



GESTION
MONDIALE D'ACTIFS

ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS 2021

30 JUIN 2021

Table des matières

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI.....	1
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	23
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI.....	38
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI.....	55
FNB d'actions mondiales ONE CI	65
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	76
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI.....	92
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	108
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI.....	117
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI.....	129
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	151
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI.....	167
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	183
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	201
Notes des états financiers	217
Avis juridique	226

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

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

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	100 829	143 058
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	32	403
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	1	1
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	502	731
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	2 876
	101 364	147 069
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	3 223
Frais de gestion à payer	15	19
Comptes créditeurs et charges à payer	9	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	24	3 242
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	101 340	143 827

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au	au	au	au	au	au
	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020
Parts non couvertes	101 340	143 827	50,34	53,01	2 013 163	2 713 163

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	1 616	2 438
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 154	1 573
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(7 871)	6 068
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(5 101)	10 079
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	-
Rabais sur frais	3	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	5	-
Total des revenus	(5 096)	10 079
Charges		
Frais de gestion (note 5)	104	154
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	16	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	4
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	1
Taxe de vente harmonisée	11	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	132	159
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(4)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 228)	9 924

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts non couvertes	(5 228)	9 924	(2,28)	3,24	2 296 588	3 059 317

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	143 827	162 079
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 228)	9 924
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(832)	(2 267)
Profits nets réalisés	(567)	-
Remboursement de capital	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 400)	(2 267)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	26 162	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(62 021)	(15 543)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(35 859)	(15 543)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(42 487)	(7 886)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	101 340	154 193

