorsque l'on ne peut plus s'attendre à ce que les efforts de recouvrement produisent d'autres avantages. Les pertes de valeur sur un actif financier au coût amorti sont reprises au cours de périodes ultérieures si le montant de la perte diminue et si cette diminution peut être objectivement liée à un événement ultérieur à la comptabilisation de la perte de valeur.

Décomptabilisation d'instruments financiers

Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de recevoir des flux de trésorerie des actifs a expiré ou a été transféré et lorsque les Fonds ont transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété des actifs. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation mentionnée au contrat est résiliée, annulée ou arrivée à échéance. Les profits et les pertes réalisés sont comptabilisés selon la méthode du coût moyen et présentés aux états du résultat global au cours de la période pendant laquelle ils sont survenus.

Autres passifs financiers

Cette catégorie comprend tous les passifs financiers, autres que ceux classés à la JVRN, notamment les montants à payer pour les titres en portefeuille achetés et d'autres charges à payer. Un actif financier ou un passif financier est comptabilisé lorsqu'un Fonds devient partie aux dispositions contractuelles de l'instrument. Les achats ou les ventes d'actifs financiers qui requièrent la livraison des actifs dans un délai généralement établi par règlement ou convention sur le marché (opérations sur titres avec délai normalisé) sont comptabilisés à la date de la transaction, c'est-à-dire la date à laquelle un Fonds s'engage à acheter ou à vendre l'actif.

b. Évaluation des placements — Les actifs et les passifs financiers désignés à la JVRN sont comptabilisés aux états de la situation financière à la juste valeur au moment de la comptabilisation initiale. Tous les coûts de transaction, comme les commissions de courtage, engagés dans l'achat et la vente de titres pour ces instruments sont comptabilisés directement en résultat. Les prêts et créances et les autres passifs financiers sont évalués initialement à leur juste valeur, plus les coûts d'acquisition ou d'émission marginaux qui leur sont directement attribuables. Pour les actifs financiers et les passifs financiers dont la juste valeur à la comptabilisation initiale n'est pas égale au prix de transaction, les Fonds comptabilisent l'écart aux états du résultat global, à moins d'indication contraire.

Après l'évaluation initiale, les Fonds évaluent à la juste valeur les instruments financiers qui sont classés à la JVRN. Tout changement ultérieur de la juste valeur de ces instruments financiers (c.-à-d., l'excédent [l'insuffisance] de la somme de la juste valeur des placements de portefeuille par rapport à la somme du coût moyen de chaque placement de portefeuille) est comptabilisé à titre de variation de la plus-value (moins-value) latente des placements. La variation de la plus-value (moins-value) latente des placements pour la période visée est portée aux états du résultat global.

Le coût moyen des placements d'un portefeuille représente la somme du coût moyen de chaque placement. Aux fins de déterminer le coût moyen de chaque placement, le prix d'achat des placements acquis par un Fonds est ajouté au coût moyen du placement immédiatement après l'achat. Le coût moyen d'un placement est réduit du nombre d'actions vendues multiplié par le coût moyen du placement au moment de la vente. Le coût moyen par action de chaque placement vendu est établi en divisant le coût moyen du placement par le nombre d'actions détenues immédiatement avant la vente. Les coûts de transaction engagés dans les opérations d'achat et de vente sont exclus du coût moyen des placements, comptabilisés immédiatement dans le résultat net et présentés comme une charge distincte dans les états financiers. Les profits et les pertes réalisés tirés de la vente des placements sont également calculés à partir des coûts moyens, exclusion faite des coûts de transaction, du placement connexe.

c. Trésorerie — La trésorerie se compose des dépôts en numéraire auprès d'une institution financière canadienne et est présentée à sa juste valeur.

d. Coût des placements — Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est établi sur la base du coût moyen, compte non tenu des commissions et des coûts de transaction. Le coût moyen ne tient pas compte de l'amortissement des primes ou escomptes sur les titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro.

e. Comptabilisation des opérations et du revenu de placement — Les opérations de placement sont comptabilisées à la date d'achat ou de vente des titres (date de la transaction). Les profits et les pertes latents et réalisés sont calculés sur la base du coût moyen. Le coût des placements représente le montant payé pour chaque titre et est établi selon la méthode du coût moyen, compte non tenu des commissions et des coûts de transaction. Les coûts de transaction, comme les commissions de courtage engagées à l'achat ou à la vente de titres, sont présentés à un poste distinct aux états du résultat global et ne font pas partie des coûts de placement. Le revenu de dividende est comptabilisé à la date ex-dividende, compte non tenu des retenues d'impôt étranger. Les intérêts aux fins de distribution présentés aux états du résultat global représentent les intérêts des coupons reçus par les Fonds et comptabilisés selon la

Notes des états financiers (suite)

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.

f. Change — Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Fonds. Le dollar canadien est la monnaie de l'environnement économique principal dans lequel les Fonds exercent leurs activités. Le rendement des Fonds est évalué et leurs liquidités sont gérées en dollars canadiens. Par conséquent, le dollar canadien est la monnaie qui présente le plus fidèlement les incidences économiques des transactions, événements et conditions sous-jacents.

Les devises, ainsi que les titres de placement et les autres actifs et passifs libellés en devises, sont convertis en dollars canadiens au moyen des taux de change en vigueur aux dates respectives de ces transactions qui sont jugés comme étant appropriés par le gestionnaire. Les écarts de change réalisés et latents sur les placements sont présentés respectivement comme des composantes des postes Profit net (perte nette) réalisé(e) à la vente de placements et Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements aux états du résultat global. Les écarts nets de change réalisés et latents découlant de la vente de devises, y compris les profits et les pertes sur contrats de change à terme, les écarts de change comptabilisés entre la date de transaction et la date de règlement sur les opérations de placement, et l'écart entre les montants des dividendes et des retenues d'impôt étranger comptabilisé dans les comptes des Fonds et l'équivalent en dollars canadiens des montants réellement reçus ou versés sont compris dans les postes Profit net (perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change et sur les opérations en devises et Variation nette de la plus-value (moins-value) latente des contrats de change et des opérations en devises aux états du résultat global.

g. Opérations en devises — Les Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme et des contrats de change à terme standardisés pour faciliter les règlements de titres en monnaie locale ou se protéger contre le risque de change. Les parts non couvertes ne devraient pas faire l'objet d'opérations en devises à des fins de couverture contre la baisse de valeur des actifs d'un Fonds qui est libellé dans une ou plusieurs devises. Les Fonds ne peuvent pas conclure ce type de contrats à des fins de spéculation.

h. Évaluation des parts — La valeur liquidative par part de chaque catégorie est calculée à la fin de chaque jour ouvrable, soit tout jour pendant lequel une séance est tenue à la TSX ou tout autre jour désigné par CI, en divisant la valeur liquidative totale de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre de parts de la catégorie en circulation.

La valeur liquidative de chaque catégorie correspond à la quote-part de cette catégorie des actifs du Fonds, moins la quote-part de cette catégorie du passif commun du Fonds et le passif propre à cette catégorie. Les charges directement liées à une catégorie sont imputées à cette catégorie. Les autres revenus et charges, ainsi que les profits et les pertes, sont répartis entre les catégories de manière proportionnelle en fonction de la valeur liquidative totale relative de chaque catégorie.

Aux 30 juin 2020, 31 décembre 2019 et 30 juin 2019, il n'y avait aucune différence entre la valeur liquidative utilisée pour les opérations avec les porteurs de parts et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables utilisé aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

i. Classement des parts — Les parts des Fonds sont classées à titre de passifs financiers conformément à l'IAS 32, car elles ne répondent pas à la définition d'instruments remboursables au gré du porteur devant être classés à titre de capitaux propres conformément à l'IAS 32 aux fins de présentation de l'information financière.

j. Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille — Les coûts de transaction, comme les commissions de courtage, engagés dans l'achat et la vente de titres sont comptabilisés directement en résultat.

Les Fonds qui investissent uniquement dans des parts de fonds sous-jacents ne font pas l'objet de commissions.

k. Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables provenant de l'exploitation par part — L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables provenant de l'exploitation par part est calculée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables provenant de l'exploitation par part par le nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période.

l. Contrats de change à terme — Un contrat de change à terme (« contrat à terme ») comporte une obligation d'acheter ou de vendre une devise déterminée à une date future, laquelle peut être fixée à un certain nombre de jours de la date du contrat conclu par les parties, à un prix établi au moment de la conclusion du contrat. Ces contrats sont principalement négociés sur le marché interbancaire et conclus directement par les cambistes (en règle générale, de grandes banques commerciales) et leurs clients. De manière générale, un contrat à terme ne requiert pas de dépôt de marge initiale et aucune commission n'est versée à aucun moment de la négociation. Toutefois, si un Fonds est en position de perte latente sur un contrat à terme, il peut être tenu de donner une garantie (ou une garantie supplémentaire) à la contrepartie. Si un Fonds est dans une position de profit latent sur un contrat à terme, il peut recevoir une garantie de la part de la contrepartie.

L'incapacité éventuelle des contreparties à respecter les conditions des contrats à terme ainsi que les fluctuations imprévues de la valeur des devises par rapport au dollar canadien peuvent entraîner des risques.

Notes des états financiers (suite)

Les Fonds comptabilisent les fluctuations de la valeur des contrats à terme en cours à titre de plus-value (moins-value) latente des contrats de change. Le profit net (la perte nette) réalisé(e) sur les contrats de change comprend les profits nets et les pertes nettes comptabilisés par les Fonds sur les contrats qui sont échus ou vendus.

m. Compensation des instruments financiers — Le risque de crédit de la contrepartie lié à des dérivés hors cote de chaque Fonds est habituellement limité au profit latent total porté en déduction de toute garantie détenue par le Fonds. Le Fonds tente de réduire le risque de contrepartie en concluant uniquement des ententes avec des contreparties qui, selon lui, disposent de ressources financières suffisantes pour respecter leurs obligations, et en surveillant la stabilité financière de ces contreparties. Tous les Fonds règlent les contrats de change sur une base nette.

Dans le but de mieux définir ses droits contractuels et d'obtenir des garanties pouvant l'aider à réduire le risque de contrepartie, un Fonds peut conclure une convention-cadre régie par l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (« convention-cadre de l'ISDA ») ou une convention similaire avec chacune des contreparties.

Aux fins de la présentation de l'information financière, les actifs et passifs financiers sont compensés lorsque le fonds bénéficie d'un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il a l'intention, soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les montants nets figurant dans le tableau ci-dessous sont présentés dans les états de la situation financière du Fonds considéré.