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(5 228)	9 924
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 154)	(1 573)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	16	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	7 871	(6 068)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	13 251	25 397
Achat de placements et de dérivés	(11 965)	(25 871)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	207
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	229	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(4)	(8)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	8	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	3 024	2 008
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(4 623)	(2 245)
Produit de l'émission de parts rachetables	7 728	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(6 500)	(112)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(3 395)	(2 357)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(371)	(349)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	403	1 341
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	32	992
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	(1)
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 846	2 645
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
	66 000	407 International Inc., 2,59 %, 25 mai 2032	70 396	67 173	
	143 000	407 International Inc., 2,84 %, 7 mars 2050	144 871	134 315	
	31 000	407 International Inc., 3,3 %, 27 mars 2045	30 642	31 703	
	51 000	407 International Inc., 3,43 %, 1 ^{er} juin 2033	57 390	55 299	
	60 000	407 International Inc., 3,60 %, 21 mai 2047	62 112	64 552	
	89 000	407 International Inc., 3,65 %, 8 septembre 2044	98 575	95 991	
	92 000	407 International Inc., 3,67 %, 8 mars 2049	102 624	100 439	
	92 000	407 International Inc., 3,72 %, 11 mai 2048	101 549	101 097	
	100 000	407 International Inc., 3,83 %, 11 mai 2046	112 034	111 182	
	82 000	407 International Inc., 3,98 %, 11 septembre 2052	94 121	94 183	
	82 000	407 International Inc., 4,19 %, 25 avril 2042	95 706	94 753	
	64 000	407 International Inc., 4,45 %, 15 novembre 2041	74 356	76 341	
	45 000	407 International Inc., 4,68 %, 7 octobre 2053	53 272	57 981	
	62 000	407 International Inc., 5,96 %, 3 décembre 2035	82 120	83 529	
	67 000	407 International Inc., série 06D1, 5,75 %, 14 février 2036	82 743	85 276	
	30 000	407 International Inc., taux échelonné	49 393	45 827	
	200 000	55 School Board Trust, série A, 5,9 %, 2 juin 2033	271 203	269 772	
	73 000	Aéroports de Montréal, 3,44 %, 26 avril 2051	73 433	77 747	
	50 000	Aéroports de Montréal, 5,17 %, 17 septembre 2035	62 091	63 106	
	45 000	Aéroports de Montréal, 6,55 %, 11 octobre 2033	63 498	62 116	
	113 413	Aéroports de Montréal, 6,95 %, 16 avril 2032	149 771	144 124	
	55 000	Aéroports de Montréal, série H, 5,67 %, 16 octobre 2037	71 793	73 923	
	31 000	Aéroports de Montréal, série I, 5,47 %, 16 avril 2040	40 513	41 472	
	89 000	Aéroports de Montréal, série R, 3,03 %, 21 avril 2050	91 349	87 793	
	100 802	Alberta PowerLine L.P., 4,07 %, 1 ^{er} décembre 2053	115 850	112 483	
	129 578	Alberta PowerLine L.P., 4,07 %, 1 ^{er} mars 2054	135 939	144 507	
	37 000	Alectra Inc., série A, 3,96 %, 30 juillet 2042	42 118	42 295	
	39 000	Alectra Inc., série B, 5,3 %, 29 avril 2041	48 952	52 089	
	56 000	Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juillet 2031	56 228	56 955	
	38 000	Algonquin Power Co., 4,09 %, 17 février 2027	38 964	42 077	
	45 000	Algonquin Power Co., 4,6 %, 29 janvier 2029	46 553	52 120	
	38 000	Allied Properties REIT, série D, 3,39 %, 15 août 2029	38 070	39 529	
	38 000	Allied Properties REIT, série E, 3,11 %, 8 avril 2027	40 560	39 600	
	57 000	Allied Properties REIT, série F, 3,12 %, 21 février 2030	57 883	57 692	
	42 000	Fonds de placement immobilier Allied, série G, 3,13 %, 15 mai 2028	42 950	43 418	
	62 000	AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	60 292	60 697	
	28 000	AltaGas Ltd., 2,17 %, 16 mars 2027	27 910	27 973	
	25 000	AltaGas Ltd., 2,48 %, 30 novembre 2030	25 377	24 210	
	25 000	AltaGas Ltd., 3,98 %, 4 octobre 2027	27 390	27 360	
	45 000	AltaGas Ltd., 4,5 %, 15 août 2044	51 296	48 186	
	40 000	AltaGas Ltd., 4,99 %, 4 octobre 2047	49 193	46 095	
	82 000	AltaLink L.P., 3,72 %, 3 décembre 2046	87 234	91 054	
	96 000	AltaLink L.P., 3,99 %, 30 juin 2042	114 027	109 473	
	72 000	AltaLink L.P., 4,09 %, 30 juin 2045	86 395	84 083	
	46 000	AltaLink L.P., 4,45 %, 11 juillet 2053	58 336	57 750	
	50 000	AltaLink L.P., 4,46 %, 8 novembre 2041	59 062	60 471	
	29 000	AltaLink L.P., 4,87 %, 15 novembre 2040	37 520	36 547	
	64 000	AltaLink L.P., 4,92 %, 17 septembre 2043	79 825	82 906	
	30 000	AltaLink L.P., 5,25 %, 22 septembre 2036	37 212	38 486	
	54 000	AltaLink L.P., série 2014-3, 4,05 %, 21 novembre 2044	57 331	62 597	
	84 000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc., 4,32 %, 15 mai 2047	92 441	89 807	
	77 000	ARC Resources Ltd., subalternes, 3,47 %, 10 mars 2031	76 808	78 698	
	105 000	AT&T Inc., 4,85 %, 25 mai 2047	109 804	116 200	
	104 000	AT&T Inc., 5,1 %, 25 novembre 2048	112 711	119 635	
	25 000	ATCO Ltd., série 18-1, 5,5 %, 1 ^{er} novembre 2078	24 893	27 671	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
63 000	Aviva PLC, 4 %, 2 octobre 2030	65 129	67 362	
94 000	Bell Canada, 1,65 %, 16 août 2027	94 462	91 474	
61 000	Bell Canada, 2,2 %, 29 mai 2028	60 965	61 033	
125 000	Bell Canada, 2,5 %, 14 mai 2030	130 293	123 866	
81 000	Bell Canada, 2,9 %, 12 août 2026	82 682	84 829	
69 000	Bell Canada, 2,9 %, 10 septembre 2029	70 064	71 154	
140 000	Bell Canada, 3 %, 17 mars 2031	141 134	143 120	
199 000	Bell Canada, 3,5 %, 30 septembre 2050	198 987	187 250	
100 000	Bell Canada, 3,6 %, 29 septembre 2027	108 650	108 185	
125 000	Bell Canada, 3,8 %, 21 août 2028	125 972	137 149	
85 000	Bell Canada, 4,05 %, 17 mars 2051	86 697	88 217	
75 000	Bell Canada, 4,35 %, 18 décembre 2045	89 013	81 048	
75 000	Bell Canada, 4,45 %, 27 février 2047	86 609	82 385	
140 000	Bell Canada, 4,75 %, 29 septembre 2044	163 948	159 448	
42 000	Bell Canada, 6,17 %, 26 février 2037	53 807	55 067	
50 000	Bell Canada, 7,3 %, 23 février 2032	67 019	67 652	
36 000	Bell Canada, 7,85 %, 2 avril 2031	50 470	50 114	
38 000	Bell Canada, série 2, 7,65 %, 30 décembre 2031	49 933	52 040	
50 000	Bell Canada, série M-17, 6,1 %, 16 mars 2035	61 621	64 142	
36 000	Bridging North America G.P., série B, 4,34 %, 31 août 2053	42 170	38 246	
37 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 08-01, 5,58 %, 11 janvier 2038	50 805	50 090	
48 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 13-1, 4,7 %, 23 octobre 2043	57 343	61 100	
46 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 14-1, 4,29 %, 28 avril 2044	57 455	55 737	
57 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 19-1, 2,79 %, 15 octobre 2049	57 582	54 828	
58 000	British Columbia Ferry Services Inc., série 2007-1, 5,02 %, 20 mars 2037	74 740	73 668	
78 000	Brookfield Asset Management Inc., 5,95 %, 14 juin 2035	92 835	99 181	
60 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 2,86 %, 1 ^{er} septembre 2032	61 187	59 085	
88 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,41 %, 9 octobre 2029	89 969	92 797	
88 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 4,19 %, 11 septembre 2028	86 265	97 779	
50 000	Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 15 janvier 2027	51 385	51 426	
64 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,33 %, 13 août 2050	64 976	61 636	
63 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,63 %, 15 janvier 2027	62 983	68 428	
57 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 4,25 %, 15 janvier 2029	57 031	64 887	
50 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 4,29 %, 5 novembre 2049	53 274	56 659	
68 000	Brookfield Renewable Partners ULC, série 12, 3,38 %, 15 janvier 2030	68 809	73 258	
74 000	Bruce Power L.P., 3,97 %, 23 juin 2026	76 663	81 064	
59 000	Bruce Power L.P., série 17-2, 4,01 %, 21 juin 2029	61 491	65 647	
68 000	Bruce Power L.P., série 18-1, 4,13 %, 21 juin 2033	70 394	76 103	
66 000	Bruce Power L.P., série 20-1, 4 %, 21 juin 2030	76 325	73 317	
78 000	Bruce Power L.P., série 2019, 4,75 %, 21 juin 2049	98 583	94 290	
50 000	Corporation Cameco, série H, 2,95 %, 21 octobre 2027	49 647	51 145	
35 000	Fiducie de capital Canada-Vie, série B, 7,53 %, 30 juin 2032	50 749	50 906	
82 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,05 %, 8 février 2050	87 575	76 244	