Au 30 juin 2020

Fonds	Actifs				Passifs			
	Montants bruts compris dans les états de la situation financière	Montants bruts non compensés aux états de la situation financière		Montant net	Montants bruts compris dans les états de la situation financière	Montants bruts non compensés aux états de la situation financière		Montant net
		Instruments financiers	Garantie reçue			Instruments financiers	Garantie reçue	
FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI								
Contrats de change	29 \$	(26)\$	– \$	3 \$	26 \$	(26)\$	– \$	– \$
FNB d'actions mondiales ONE CI								
Contrats de change	9 544	–	–	9 544	–	–	–	–
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI								
Contrats de change	111 872	(954)	–	110 918	976	(954)	–	22
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI								
Contrats de change	201 713	(35 758)	–	165 955	37 009	(35 758)	–	1 251
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI								
Contrats de change	60 381	(13 559)	–	46 822	13 928	(13 559)	–	369
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI								
Contrats de change	69 391	(123)	–	69 268	283	(123)	–	160
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI								
Contrats de change	151 235	(224)	–	151 011	765	(224)	–	541
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI								
Contrats de change	317 460	(1 283)	–	316 177	1 283	(1 283)	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI								
Contrats de change	298 418	(326)	–	298 092	3 648	(326)	–	3 322

Notes des états financiers (suite)

Au 31 décembre 2019

Fonds	Actifs				Passifs			
	Montants bruts compris dans les états de la situation financière	Montants bruts non compensés aux états de la situation financière		Montant net	Montants bruts compris dans les états de la situation financière	Montants bruts non compensés aux états de la situation financière		Montant net
		Instruments financiers	Garantie reçue			Instruments financiers	Garantie reçue	
FNB d'actions mondiales ONE CI								
Contrats de change	163 241 \$	– \$	– \$	163 241 \$	– \$	– \$	– \$	– \$
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI								
Contrats de change	1 823	(11)	–	1 812	11	(11)	–	–
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI								
Contrats de change	323 636	(50 589)	–	273 047	51 365	(50 589)	–	776
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI								
Contrats de change	300 656	(65 370)	–	235 286	66 232	(65 370)	–	862
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI								
Contrats de change	118 178	(36 382)	–	81 796	37 177	(36 382)	–	795
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI								
Contrats de change	90 268	(441)	–	89 827	667	(441)	–	226
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI								
Contrats de change	363 248	(6 522)	–	356 726	7 157	(6 522)	–	635
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI								
Contrats de change	712 654	(12 836)	–	699 818	12 836	(12 836)	–	–
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI								
Contrats de change	441 397	(18 492)	–	422 905	18 951	(18 492)	–	459

n. Placements dans des sociétés associées, des coentreprises, des filiales et des entités structurées non consolidées — Afin d'atteindre son objectif de placement, le Fonds peut détenir des titres d'un Fonds sous-jacent qui permet au Fonds, le cas échéant, de reproduire le rendement de l'indice, comme il est stipulé dans son prospectus, ou d'accroître son exposition à un pays, un secteur ou une catégorie d'actifs en particulier.

Pour déterminer si le Fonds exerce un contrôle ou une influence significative sur un Fonds sous-jacent, le Fonds évalue ses droits de vote, l'exposition à des rendements variables et sa capacité d'utiliser ses droits de vote pour influencer sur les rendements obtenus. S'il est déterminé que le Fonds exerce un contrôle sur un Fonds sous-jacent, il est considéré comme une entité d'investissement aux termes de l'IFRS 10, *États financiers consolidés*, et, par conséquent, il comptabilise les placements qu'il contrôle à la JVRN. Le but principal du Fonds est défini par ses objectifs de placement et a recours aux stratégies de placement telles qu'elles sont définies dans le prospectus pour atteindre ces objectifs. Le Fonds mesure et évalue également à la juste valeur le rendement de tout Fonds sous-jacent.

Les placements dans un Fonds sous-jacent sont exposés au risque de prix découlant des incertitudes relatives aux cours futurs de ce Fonds sous-jacent. L'exposition maximale aux pertes découlant de participation dans des Fonds sous-jacents correspond au total de la juste valeur du placement dans ces Fonds sous-jacents à tout moment. La juste valeur d'un Fonds sous-jacent, le cas échéant, est présentée dans les placements dans les états de la situation financière et dans l'inventaire du portefeuille.

Les Fonds sous-jacents sur lesquels le Fonds exerce un contrôle ou une influence significative sont classés respectivement comme filiales ou entités associées. Tout autre Fonds sous-jacent est classé comme entité structurée non consolidée. Les Fonds sous-jacents peuvent être gérés par le gestionnaire, les membres de son groupe ou des gestionnaires tiers. Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019, les Fonds suivants détenaient des placements dans les Fonds sous-jacents énumérés ci-après et n'exerçaient pas un contrôle ou une influence significative sur ceux-ci :

Notes des états financiers (suite)

Au 30 juin 2020 :

Fonds / placement	Pays où le Fonds est établi	Participation dans le FNB sous-jacent	Actions/parts détenues
FNB d'actions mondiales ONE			
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI – parts couvertes	Canada	18,71 %	243 225
FINB de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation CI WisdomTree	Canada	12,26 %	66 331
iShares Cohen & Steers REIT ETF	États-Unis	0,02 %	3 729
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	États-Unis	0,00 %	24 818
iShares Micro-Cap ETF	États-Unis	0,18 %	14 988
iShares MSCI EAFE Small-Cap ETF	États-Unis	0,02 %	31 188
iShares Russell 2000 Growth ETF	États-Unis	0,01 %	5 316
iShares Russell 2000 Value ETF	États-Unis	0,01 %	8 335
iShares S&P/TSX Capped REIT Index ETF	Canada	0,02 %	13 122
iShares S&P/TSX Completion Index ETF	Canada	1,77 %	108 218
SPDR Dow Jones International Real Estate ETF	États-Unis	0,04 %	7 584
FNB d'obligations essentielles nord – américaines Plus ONE			
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Canada	2,48 %	72 120
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Canada	60,45 %	1 088 170

Au 31 décembre 2019 :

Fonds / placement	Pays où le Fonds est établi	Participation dans le FNB sous-jacent	Actions/parts détenues
FNB d'actions mondiales ONE			
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI – parts couvertes	Canada	17,91 %	250 729
FINB de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation CI WisdomTree	Canada	11,57 %	68 378
iShares Cohen & Steers REIT ETF	États-Unis	0,02 %	3 844
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	États-Unis	0,00 %	25 584
iShares Micro-Cap ETF	États-Unis	0,18 %	15 451
iShares MSCI EAFE Small-Cap ETF	États-Unis	0,02 %	32 150
iShares Russell 2000 Growth ETF	États-Unis	0,01 %	5 480
iShares Russell 2000 Value ETF	États-Unis	0,01 %	8 592
iShares S&P/TSX Capped REIT Index ETF	Canada	0,02 %	13 526
iShares S&P/TSX Completion Index ETF	Canada	1,59 %	111 557
SPDR Dow Jones International Real Estate ETF	États-Unis	0,01 %	7 818
WisdomTree India Earnings Fund	États-Unis	0,05 %	18 566
FNB d'obligations essentielles nord – américaines Plus ONE			
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Canada	5,16 %	165 878
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Canada	61,07 %	1 282 514

3. ESTIMATIONS COMPTABLES CRITIQUES ET JUGEMENTS

La préparation des états financiers conformément aux IFRS exige de la direction qu'elle pose des jugements et fasse des estimations et formule des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables ainsi que sur les montants des actifs et des passifs présentés à la date considérée et les montants des produits et des charges présentés pour la période de présentation de l'information financière. Les paragraphes suivants traitent des principaux jugements et estimations comptables des Fonds lors de la préparation de leurs états financiers :

Évaluation de la juste valeur des placements et des dérivés non cotés sur un marché actif — De temps à autre, le Fonds peut 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 une cote fournie par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur

Notes des états financiers (suite)

juste valeur est évaluée par le gestionnaire en fonction des derniers renseignements publiés. La juste valeur des titres privés est établie à l'aide de modèles d'évaluation qui peuvent être fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre notamment 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 évaluées de manière indépendante par le gestionnaire en fonction d'hypothèses et d'estimations fondées sur les paramètres disponibles au moment de la préparation des états financiers. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres privés.

Dans la mesure du possible, les modèles d'évaluation font appel à des données observables. Depuis l'écllosion de la COVID-19, la volatilité du marché a considérablement augmenté, ce qui entraîne une fluctuation des prix des titres cotés, un élargissement des écarts acheteur-vendeur et une réduction des liquidités sur le marché. Ces variations peuvent également avoir une incidence sur le caractère observable de certaines des données d'évaluation utilisées dans les modèles, ce qui peut avoir une incidence sur le classement de certains instruments financiers dans la hiérarchie de la juste valeur. Le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre que le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités et les corrélations. 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 plusieurs fonds sous-jacents qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs est déterminée principalement par référence à la valeur liquidative disponible la plus récente de ces parts pour chaque fonds sous-jacent, telle que déterminée par les gestionnaires du ou des fonds sous-jacents.

4. PARTS RACHETABLES

Chacun des Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts cessibles et rachetables d'un nombre illimité de catégories de parts, représentant une quote-part égale et indivise de son actif net. Les parts des Fonds sont libellées en dollars canadiens.

Toutes les parts d'un Fonds comportent des droits et des privilèges égaux. Chaque part entière donne droit à une voix à toutes les assemblées des porteurs de parts et confère le droit aux porteurs de parts de participer à parts égales à toutes les distributions effectuées par un Fonds en leur faveur, sauf les distributions de frais de gestion, y compris les distributions de revenu net et de gains en capital réalisés nets et toute distribution effectuée à la dissolution du Fonds. Les distributions de gains en capital sont automatiquement réinvesties dans des parts additionnelles du Fonds, et ces parts sont immédiatement regroupées de sorte que la valeur liquidative par part demeure inchangée. Seules des parts entièrement libérées et non susceptibles d'appel subséquent sont émises.

N'importe quel jour de Bourse, les porteurs de parts peuvent échanger le nombre prescrit de parts (ou un multiple intégral de celui-ci) contre des paniers de titres ou une somme en espèces.

N'importe quel jour de Bourse, les porteurs de parts peuvent faire racheter des parts de Fonds au comptant à un prix de rachat par part correspondant au moins élevé des montants suivants : i) 95 % du cours de clôture pour les parts à la TSX le jour de prise d'effet du rachat; et ii) la valeur liquidative par part le jour de prise d'effet du rachat. Le droit de faire racheter des parts d'un Fonds peut être suspendu sur approbation des Autorités canadiennes en valeurs mobilières.

Les opérations sur les parts de chaque Fonds sont présentées ci-dessous. La contrepartie versée à l'achat des parts de lancement d'un Fonds consiste généralement en une contribution en nature d'un portefeuille désigné de titres de capitaux propres constituant une représentation de l'échantillonnage du portefeuille des titres compris dans l'indice sous-jacent Fonds en cause et un montant en espèces. Les investisseurs qui souscrivent des parts de lancement ou qui en font racheter peuvent se voir imposer des frais liés à la transaction d'achat et à la transaction de rachat pour compenser le transfert et les autres coûts de transaction associés à l'émission et au rachat des parts de lancement.

Fonds / Catégorie de parts	Période (note 1)	Début de la période	Émises	Rachetées	Fin de la période
FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI					
Parts non couvertes	2020	100 000	—	—	100 000
	2019	100 000	—	—	100 000

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Catégorie de parts	Période (note 1)	Début de la période	Émises	Rachetées	Fin de la période
FNB d'actions mondiales ONE CI	2020	1 700 000	50 000	(100 000)	1 650 000
	2019	1 850 000	100 000	(250 000)	1 700 000
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	2020	1 800 000	–	(200 000)	1 600 000
	2019	1 900 000	100 000	(200 000)	1 800 000
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI					
Parts non couvertes	2020	8 100 000	1 800 000	(450 000)	9 450 000
	2019	3 650 000	4 650 000	(200 000)	8 100 000
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI					
Parts non couvertes	2020	1 300 000	100 000	–	1 400 000
	2019	200 000	1 100 000	–	1 300 000
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI					
Parts non couvertes	2020	1 000 000	–	(200 000)	800 000
	2019	1 200 000	–	(200 000)	1 000 000
Parts couvertes	2020	1 250 000	50 000	(350 000)	950 000
	2019	1 750 000	–	(500 000)	1 250 000
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI					
Parts couvertes	2020	1 400 000	–	(100 000)	1 300 000
	2019	1 400 000	–	–	1 400 000
Parts non couvertes	2020	800 000	200 000	–	1 000 000
	2019	500 000	300 000	–	800 000
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI					
Parts à couverture variable	2020	900 000	–	(100 000)	800 000
	2019	1 200 000	500 000	(800 000)	900 000
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI					
Parts couvertes	2020	200 000	–	–	200 000
	2019	200 000	200 000	(200 000)	200 000
Parts non couvertes	2020	500 000	100 000	–	600 000
	2019	300 000	300 000	(100 000)	500 000
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI					
Parts couvertes	2020	591 082	–	(50 000)	541 082
	2019	791 082	50 000	(250 000)	591 082
Parts non couvertes	2020	50 000	–	–	50 000
	2019	100 000	–	(50 000)	50 000
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI					
Parts couvertes	2020	1 104 175	100 000	(500 000)	704 175
	2019	854 175	400 000	(150 000)	1 104 175
Parts non couvertes	2020	2 850 000	200 000	(1 750 000)	1 300 000
	2019	2 650 000	500 000	(300 000)	2 850 000
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI					
Parts à couverture variable	2020	1 300 000	450 000	(150 000)	1 600 000
	2019	950 000	450 000	(100 000)	1 300 000
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI					
Parts non couvertes	2020	3 213 163	–	(300 000)	2 913 163
	2019	2 413 163	1 100 000	(300 000)	3 213 163
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI					
Parts non couvertes	2020	2 100 000	550 000	(850 000)	1 800 000
	2019	2 000 000	600 000	(500 000)	2 100 000

Notes des états financiers (suite)

Les parts émises et en circulation sont considérées comme constituant le capital des Fonds. Les Fonds ne sont pas assujettis à des exigences externes en matière de capital et ne font pas l'objet, au-delà de celles énoncées dans le prospectus du Fonds concerné, de restrictions d'ordre juridique sur l'émission, le rachat ou la revente de parts rachetables. Le capital reçu par un Fonds est géré de manière à ce qu'il atteigne ses objectifs de placement, tout en maintenant des liquidités suffisantes pour répondre aux rachats demandés par les porteurs de parts.

Fonds	Catégorie de parts		
	Parts non couvertes	Parts couvertes	Parts à couverture variable
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	X		
FNB d'actions mondiales ONE CI			
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI			
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	X		
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	X		
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	X	X	
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	X	X	
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI			X
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	X	X	
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	X	X	
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	X	X	
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI			X
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	X		
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	X		

5. FRAIS ET AUTRES CHARGES

Frais de gestion — Chaque Fonds versera au gestionnaire les frais de gestion indiqués dans le tableau suivant en fonction de la valeur liquidative quotidienne moyenne des parts du Fonds. Le gestionnaire de chaque Fonds gère les activités quotidiennes de chaque Fonds, dont la négociation d'ententes avec des fournisseurs de services et la supervision de ceux-ci, la préparation de rapports destinés aux porteurs de parts et aux autorités en valeurs mobilières et la gestion des activités de commercialisation. Le gestionnaire agit également à titre de fiduciaire des Fonds. Les frais de gestion, majorés des taxes applicables, seront cumulés quotidiennement et seront payés chaque mois à terme échu. Le gestionnaire peut, à son gré, renoncer à une partie ou à la totalité des frais de gestion imposés à tout moment.

Fonds	Taux des frais de gestion
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	
Parts non couvertes	0,55 %
FNB d'actions mondiales ONE CI	0,85 %
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	0,55 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	
Parts non couvertes	0,21 %
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	
Parts non couvertes	0,38 %
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	
Parts couvertes	0,58 %
Parts non couvertes	0,55 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	
Parts couvertes	0,58 %
Parts non couvertes	0,48 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds	Taux des frais de gestion
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI Parts à couverture variable	0,63 %
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI Parts couvertes	0,51 %
Parts non couvertes	0,48 %
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI Parts couvertes	0,38 %
Parts non couvertes	0,35 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI Parts couvertes	0,38 %
Parts non couvertes	0,35 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI Parts à couverture variable	0,43 %
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI Parts non couvertes	0,18 %
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI Parts non couvertes	0,18 %

Pour que les frais de gestion soient efficaces et concurrentiels, le gestionnaire peut convenir d'imposer des frais de gestion réduits par rapport aux frais de gestion auxquels il aurait autrement droit de la part des Fonds à l'égard des placements dans les Fonds par certains porteurs de parts. Une somme égale à la différence entre les frais de gestion autrement facturables et les frais réduits du Fonds sera distribuée en espèces par le Fonds à ces porteurs à titre de distributions de frais de gestion.

Charges d'exploitation — Outre les frais de gestion, chaque Fonds doit régler i) les frais engagés pour se conformer au Règlement 81-107 (notamment les frais liés à la mise sur pied et à l'exploitation continue du comité d'examen indépendant des Fonds), ii) les courtages et les autres frais, charges, taxes, impôts ou droits (comme les droits de timbre) engagés dans le cadre de l'exécution d'opérations de portefeuille ou d'opérations de création, d'échange et de rachat (notamment les frais, les charges, les taxes, les impôts ou les droits liés à l'achat ou à la vente de toute quantité de devises, ou au rapatriement de tout titre ou autre actif, liés à l'exécution d'opérations de portefeuille ou d'opérations de création, d'échange et de rachat), iii) les frais juridiques liés à un processus d'arbitrage, à un litige ou à un processus d'arbitrage ou à un litige en cours ou imminent, notamment dans le cadre de règlements conclus dans le cadre de ceux-ci, iv) les frais de distribution versés par le Fonds dans le cadre d'un régime de réinvestissement des distributions adopté par le Fonds, v) les intérêts, les taxes et les impôts de quelque nature que ce soit (notamment l'impôt sur le revenu, la taxe d'accise, la taxe de transfert et les retenues d'impôt et les autres taxes applicables, dont la TPS et la TVH), vi) les frais liés à la prestation de services de prêt de titres, vii) les frais engagés pour se conformer à de nouvelles exigences du gouvernement ou des autorités de réglementation adoptées après l'établissement du Fonds, et viii) les dépenses extraordinaires. Le paiement ou la prise en charge, par le gestionnaire, des frais d'un Fonds décrits aux points i) à viii) ci-dessus, que le gestionnaire n'est pas tenu de payer ou de prendre à sa charge, n'oblige pas le gestionnaire à payer ou à prendre à sa charge ces frais ou des frais similaires d'un Fonds à un autre moment. Il incombe au gestionnaire de régler tous les autres coûts et frais des Fonds, y compris la rémunération payable au conseiller en valeurs, au dépositaire, à l'agent des transferts et à l'agent chargé de la tenue des registres, au mandataire aux fins du régime et à d'autres fournisseurs de services dont WisdomTree a retenu les services.

Frais des Fonds sous-jacents — Les Fonds peuvent investir dans un ou plusieurs Fonds gérés par le gestionnaire ou un membre de son groupe ou dans d'autres fonds négociés en Bourse (« Fonds sous-jacent ») gérés par des gestionnaires tiers. Les frais payables par le Fonds sous-jacent s'ajoutent aux frais payables par les Fonds sauf si le gestionnaire y renonce, à l'occasion. Toutefois, un Fonds peut investir dans un ou plusieurs Fonds sous-jacents dans la mesure où il n'a pas à verser de frais de gestion qui constitueraient un dédoublement des frais que doit payer le Fonds sous-jacent.

Placements dans d'autres fonds — Les Fonds peuvent investir dans d'autres Fonds gérés par le gestionnaire conformément à leurs objectifs de placement. L'information sur ces placements détenus par les Fonds au 30 juin 2020 est consignée à la note 2 du présent rapport.

6. PRÊT DE TITRES

Chaque Fonds peut prêter des titres en portefeuille à certains emprunteurs solvables, y compris l'agent de prêt de titres des Fonds. Selon la politique des Fonds, tous les prêts sont garantis par une sûreté d'au moins 102 % de la valeur des titres du portefeuille prêtés

Notes des états financiers (suite)

au moment de leur octroi. La valeur de marché globale de tous les titres prêtés par le Fonds ne peut dépasser 50 % des actifs du Fonds. Des garanties en espèces ou sous forme de titres de créance de première qualité, d'un montant équivalant à au moins 102 % de la valeur de marché des titres, sont maintenues en tout temps. Les garanties en espèces peuvent être investies dans des fonds communs de placement du marché monétaire qui sont également exposés aux fluctuations du marché. La valeur des placements des garanties en espèces pour les titres prêtés ainsi que les obligations de retourner ces garanties sont présentées aux états de la situation financière. Aux 30 juin 2020 et 2019, aucun Fonds ne participait à un prêt de titres.

7. IMPOSITION

Les Fonds sont admissibles à titre de fiducie de fonds commun de placement au sens de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Tous les revenus nets des Fonds aux fins de l'impôt et suffisamment de gains en capital réalisés nets au cours d'une année doivent être distribués aux porteurs de parts de sorte qu'aucun des Fonds ne soit assujéti à l'impôt sur le revenu. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôt sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôt liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé aux états de la situation financière. L'impôt sur le revenu sur le montant des gains en capital nets réalisés qui ne sont ni payés ni à payer est généralement recouvrable au moment du rachat aux termes des dispositions de remboursement prévues par la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). Parfois, les distributions des Fonds peuvent être supérieures à leurs revenus. Ces distributions excédentaires constituent un remboursement de capital et n'est pas imposable entre les mains des porteurs de parts.

8. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp., dans un membre de son groupe ou dans d'autres fonds de placement gérés par le gestionnaire, comme il est présenté dans les notes propres au Fonds aux états financiers de chaque Fonds, le cas échéant.

Opérations entre fonds — Les opérations entre fonds désignent l'achat d'un titre d'un émetteur auprès d'un autre Fonds géré par le gestionnaire ou sa vente à un autre Fonds. Ces opérations sont réalisées par des intermédiaires du marché et selon les conditions qui prévalent sur le marché. Le comité d'examen indépendant (CEI) passe en revue ces opérations dans le cadre de réunions prévues. Au cours de la période close le 30 juin 2020, certains Fonds ont réalisé des opérations entre fonds.

Opérations sur des fonds liés — Les opérations sur des fonds liés surviennent lorsqu'un fonds vend ou achète les parts ou actions d'un autre fonds géré par le gestionnaire. Au cours de la période close le 30 juin 2020, certains Fonds ont réalisé des opérations sur des fonds liés, ou détenaient des positions dans des fonds liés à la fin de la période.

Opérations avec un émetteur lié — Les opérations avec un émetteur lié ont lieu lorsqu'un Fonds achète ou vend des titres de CI Financial Corp. Ces opérations sont réalisées par des intermédiaires du marché et selon les conditions qui prévalent sur le marché. Le CEI passe en revue ces opérations dans le cadre de réunions prévues. Au cours de la période close le 30 juin 2020, certains Fonds ont réalisé des opérations avec un émetteur lié, ou détenait des positions dans CI Financial Corp. à la fin de la période.

9. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Gestion des risques — Les Fonds sont exposés à divers risques liés aux instruments financiers, notamment le risque de concentration, le risque de liquidité, le risque lié à la compensation des instruments financiers et le risque de marché (y compris l'autre risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt). Le niveau de risque auquel chaque Fonds est exposé est fonction de l'objectif de placement et du type de placements que détient le Fonds. La valeur des placements dans un portefeuille peut changer de jour en jour en raison des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur, des conditions du marché, de la conjoncture économique et des nouvelles propres aux sociétés dans lesquelles le Fonds a investi. Le gestionnaire des Fonds peut atténuer les effets négatifs de ces risques sur le rendement des Fonds à l'aide des mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions des Fonds et des événements du marché; la diversification du portefeuille de placements par catégorie d'actifs, pays, secteur et durée jusqu'à l'échéance, tout en respectant les objectifs établis; et par l'entremise des dérivés à titre de couverture de certains risques.

Notes des états financiers (suite)

Risque de concentration — Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie. Le tableau suivant présente le risque de concentration des Fonds au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019 :

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
FNB Indice China S&P 500 ICBCS CI		
Vente au détail par Internet et par marketing direct	14,1 %	12,4 %
Institutions financières	12,7 %	14,7 %
Médias et services interactifs	11,1 %	9,0 %
Assurance	5,3 %	6,8 %
Boissons	4,9 %	4,2 %
Gestion et promotion immobilières	4,6 %	5,6 %
Produits pharmaceutiques	4,3 %	3,4 %
Équipement, instruments et composants électroniques	4,0 %	3,4 %
Produits alimentaires	3,0 %	2,6 %
Métaux et exploitation minière	2,5 %	2,8 %
Produits ménagers durables	2,4 %	2,7 %
Machinerie	2,3 %	2,7 %
Matériel et produits semi-conducteurs	2,0 %	1,1 %
Pétrole, gaz et autres combustibles	1,9 %	2,8 %
Construction et génie	1,6 %	1,8 %
Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants	1,6 %	1,8 %
Logiciels	1,6 %	1,1 %
Produits chimiques	1,4 %	1,5 %
Matériaux de construction	1,3 %	1,6 %
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques	1,2 %	1,3 %
Services aux consommateurs diversifiés	1,2 %	0,9 %
Services de télécommunications sans fil	1,0 %	1,4 %
Automobiles	1,0 %	1,2 %
Marchés financiers	0,9 %	1,0 %
Matériel électrique	0,9 %	1,0 %
Infrastructures de transport	0,8 %	1,0 %
Hôtellerie, restauration et loisirs	0,5 %	1,0 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	9,3 %	8,4 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,8 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB d'actions mondiales ONE CI		
Fonds négociés en Bourse	47,7 %	49,7 %
Technologies de l'information	9,7 %	7,0 %
Services financiers	8,5 %	10,2 %
Soins de santé	6,8 %	5,6 %
Consommation de base	5,0 %	4,5 %
Services de communication	4,7 %	4,1 %
Industrie	4,5 %	3,5 %
Matériaux	4,1 %	4,8 %
Consommation discrétionnaire	3,1 %	2,8 %
Énergie	2,7 %	4,4 %
Services publics	1,9 %	1,6 %
Autres actifs moins les passifs	1,3 %	1,8 %
Total	100,0 %	100,0 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI		
Fonds négociés en Bourse	69,4 %	77,2 %
Obligations de sociétés	26,8 %	18,7 %
Obligations de sociétés étrangères	1,5 %	0,2 %
Obligations provinciales	1,0 %	0,9 %
Autres types de placement représentant moins de 1 % de l'actif net	0,2 %	–
Autres actifs moins les passifs	1,1 %	3,0 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI		
Assurance	10,7 %	5,2 %
Transport routier et ferroviaire	10,3 %	11,3 %
Métaux et exploitation minière	10,3 %	2,5 %
Services de télécommunications diversifiés	9,6 %	9,7 %
Pétrole, gaz et autres combustibles	8,2 %	5,7 %
Services professionnels	5,8 %	–
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base	5,5 %	7,0 %
Marchés financiers	5,5 %	2,3 %
Composantes d'automobile	5,3 %	5,6 %
Services de télécommunications sans fil	4,8 %	5,1 %
Hôtellerie, restauration et loisirs	4,8 %	5,0 %
Fournitures et services commerciaux	3,4 %	4,5 %
Produits alimentaires	2,6 %	2,1 %
Grands magasins	2,4 %	3,4 %
Médias	2,2 %	2,6 %
Sociétés commerciales et de distribution	2,0 %	4,7 %
Contenants et emballage	1,6 %	1,7 %
Institutions d'épargne et de financement hypothécaire	1,5 %	2,2 %
Logiciels	1,4 %	1,9 %
Construction et génie	0,7 %	4,1 %
Machinerie	0,2 %	1,5 %
Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants	–	2,9 %
Produits chimiques	–	2,0 %
Textiles, vêtements et articles de luxe	–	1,9 %
Transport aérien	–	1,8 %
Aérospatiale et défense	–	1,5 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	1,2 %	1,6 %
Autres actifs moins les passifs	0,0 %*	0,2 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI		
Chine	27,4 %	26,6 %
Taiwan	24,8 %	20,9 %
Corée du Sud	12,2 %	11,7 %
Russie	9,5 %	10,3 %
Inde	5,2 %	5,6 %
Brésil	3,2 %	4,7 %
Afrique du Sud	3,1 %	4,8 %
Malaisie	3,0 %	2,8 %
Thaïlande	2,8 %	2,8 %
Mexique	2,5 %	2,8 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
Indonésie	2,0 %	2,2 %
Chili	0,9 %	1,0 %
Turquie	0,8 %	1,0 %
Autres pays représentant moins de 1 % de l'actif net	2,0 %	2,6 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,2 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI		
France	31,3 %	28,5 %
Allemagne	30,2 %	26,2 %
Pays-Bas	13,4 %	12,1 %
Royaume-Uni	7,2 %	6,0 %
Belgique	5,7 %	6,8 %
Finlande	3,9 %	2,9 %
Espagne	2,5 %	12,0 %
Irlande	1,9 %	1,5 %
Italie	0,8 %	1,3 %
Autres pays représentant moins de 1 % de l'actif net	2,1 %	2,1 %
Autres actifs moins les passifs	1,0 %	0,6 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI		
Japon	23,1 %	19,3 %
Royaume-Uni	19,2 %	22,2 %
Suisse	8,3 %	7,0 %
Danemark	8,2 %	6,4 %
Allemagne	7,6 %	8,3 %
Pays-Bas	4,9 %	3,6 %
France	4,8 %	6,1 %
Espagne	4,7 %	6,3 %
Australie	3,8 %	3,7 %
Finlande	3,3 %	2,8 %
Chine	2,5 %	2,6 %
Norvège	2,3 %	3,1 %
Suède	1,8 %	3,0 %
Italie	1,1 %	1,6 %
Hong Kong	0,5 %	1,2 %
Autres pays représentant moins de 1 % de l'actif net	3,3 %	2,8 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,0 %*
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI		
Japon	23,2 %	19,3 %
Royaume-Uni	19,2 %	22,2 %
Suisse	8,3 %	7,0 %
Danemark	8,2 %	6,4 %
Allemagne	7,6 %	8,3 %
Pays-Bas	4,9 %	3,6 %
France	4,8 %	6,1 %
Espagne	4,7 %	6,3 %
Australie	3,8 %	3,7 %
Finlande	3,3 %	2,9 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
Chine	2,5 %	2,6 %
Norvège	2,3 %	3,0 %
Suède	1,9 %	3,0 %
Italie	1,1 %	1,6 %
Hong Kong	0,5 %	1,2 %
Autres pays représentant moins de 1 % de l'actif net	3,1 %	2,8 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,0 %*
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI		
Automobiles	10,4 %	12,1 %
Produits pharmaceutiques	9,7 %	8,1 %
Machinerie	9,2 %	9,0 %
Produits chimiques	7,7 %	7,3 %
Institutions financières	7,6 %	8,5 %
Sociétés commerciales et de distribution	6,2 %	6,5 %
Composantes d'automobile	5,4 %	5,7 %
Équipement, instruments et composants électroniques	4,7 %	5,0 %
Matériel et produits semi-conducteurs	4,7 %	3,7 %
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques	3,1 %	3,4 %
Tabac	3,0 %	3,0 %
Produits ménagers durables	2,9 %	2,6 %
Divertissement	2,6 %	1,8 %
Assurance	2,6 %	2,7 %
Matériel électrique	2,1 %	1,9 %
Produits de construction	1,8 %	1,6 %
Équipement et fournitures de soins de santé	1,4 %	1,2 %
Boissons	1,4 %	1,2 %
Produits d'hygiène et de beauté	1,1 %	1,0 %
Métaux et exploitation minière	1,0 %	2,4 %
Services de TI	1,0 %	0,8 %
Produits alimentaires	1,0 %	0,9 %
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base	1,0 %	0,9 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	7,9 %	8,2 %
Autres actifs moins les passifs	0,5 %	0,5 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI		
Titres participatifs de fiducies de placement immobilier (« FPI »)	15,5 %	14,7 %
Institutions financières	9,1 %	9,2 %
Assurance	5,9 %	5,2 %
Marchés financiers	5,0 %	3,6 %
Produits chimiques	4,8 %	3,6 %
Pétrole, gaz et autres combustibles	4,1 %	5,8 %
Produits alimentaires	3,8 %	2,6 %
Machinerie	3,7 %	3,0 %
Services publics d'électricité	3,6 %	2,9 %
Contenants et emballage	3,3 %	2,6 %
Services de TI	3,1 %	2,7 %
Services publics multiples	2,6 %	2,3 %
Services publics de gaz	2,6 %	2,1 %
Produits ménagers durables	2,4 %	1,9 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
Producteurs d'énergie et d'énergie renouvelable indépendants	1,9 %	1,5 %
Produits de construction	1,9 %	1,3 %
Crédit à la consommation	1,5 %	1,4 %
Médias	1,5 %	1,2 %
Institutions d'épargne et de financement hypothécaire	1,4 %	1,2 %
Hôtellerie, restauration et loisirs	1,3 %	3,7 %
Produits de loisirs	1,3 %	1,1 %
Fret aérien et logistique	1,2 %	0,8 %
Commerce de détail spécialisé	1,2 %	2,4 %
Équipement, instruments et composants électroniques	1,1 %	1,2 %
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques	1,1 %	1,1 %
Services financiers diversifiés	1,1 %	0,9 %
Sociétés commerciales et de distribution	1,0 %	0,7 %
Fournitures et services commerciaux	1,0 %	0,6 %
Matériel et produits semi-conducteurs	1,0 %	0,8 %
Textiles, vêtements et articles de luxe	0,5 %	1,7 %
Composantes d'automobile	0,6 %	1,0 %
Grands magasins	–	2,1 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	9,3 %	11,1 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	2,0 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI		
Logiciels	7,7 %	5,6 %
Matériel et produits semi-conducteurs	7,6 %	6,6 %
Produits pharmaceutiques	7,5 %	7,0 %
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques	5,9 %	4,2 %
Services de télécommunications diversifiés	5,3 %	5,3 %
Produits ménagers	4,7 %	4,2 %
Machinerie	4,3 %	4,3 %
Biotechnologie	4,2 %	3,4 %
Boissons	3,9 %	3,6 %
Services de TI	3,7 %	3,5 %
Conglomérats industriels	3,2 %	3,3 %
Fournisseurs et services de soins de santé	3,2 %	2,9 %
Marchés financiers	3,1 %	2,9 %
Tabac	2,9 %	3,2 %
Transport routier et ferroviaire	2,7 %	2,5 %
Aérospatiale et défense	2,5 %	3,5 %
Médias	2,4 %	2,6 %
Produits chimiques	2,4 %	2,3 %
Produits alimentaires	2,2 %	1,9 %
Fret aérien et logistique	2,1 %	1,9 %
Commerce de détail spécialisé	1,9 %	2,6 %
Pétrole, gaz et autres combustibles	1,5 %	2,1 %
Services publics d'électricité	1,4 %	1,3 %
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base	1,4 %	1,4 %
Assurance	1,3 %	1,3 %
Équipement et fournitures de soins de santé	1,1 %	1,0 %
Matériel électrique	1,1 %	1,1 %
Crédit à la consommation	1,0 %	1,3 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
Grands magasins	1,0 %	1,3 %
Automobiles	0,2 %	2,5 %
Hôtellerie, restauration et loisirs	0,1 %	1,9 %
Textiles, vêtements et articles de luxe	0,8 %	1,1 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	5,2 %	6,1 %
Autres actifs moins les passifs	0,5 %	0,3 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI		
Logiciels	7,7 %	5,6 %
Matériel et produits semi-conducteurs	7,6 %	6,6 %
Produits pharmaceutiques	7,6 %	7,0 %
Matériel informatique, matériel de stockage et périphériques	5,9 %	4,2 %
Services de télécommunications diversifiés	5,3 %	5,3 %
Produits ménagers	4,7 %	4,2 %
Machinerie	4,3 %	4,3 %
Biotechnologie	4,2 %	3,5 %
Boissons	3,9 %	3,6 %
Services de TI	3,7 %	3,4 %
Conglomérats industriels	3,2 %	3,3 %
Fournisseurs et services de soins de santé	3,2 %	2,9 %
Marchés financiers	3,1 %	2,9 %
Tabac	2,9 %	3,2 %
Transport routier et ferroviaire	2,7 %	2,5 %
Aérospatiale et défense	2,5 %	3,5 %
Médias	2,4 %	2,6 %
Produits chimiques	2,4 %	2,3 %
Produits alimentaires	2,2 %	2,0 %
Fret aérien et logistique	2,1 %	1,9 %
Commerce de détail spécialisé	1,9 %	2,6 %
Services publics d'électricité	1,4 %	1,3 %
Pétrole, gaz et autres combustibles	1,4 %	2,1 %
Vente au détail de produits alimentaires et de produits de base	1,4 %	1,4 %
Assurance	1,3 %	1,3 %
Matériel électrique	1,1 %	1,1 %
Équipement et fournitures de soins de santé	1,1 %	1,0 %
Crédit à la consommation	1,0 %	1,3 %
Grands magasins	1,0 %	1,2 %
Textiles, vêtements et articles de luxe	0,8 %	1,1 %
Automobiles	0,2 %	2,6 %
Hôtellerie, restauration et loisirs	0,1 %	1,9 %
Autres secteurs représentant moins de 1 % de l'actif net	5,1 %	6,0 %
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,3 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI		
Obligations provinciales	41,4 %	37,3 %
Obligations de sociétés	31,2 %	42,7 %
Obligations fédérales	22,2 %	13,7 %
Obligations municipales	2,9 %	2,4 %
Obligations de sociétés étrangères	1,3 %	2,7 %
Autres types de placement représentant moins de 1 % de l'actif net	0,4 %	0,5 %

Notes des états financiers (suite)

Fonds / Pays / Secteur	% de l'actif net	
	30 juin 2020	31 décembre 2019
Autres actifs moins les passifs	0,6 %	0,7 %
Total	100,0 %	100,0 %
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI		
Obligations de sociétés	33,9 %	56,6 %
Obligations fédérales	31,6 %	18,5 %
Obligations provinciales	26,5 %	16,6 %
Obligations de sociétés étrangères	4,2 %	5,4 %
Obligations supranationales	1,7 %	1,1 %
Obligations municipales	1,2 %	1,0 %
Autres types de placement représentant moins de 1 % de l'actif net	0,2 %	—
Autres actifs moins les passifs	0,7 %	0,8 %
Total	100,0 %	100,0 %

* Représente moins de 0,1 %.

Risque de crédit — Le risque de crédit s'entend du risque qu'une contrepartie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement qu'elle a conclu avec les Fonds. La juste valeur des titres à revenu fixe tient compte de la solvabilité de l'émetteur et, par conséquent, représente l'exposition maximale des Fonds au risque de crédit. Pour mieux gérer le risque de crédit des Fonds, le gestionnaire surveille attentivement la solvabilité et la solidité opérationnelle des contreparties qui effectuent des transactions au nom des Fonds. Toutes les nouvelles contreparties à des instruments financiers sont soumises à un processus d'approbation et doivent avoir une note de crédit approuvé d'au moins A.

Au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019, trois Fonds (CAGG, CAGS et ONEB) avaient des placements importants dans des titres à revenu fixe.

Risque de liquidité — Le risque de liquidité s'entend de la possibilité que les placements d'un Fonds ne puissent pas être facilement convertis en espèces lorsque nécessaire. Les Fonds conserveront vraisemblablement suffisamment de liquidités pour répondre aux dépenses et aux demandes de rachat de parts en investissant principalement dans des titres liquides. Toutefois, pour répondre à une demande inattendue et importante de rachats de parts, les Fonds pourraient devoir se départir de placements dans des conditions qui ne sont pas optimales. Pour gérer la liquidité globale des Fonds et leur permettre de respecter leurs obligations, les actifs des Fonds sont principalement investis dans des titres négociés sur des marchés actifs et qui peuvent, selon le gestionnaire des Fonds, être facilement cédés sur le marché en temps normal. De plus, les FNB WisdomTree conservent suffisamment de trésorerie et d'équivalents de trésorerie pour financer les rachats prévus et les activités régulières.

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 du marché — L'autre risque du marché est le risque que la juste valeur des flux de trésorerie futurs des instruments financiers fluctue en raison des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces fluctuations soient causées par des facteurs propres à un instrument financier en particulier ou à son émetteur, ou des facteurs ayant une incidence sur tous les instruments financiers négociés sur le marché ou sur un segment de marché. Les titres comportent un risque de perte de capital. Le gestionnaire atténue ce risque en employant des stratégies de placement visant à limiter l'écart de suivi des Fonds par rapport aux indices selon les paramètres de la stratégie de placement. Le risque maximum associé aux instruments financiers correspond à leur juste valeur. Les titres de capitaux propres et les titres de créance des Fonds sont sensibles à l'autre risque de marché qui découle des incertitudes entourant l'évolution du cours de ces instruments.

Le tableau ci-après présente l'estimation de la direction de l'incidence sur l'actif net d'une variation de 10 % des indices de référence des Fonds au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019, toute autre variable demeurant constante :

Fonds	Indice de référence	Incidence d'une augmentation/ diminution de 10 %	
		30 juin 2020	31 décembre 2019
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	Indice S&P China 500 Index CAD	281 702 \$	264 271 \$
FNB d'actions mondiales ONE CI	Indice composé S&P/TSX (30 %)/Indice S&P Global 1200 (70 %)	3 989 776	4 511 742

Notes des états financiers (suite)

Fonds	Indice de référence	Incidence d'une augmentation/ diminution de 10 %	
		30 juin 2020	31 décembre 2019
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	Indice des obligations universelles FTSE Canada	8 303 887 \$	8 962 688 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	Indice WisdomTree Canada Quality Dividend Growth Index	24 430 150	23 072 648
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	Indice WisdomTree Emerging Markets Dividend Index CAD	3 298 089	3 539 688
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	Indice WisdomTree Europe CAD-Hedged Equity Index	3 991 438	5 952 932
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Index CAD	5 761 755	5 762 102
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Indice WisdomTree International Quality Dividend Growth Index Variably CAD-Hedged	1 935 482	2 300 342
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	Indice WisdomTree Japan Equity Index CAD	1 747 107	1 699 188
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	Indice WisdomTree U.S. MidCap Dividend Index CAD	1 193 606	1 748 131
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Index CAD	5 641 733	11 632 064
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Indice WisdomTree U.S. Quality Dividend Growth Index Variably CAD-Hedged	4 452 671	3 844 996
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Indice Bloomberg Barclays Canadian Aggregate Enhanced Yield	15 331 475	16 097 867
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Indice Bloomberg Barclays Canadian Short Aggregate Enhanced Yield	8 953 304	10 225 352

Risque de change — Le risque de change découle des instruments financiers qui sont libellés en devises. Les Fonds sont exposés au risque que la valeur des titres libellés en devises fluctue en raison de la variation des taux de change. Lorsque la valeur du dollar canadien recule par rapport aux devises, la valeur des placements dans des titres étrangers augmente. Lorsque la valeur du dollar canadien augmente, la valeur des placements dans des titres étrangers diminue.

Au cours de la période considérée, certains Fonds détenaient des titres, principalement des instruments de capitaux propres, libellés en devises. D'autres actifs financiers (y compris les dividendes, les intérêts à recevoir et les montants à recevoir pour des placements vendus) et passifs financiers (y compris les montants à payer pour des placements achetés) qui sont libellés en devises ne constituent pas un risque de change important pour les Fonds.

Le tableau ci-dessous présente les devises auxquelles les Fonds étaient largement exposés au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019, déduction faite de l'incidence des contrats de change à terme, le cas échéant. Le tableau présente également l'incidence possible sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables d'une appréciation ou d'une dépréciation de 5 % du dollar canadien par rapport à chaque devise, toutes les autres variables demeurant constantes.

Nom du Fonds / devise	30 juin 2020			
	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/ diminution de 5 %
FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI				
Yuan chinois	8 725 605 \$	— \$	8 725 605 \$	436 280 \$
Dollar de Hong Kong	6 538 457	(76 689)	6 461 768	323 088
Dollar de Singapour	2 757	—	2 757	138
Dollar américain	810 284	(12 826)	797 458	39 873
Total	16 077 103 \$	(89 515)\$	15 987 588 \$	799 379 \$
FNB d'actions mondiales ONE CI				
Dollar américain	35 931 497 \$	(21 343 893)\$	14 587 604 \$	729 380 \$
Total	35 931 497 \$	(21 343 893)\$	14 587 604 \$	729 380 \$

Notes des états financiers (suite)

Nom du Fonds / devise	30 juin 2020			
	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/diminution de 5 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI				
Dollar américain	270 287 \$	– \$	270 287 \$	13 514 \$
Total	270 287 \$	– \$	270 287 \$	13 514 \$
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI				
Real brésilien	5 349 292 \$	– \$	5 349 292 \$	267 465 \$
Peso chilien	187 353 099	–	187 353 099	9 367 655
Yuan chinois	9 938 339	–	9 938 339	496 917
Couronne tchèque	389 091	–	389 091	19 455
Euro	102	–	102	5
Dollar de Hong Kong	51 953 848	–	51 953 848	2 597 692
Forint hongrois	13 196 269	–	13 196 269	659 813
Roupie indienne	94 933 560	–	94 933 560	4 746 678
Rupiah indonésienne	7 002 748 051	–	7 002 748 051	350 137 403
Ringgit malais	4 127 090	–	4 127 090	206 355
Peso mexicain	14 816 783	–	14 816 783	740 839
Nouveau dollar de Taiwan	187 626 723	–	187 626 723	9 381 336
Peso philippin	10 281 323	–	10 281 323	514 066
Zloty polonais	631 677	–	631 677	31 584
Rand sud-africain	14 156 141	–	14 156 141	707 807
Won sud-coréen	3 565 427 546	–	3 565 427 546	178 271 377
Baht thaïlandais	21 754 755	–	21 754 755	1 087 738
Nouvelle livre turque	1 693 955	–	1 693 955	84 698
Dollar américain	5 656 539	–	5 656 539	282 827
Total	11 192 034 183 \$	– \$	11 192 034 183 \$	559 601 710 \$
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI				
Euro	66 802 047 \$	(194 474)\$	66 607 573\$	3 330 379 \$
Dollar américain	720	–	720	36
Total	66 802 767 \$	(194 474)\$	66 608 293 \$	3 330 415 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI				
Dollar australien	4 549 302 \$	(45 437)\$	4 503 865 \$	225 193 \$
Livre sterling	14 405 923	19 288	14 425 211	721 261
Couronne danoise	28 178 246	(55 951)	28 122 295	1 406 115
Euro	30 079 245	(97 923)	29 981 322	1 499 066
Dollar de Hong Kong	15 256 849	(98 217)	15 158 632	757 932
Nouveau shekel israélien	451 268	(5)	451 263	22 563
Yen japonais	1 086 918 382	(4 570 749)	1 082 347 633	54 117 382
Dollar néo-zélandais	674 890	(4 380)	670 510	33 526
Couronne norvégienne	10 655 107	3 012	10 658 119	532 906
Dollar de Singapour	777 874	(9)	777 865	38 893
Couronne suédoise	8 310 157	587	8 310 744	415 537
Franc suisse	8 247 467	(43 360)	8 204 107	410 205
Dollar américain	1 344	–	1 344	67
Total	1 208 506 054 \$	(4 893 144)\$	1 203 612 910 \$	60 180 646 \$

Notes des états financiers (suite)

Nom du Fonds / devise	30 juin 2020			
	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/diminution de 5 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI				
Dollar australien	1 521 468 \$	(524 522)\$	996 946 \$	49 847 \$
Livre sterling	4 844 116	(2 431 784)	2 412 332	120 617
Couronne danoise	9 481 433	(4 784 296)	4 697 137	234 857
Euro	10 101 667	(5 088 907)	5 012 760	250 638
Dollar de Hong Kong	5 124 927	(916 540)	4 208 387	210 419
Nouveau shekel israélien	149 359	(78 281)	71 078	3 554
Yen japonais	365 391 141	(180 970 286)	184 420 855	9 221 043
Dollar néo-zélandais	226 353	(39 201)	187 152	9 358
Couronne norvégienne	3 596 510	(3 592 671)	3 839	192
Dollar de Singapour	257 824	(131 418)	126 406	6 320
Couronne suédoise	2 836 383	(1 418 988)	1 417 395	70 870
Franc suisse	2 777 271	(1 834 179)	943 092	47 155
Dollar américain	2 789	–	2 789	139
Total	406 311 241 \$	(201 811 073)\$	204 500 168 \$	10 225 009 \$
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI				
Yen japonais	1 409 190 718 \$	(3 961 213)\$	1 405 229 505 \$	70 261 475 \$
Total	1 409 190 718 \$	(3 961 213)\$	1 405 229 505 \$	70 261 475 \$
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI				
Dollar américain	20 724 026 \$	150 549 \$	20 874 575 \$	1 043 729 \$
Total	20 724 026 \$	150 549 \$	20 874 575 \$	1 043 729 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI				
Dollar américain	98 499 578 \$	(52 769)\$	98 446 809 \$	4 922 340 \$
Total	98 499 578 \$	(52 769)\$	98 446 809 \$	4 922 340 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI				
Dollar américain	77 427 369 \$	(12 419 247)\$	65 008 122 \$	3 250 406 \$
Total	77 427 369 \$	(12 419 247)\$	65 008 122 \$	3 250 406 \$
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI				
Dollar américain	5 947 \$	– \$	5 947 \$	297 \$
Total	5 947 \$	– \$	5 947 \$	297 \$
31 décembre 2019				
Nom du Fonds / devise	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/diminution de 5 %
FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI				
Yuan chinois	1 354 294 \$	– \$	1 354 294 \$	67 715 \$
Dollar de Hong Kong	917 755	–	917 755	45 888
Dollar de Singapour	1 692	–	1 692	85
Dollar américain	401 881	–	401 881	20 094
Total	2 675 622 \$	– \$	2 675 622 \$	133 782 \$
FNB d'actions mondiales ONE CI				
Dollar américain	22 304 116 \$	(10 836 759)\$	11 467 357 \$	573 368 \$
Total	22 304 116 \$	(10 836 759)\$	11 467 357 \$	573 368 \$

Notes des états financiers (suite)

Nom du Fonds / devise	31 décembre 2019			
	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/diminution de 5 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI				
Dollar américain	133 469 \$	- \$	133 469 \$	6 673 \$
Total	133 469 \$	- \$	133 469 \$	6 673 \$
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI				
Real brésilien	1 695 133 \$	(11 804)\$	1 683 329 \$	84 166 \$
Peso chilien	351 245	-	351 245	17 562
Yuan chinois	1 571 013	-	1 571 013	78 551
Couronne tchèque	116 651	(1 917)	114 734	5 737
Euro	59	-	59	3
Dollar de Hong Kong	8 074 375	(96 391)	7 977 984	398 899
Forint hongrois	96 879	(1 777)	95 102	4 755
Roupie indienne	1 927 865	-	1 927 865	96 393
Rupiah indonésienne	799 267	(7 585)	791 682	39 584
Ringgit malais	996 800	(5 477)	991 323	49 566
Peso mexicain	997 989	(5 852)	992 137	49 607
Nouveau dollar de Taiwan	7 472 611	(59 338)	7 413 273	370 664
Peso philippin	265 258	(243)	265 015	13 251
Zloty polonais	318 748	(1 807)	316 941	15 847
Rand sud-africain	1 755 793	(41 977)	1 713 816	85 691
Won sud-coréen	4 155 049	(45 929)	4 109 120	205 456
Baht thaïlandais	1 021 386	(23 343)	998 043	49 902
Nouvelle livre turque	358 093	(1 797)	356 296	17 815
Dollar américain	3 876 967	(55 618)	3 821 349	191 067
Total	35 851 181 \$	(360 855)\$	35 490 326 \$	1 774 516 \$
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI				
Euro	59 773 720 \$	(34 274 548)\$	25 499 172 \$	1 274 959 \$
Dollar américain	629	(629)	-	-
Total	59 774 349 \$	(34 275 177)\$	25 499 172 \$	1 274 959 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI				
Dollar australien	2 134 648 \$	(1 438 145)\$	696 503 \$	34 825 \$
Livre sterling	10 744 716	(6 949 840)	3 794 876	189 744
Couronne danoise	3 721 975	(2 413 495)	1 308 480	65 424
Euro	19 391 125	(12 584 139)	6 806 986	340 349
Dollar de Hong Kong	2 221 423	(1 448 668)	772 755	38 638
Nouveau shekel israélien	178 372	(113 767)	64 605	3 230
Yen japonais	11 160 187	(7 293 712)	3 866 475	193 324
Dollar néo-zélandais	233 796	(156 358)	77 438	3 872
Couronne norvégienne	1 757 662	(1 150 056)	607 606	30 380
Dollar de Singapour	438 812	(284 928)	153 884	7 694
Couronne suédoise	1 739 978	(1 146 271)	593 707	29 685
Franc suisse	4 092 148	(2 630 973)	1 461 175	73 059
Dollar américain	(60)	-	(60)	(3)
Total	57 814 782 \$	(37 610 352)\$	20 204 430 \$	1 010 221 \$

Notes des états financiers (suite)

Nom du Fonds / devise	31 décembre 2019			
	Instruments financiers et devise	Contrat de change	Exposition nette	Incidence d'une augmentation/diminution de 5 %
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI				
Dollar australien	853 733 \$	(872 424)\$	(18 691)\$	(935)\$
Livre sterling	4 287 886	(2 133 814)	2 154 072	107 704
Couronne danoise	1 483 678	(1 231 125)	252 553	12 628
Euro	7 741 570	(6 427 057)	1 314 513	65 726
Dollar de Hong Kong	885 872	(441 635)	444 237	22 212
Nouveau shekel israélien	70 939	(34 680)	36 259	1 813
Yen japonais	4 454 544	(3 729 001)	725 543	36 277
Dollar néo-zélandais	93 357	(48 092)	45 265	2 263
Couronne norvégienne	701 074	(476 712)	224 362	11 218
Dollar de Singapour	173 385	(87 192)	86 193	4 310
Couronne suédoise	701 007	(351 110)	349 897	17 495
Franc suisse	1 636 481	(1 076 226)	560 255	28 013
Dollar américain	(46)	—	(46)	(2)
Total	23 083 480 \$	(16 909 068)\$	6 174 412 \$	308 722 \$
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI				
Yen japonais	17 137 105 \$	(4 834 924)\$	12 302 181 \$	615 109 \$
Total	17 137 105 \$	(4 834 924)\$	12 302 181 \$	615 109 \$
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI				
Dollar américain	17 619 735 \$	(16 010 909)\$	1 608 826 \$	80 441 \$
Total	17 619 735 \$	(16 010 909)\$	1 608 826 \$	80 441 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI				
Dollar américain	116 388 213 \$	(31 541 061)\$	84 847 152 \$	4 242 358 \$
Total	116 388 213 \$	(31 541 061)\$	84 847 152 \$	4 242 358 \$
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI				
Dollar américain	38 204 049 \$	(18 937 834)\$	19 266 215 \$	963 311 \$
Total	38 204 049 \$	(18 937 834)\$	19 266 215 \$	963 311 \$
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI				
Dollar américain	3 265 \$	— \$	3 265 \$	163 \$
Total	3 265 \$	— \$	3 265 \$	163 \$

Risque de taux d'intérêt — Le risque de taux d'intérêt est le risque que la valeur de marché des instruments financiers portant intérêt des Fonds varie par suite de la fluctuation des taux d'intérêt du marché. La valeur de marché des instruments financiers augmentera si les taux d'intérêt diminuent et vice-versa. Puisqu'ils sont à court terme par nature, la trésorerie investie dans des placements avec un taux du marché à court terme n'est pas très sensible aux fluctuations des taux d'intérêt. Si les taux d'intérêt du marché avaient augmenté ou diminué, en supposant que la courbe de rendement aurait subi une variation semblable et que tous les autres facteurs demeurent constants, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables aurait pu augmenter ou diminuer. Le tableau ci-après présente l'exposition au risque de taux d'intérêt au 30 juin 2020 et au 31 décembre 2019 auquel les Fonds qui détiennent des actifs et des passifs importants portant intérêt sont exposés. La sensibilité de chaque Fonds à une variation à la hausse ou à la baisse de 1 % du taux d'intérêt a été déterminée selon la durée moyenne pondérée du portefeuille.

Notes des états financiers (suite)

Au 30 juin 2020 :

	Moins d'un an	1 an à 3 ans	3 ans à 5 ans	Plus de cinq ans	Total	Incidence d'une augmentation/ diminution de 1 %
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	2 564 358 \$	11 756 016 \$	4 018 552 \$	5 167 270 \$	23 506 196 \$	916 742 \$
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	10 136	21 713 533	23 447 493	108 143 587	153 314 749	12 418 495
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	70 398	38 187 818	45 961 236	5 313 584	89 533 036	2 506 925

Au 31 décembre 2019

	Moins d'un an	1 an à 3 ans	3 ans à 5 ans	Plus de cinq ans	Total	Incidence d'une augmentation/ diminution de 1 %
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	922 879 \$	6 760 613 \$	6 408 156 \$	4 198 896 \$	18 290 544 \$	632 853 \$
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	129 747	17 766 911	15 580 804	127 501 212	160 978 674	14 391 493
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	9 133	27 667 521	64 599 238	9 977 631	102 253 523	3 077 831

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 peut comprendre 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 billets structurés de titres indexés, les contrats de change à terme et les certificats américains d'actions étrangères et les certificats mondiaux d'actions étrangères.

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 la juste valeur.

Certains Fonds investissent dans d'autres fonds de placement et ces placements sont généralement classés au niveau 1.

Les tableaux suivants présentent le classement des instruments financiers comptabilisés à la juste valeur dans les états de la situation financière dans l'une des trois catégories de la hiérarchie de la juste valeur.

Notes des états financiers (suite)

Au 30 juin 2020 :

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	2 817 019 \$	– \$	– \$	2 817 019 \$
Total	2 817 019 \$	– \$	– \$	2 817 019 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	29	–	29
Moins-value latente des contrats de change	–	(26)	–	(26)
Total, montant net	2 817 019 \$	3 \$	– \$	2 817 022 \$

FNB d'actions mondiales ONE CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	20 628 965 \$	– \$	– \$	20 628 965 \$
Fonds négociés en Bourse	19 268 794	–	–	19 268 794
Total	39 897 759 \$	– \$	– \$	39 897 759 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	9 544	–	9 544
Total, montant net	39 897 759 \$	9 544 \$	– \$	39 907 303 \$

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	22 473 648 \$	– \$	22 473 648 \$
Obligations provinciales	–	819 938	–	819 938
Obligations municipales	–	212 610	–	212 610
Obligations de sociétés étrangères	–	1 226 557	–	1 226 557
Fonds négociés en Bourse	58 306 116	–	–	58 306 116
Total	58 306 116 \$	24 732 753 \$	– \$	83 038 869 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	244 301 496 \$	– \$	– \$	244 301 496 \$
Total	244 301 496 \$	– \$	– \$	244 301 496 \$

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	32 980 661 \$	– \$	– \$	32 980 661 \$
Droits	–	–	–	–
Bons de souscription	226	–	–	226
Total	32 980 887 \$	– \$	– \$	32 980 887 \$

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	39 899 048 \$	– \$	– \$	39 899 048 \$
Droits	15 327	–	–	15 327
Total	39 914 375 \$	– \$	– \$	39 914 375 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	111 872	–	111 872
Moins-value latente des contrats de change	–	(976)	–	(976)
Total, montant net	39 914 375 \$	110 896 \$	– \$	40 025 271 \$

Notes des états financiers (suite)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	57 617 547 \$	– \$	– \$	57 617 547 \$
Total	57 617 547 \$	– \$	– \$	57 617 547 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	201 713	–	201 713
Moins-value latente des contrats de change	–	(37 009)	–	(37 009)
Total, montant net	57 617 547 \$	164 703 \$	– \$	57 782 250 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	19 354 823 \$	– \$	– \$	19 354 823 \$
Total	19 354 823 \$	– \$	– \$	19 354 823 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	60 381	–	60 381
Moins-value latente des contrats de change	–	(13 928)	–	(13 928)
Total, montant net	19 354 823 \$	46 453 \$	– \$	19 401 276 \$

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	17 471 068 \$	– \$	– \$	17 471 068 \$
Total	17 471 068 \$	– \$	– \$	17 471 068 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	69 391	–	69 391
Moins-value latente des contrats de change	–	(283)	–	(283)
Total, montant net	17 471 068 \$	69 108 \$	– \$	17 540 176 \$

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	11 936 064 \$	– \$	– \$	11 936 064 \$
Total	11 936 064 \$	– \$	– \$	11 936 064 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	151 235	–	151 235
Moins-value latente des contrats de change	–	(765)	–	(765)
Total, montant net	11 936 064 \$	150 470 \$	– \$	12 086 534 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	56 417 331 \$	– \$	– \$	56 417 331 \$
Total	56 417 331 \$	– \$	– \$	56 417 331 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	317 460	–	317 460
Moins-value latente des contrats de change	–	(1 283)	–	(1 283)
Total, montant net	56 417 331 \$	316 177 \$	– \$	56 733 508 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	44 526 705 \$	– \$	– \$	44 526 705 \$
Total	44 526 705 \$	– \$	– \$	44 526 705 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	298 418	–	298 418
Moins-value latente des contrats de change	–	(3 648)	–	(3 648)
Total, montant net	44 526 705 \$	294 770 \$	– \$	44 821 475 \$

Notes des états financiers (suite)

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	48 106 465 \$	– \$	48 106 465 \$
Obligations fédérales	–	34 313 804	–	34 313 804
Obligations provinciales	–	63 803 945	–	63 803 945
Obligations municipales	–	4 409 497	–	4 409 497
Obligations de sociétés étrangères	–	2 034 715	–	2 034 715
Obligations supranationales	–	619 657	–	619 657
Organismes de gouvernements étrangers	–	26 666	–	26 666
Total	– \$	153 314 749 \$	– \$	153 314 749 \$

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	30 548 928 \$	– \$	30 548 928 \$
Obligations fédérales	–	28 495 581	–	28 495 581
Obligations provinciales	–	23 914 892	–	23 914 892
Obligations municipales	–	1 078 073	–	1 078 073
Obligations de sociétés étrangères	–	3 743 955	–	3 743 955
Obligations supranationales	–	1 541 766	–	1 541 766
Organismes de gouvernements étrangers	–	209 841	–	209 841
Total	– \$	89 533 036 \$	– \$	89 533 036 \$

Au 31 décembre 2019

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	2 640 800 \$	1 907 \$	– \$	2 642 707 \$
Total	2 640 800 \$	1 907 \$	– \$	2 642 707 \$

FNB d'actions mondiales ONE CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	22 304 536 \$	– \$	– \$	22 304 536 \$
Fonds négociés en Bourse	22 812 880	–	–	22 812 880
Total	45 117 416 \$	– \$	– \$	45 117 416 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	163 241	–	163 241
Total, montant net	45 117 416 \$	163 241 \$	– \$	45 280 657 \$

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	17 300 657 \$	– \$	17 300 657 \$
Obligations provinciales	–	810 128	–	810 128
Obligations de sociétés étrangères	–	179 759	–	179 759
Fonds négociés en Bourse	71 336 335	–	–	71 336 335
Total	71 336 335 \$	18 290 544 \$	– \$	89 626 879 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	230 726 484 \$	– \$	– \$	230 726 484 \$
Total	230 726 484 \$	– \$	– \$	230 726 484 \$

Notes des états financiers (suite)

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	35 386 721 \$	9 799 \$	– \$	35 396 520 \$
Droits	–	357	–	357
Bons de souscription	–	–	–	–
Total	35 386 721 \$	10 156 \$	– \$	35 396 877 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	1 823	–	1 823
Moins-value latente des contrats de change	–	(11)	–	(11)
Total, montant net	35 386 721 \$	11 968 \$	– \$	35 398 689 \$

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	59 529 315 \$	– \$	– \$	59 529 315 \$
Total	59 529 315 \$	– \$	– \$	59 529 315 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	323 636	–	323 636
Moins-value latente des contrats de change	–	(51 365)	–	(51 365)
Total, montant net	59 529 315 \$	272 271 \$	– \$	59 801 586 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	57 619 940 \$	– \$	– \$	57 619 940 \$
Droits	–	1 077	–	1 077
Total	57 619 940 \$	1 077 \$	– \$	57 621 017 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	300 656	–	300 656
Moins-value latente des contrats de change	–	(66 232)	–	(66 232)
Total, montant net	57 619 940 \$	235 501 \$	– \$	57 855 441 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	23 002 991 \$	– \$	– \$	23 002 991 \$
Droits	–	428	–	428
Total	23 002 991 \$	428 \$	– \$	23 003 419 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	118 178	–	118 178
Moins-value latente des contrats de change	–	(37 177)	–	(37 177)
Total, montant net	23 002 991 \$	81 429 \$	– \$	23 084 420 \$

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	16 991 876 \$	– \$	– \$	16 991 876 \$
Total	16 991 876 \$	– \$	– \$	16 991 876 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	90 268	–	90 268
Moins-value latente des contrats de change	–	(667)	–	(667)
Total, montant net	16 991 876 \$	89 601 \$	– \$	17 081 477 \$

FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	17 481 306 \$	– \$	– \$	17 481 306 \$
Total	17 481 306 \$	– \$	– \$	17 481 306 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	363 248	–	363 248
Moins-value latente des contrats de change	–	(7 157)	–	(7 157)
Total, montant net	17 481 306 \$	356 091 \$	– \$	17 837 397 \$

Notes des états financiers (suite)

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	116 320 637 \$	– \$	– \$	116 320 637 \$
Total	116 320 637 \$	– \$	– \$	116 320 637 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	712 654	–	712 654
Moins-value latente des contrats de change	–	(12 836)	–	(12 836)
Total, montant net	116 320 637 \$	699 818 \$	– \$	117 020 455 \$

FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Actions ordinaires	38 449 960 \$	– \$	– \$	38 449 960 \$
Total	38 449 960 \$	– \$	– \$	38 449 960 \$
Plus-value latente des contrats de change	–	441 397	–	441 397
Moins-value latente des contrats de change	–	(18 951)	–	(18 951)
Total, montant net	38 449 960 \$	422 446 \$	– \$	38 872 406 \$

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	69 131 073 \$	– \$	69 131 073 \$
Obligations fédérales	–	22 180 030	–	22 180 030
Obligations provinciales	–	60 515 148	–	60 515 148
Obligations municipales	–	3 890 546	–	3 890 546
Obligations de sociétés étrangères	–	4 383 983	–	4 383 983
Obligations supranationales	–	850 803	–	850 803
Organismes de gouvernements étrangers	–	27 091	–	27 091
Total	– \$	160 978 674 \$	– \$	160 978 674 \$

FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Obligations de sociétés	– \$	58 366 482 \$	– \$	58 366 482 \$
Obligations fédérales	–	19 040 316	–	19 040 316
Obligations provinciales	–	17 087 104	–	17 087 104
Obligations municipales	–	1 034 003	–	1 034 003
Obligations de sociétés étrangères	–	5 551 269	–	5 551 269
Obligations supranationales	–	1 174 349	–	1 174 349
Total	– \$	102 253 523 \$	– \$	102 253 523 \$

Il n'y avait aucun titre classé au niveau 3 au 30 juin 2020 et pour la période close à cette date.

Pour déterminer à quel moment les transferts entre les niveaux de la hiérarchie de juste valeur ont lieu, les Fonds ont décidé d'appliquer la méthode de la date du début de la période.

Aucun transfert important entre les niveaux de la hiérarchie de juste valeur n'a été effectué au cours de la période close le 30 juin 2020 et de l'exercice clos le 31 décembre 2019.

(Cette page est laissée en blanc intentionnellement)

(Cette page est laissée en blanc intentionnellement)

(Cette page est laissée en blanc intentionnellement)



Pour plus de renseignements, communiquez avec nous.

CI Investments Inc.
2 rue Queen Est, 20^e étage
Toronto, ON, M5C 3G7
1-877-642-1289
www.firstasset.com

WisdomTree Investment, Inc. a accordé sous licence au gestionnaire le droit d'utiliser et de faire mention de certains indices WisdomTree (les « **indices WisdomTree** ») et de certaines marques WisdomTree dans les FNB à l'exception du FNB indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI, du FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI et du FNB Indice S&P China 500 ICBCS CI (les « **FNB sous licence WisdomTree** »).

« WisdomTree[®] » est une marque déposée de WisdomTree Investments, Inc. et WisdomTree Investments, Inc. a déposé des demandes de brevet concernant la méthodologie et le fonctionnement de ses indices. Les FNB sous licence WisdomTree ne sont pas parrainés, garantis, vendus ou promus par WisdomTree Investments, Inc., ou les membres de son groupe (« **WisdomTree** »). WisdomTree n'offre aucune déclaration ou garantie, explicite ou implicite, concernant l'opportunité, la légalité (y compris l'exactitude ou le caractère adéquat des descriptions et des notices relatives aux FNB sous licence WisdomTree) ou la pertinence d'investir dans des titres ou d'autres instruments ou produits financiers, en général, ou des FNB sous licence WisdomTree en particulier, ou d'en acheter, ou encore relativement à l'utilisation des indices WisdomTree ou à toute autre donnée connexe. WisdomTree n'a accordé sous licence au gestionnaire que certains droits d'utilisation des indices WisdomTree, qui sont établis, constitués et calculés par WisdomTree et/ou d'autres tiers sans égard au gestionnaire, aux FNB sous licence WisdomTree ou aux investisseurs des FNB sous licence WisdomTree, et ni les FNB sous licence WisdomTree ni aucun investisseur n'entretiennent une relation de quelque nature que ce soit avec WisdomTree en lien avec les FNB sous licence WisdomTree. WISDOMTREE N'ASSUME AUCUNE RESPONSABILITÉ DE QUELQUE MANIÈRE QUE CE SOIT À L'ÉGARD DES FNB SOUS LICENCE WISDOMTREE, Y COMPRIS, SANS LIMITATION, POUR L'ÉMISSION, L'EXPLOITATION, L'ADMINISTRATION, LA GESTION, LA PERFORMANCE, LA COMMERCIALISATION OU LA DISTRIBUTION DES FNB SOUS LICENCE WISDOMTREE OU DE L'INCAPACITÉ DES FNB SOUS LICENCE WISDOMTREE D'ATTEINDRE LEURS OBJECTIFS DE PLACEMENT. WISDOMTREE NE PEUT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE L'EXACTITUDE, DE LA QUALITÉ, DE L'EXHAUSTIVITÉ, DE LA FIABILITÉ, DE LA SÉQUENCE, DE L'ACTUALITÉ OU AUTREMENT DES INDICES WISDOMTREE OU DE TOUTE AUTRE DONNÉE CONNEXE. SANS QUE SOIT LIMITÉE LA PORTÉE DE CE QUI PRÉCÈDE, WISDOMTREE NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE DOMMAGES-INTÉRÊTS SPÉCIAUX, PUNITIFS, INDIRECTS, ACCESSOIRES OU CONSÉCUTIFS, OU D'UN MANQUE À GAGNER, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ QUE DE TELS DOMMAGES-INTÉRÊTS SOIENT SUBIS.