96 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 1 ^{er} août 2047	98 123	98 492	
82 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 31 juillet 2048	88 653	84 245	
82 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,6 %, 8 février 2049	87 092	84 323	
73 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,95 %, 22 septembre 2045	84 397	79 034	
38 000	Canadian Natural Resources Ltd., 2,5 %, 17 janvier 2028	38 579	38 469	
75 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,42 %, 1 ^{er} décembre 2026	74 751	79 959	
46 000	Canadian Natural Resources Ltd., 4,85 %, 30 mai 2047	54 755	52 150	
36 000	Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique, 3,05 %, 9 mars 2050	38 354	34 098	
50 000	Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique, 3,15 %, 13 mars 2029	50 666	53 608	
57 000	Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique, 6,45 %, 17 novembre 2039	88 264	81 861	
25 000	La Société Canadian Tire Limitée, 5,61 %, 4 septembre 2035	29 413	28 711	
21 000	La Société Canadian Tire Limitée, 6,38 %, 13 avril 2028	25 144	25 914	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
122 945	Capital City Link G.P., série A, 4,39 %, 31 mars 2046	131 053	137 994	
43 000	Capital Power Corp., 3,15 %, 1 ^{er} octobre 2032	42 758	42 387	
39 000	Capital Power Corp., 4,42 %, 8 février 2030	43 236	43 635	
38 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	38 017	41 327	
157 000	Cenovus Energy Inc., 3,5 %, 7 février 2028	157 626	164 663	
110 000	Cenovus Energy Inc., 3,6 %, 10 mars 2027	111 182	116 196	
94 000	FPI Propriétés de Choix, série L, 4,18 %, 8 mars 2028	99 206	104 145	
93 000	FPI Propriétés de Choix, série M, 3,53 %, 11 juin 2029	95 547	99 319	
57 000	FPI Propriétés de Choix, série N, 2,98 %, 4 mars 2030	60 818	58 216	
62 000	FPI Propriétés de Choix, série P, 2,85 %, 21 mai 2027	65 282	64 253	
37 000	CI Financial Corp., 3,9 %, 27 septembre 2027	38 434	39 578	
37 000	Fiducie de capital CIBC, 10,25 %, 30 juin 2039	45 237	39 431	
83 655	Comber Wind L.P., 5,13 %, 15 novembre 2030	91 176	94 532	
70 000	Université Concordia, 6,55 %, 2 septembre 2042	106 575	108 933	
144 000	CPPIB Capital Inc., 3 %, 15 juin 2028	143 961	157 836	
36 000	FPI Crombie, série F, 3,68 %, 26 août 2026	38 491	38 456	
20 000	FPI Crombie, série G, 3,92 %, 21 juin 2027	21 740	21 636	
28 000	FPI Crombie, série H, 2,69 %, 31 mars 2028	28 147	28 197	
28 000	FPI Crombie, série I, subalternes, 3,21 %, 9 octobre 2030	28 147	28 293	
30 085	CSS FSCC Partnership, 6,92 %, 31 juillet 2042	39 374	40 837	
25 000	FPI CT, série D, 3,29 %, 1 ^{er} juin 2026	26 600	26 427	
25 000	FPI CT, série E, 3,47 %, 16 juin 2027	23 325	26 698	
25 000	FPI CT, série F, 3,87 %, 7 décembre 2027	24 256	27 237	
26 000	CT REIT, série G, 2,37 %, 6 janvier 2031	26 089	25 006	
101 000	CU Inc., 2,96 %, 7 septembre 2049	100 456	97 331	
70 000	CU Inc., 3,55 %, 22 novembre 2047	74 952	74 672	
77 000	CU Inc., 3,76 %, 19 novembre 2046	82 674	84 849	
92 000	CU Inc., 3,81 %, 10 septembre 2042	103 009	101 218	
72 000	CU Inc., 3,83 %, 11 septembre 2062	79 150	81 161	
71 000	CU Inc., 3,95 %, 23 novembre 2048	82 559	80 993	
82 000	CU Inc., 3,96 %, 27 juillet 2045	92 676	92 678	
183 000	CU Inc., 4,09 %, 2 septembre 2044	208 800	210 136	
100 000	CU Inc., 4,21 %, 29 octobre 2055	119 654	120 597	
92 000	CU Inc., 4,54 %, 24 octobre 2041	110 169	111 120	
41 000	CU Inc., 4,56 %, 7 novembre 2053	49 118	51 965	
41 000	CU Inc., 4,59 %, 24 octobre 2061	48 691	53 223	
107 000	CU Inc., 4,72 %, 9 septembre 2043	137 205	132 939	
39 000	CU Inc., 5,03 %, 20 novembre 2036	47 617	49 086	
33 000	CU Inc., 5,18 %, 21 novembre 2035	43 453	41 851	
39 000	CU Inc., 5,56 %, 30 octobre 2037	52 115	51 801	
37 000	CU Inc., 5,9 %, 20 novembre 2034	49 658	49 308	
37 000	Dollarama Inc., 1,51 %, 20 septembre 2027	35 950	35 880	
50 000	Enbridge Gas Distribution Inc., 4 %, 22 août 2044	55 786	56 627	
55 000	Enbridge Gas Distribution Inc., 4,95 %, 22 novembre 2050	69 385	73 450	
53 000	Enbridge Gas Distribution Inc., 5,21 %, 25 février 2036	65 787	66 356	
27 000	Enbridge Gas Distribution Inc., 6,16 %, 16 décembre 2033	34 392	36 234	
61 000	Enbridge Gas Inc., 3,01 %, 9 février 2049	62 384	59 218	
55 000	Enbridge Gas Inc., 3,51 %, 29 novembre 2047	56 140	58 338	
45 000	Enbridge Gas Inc., 3,59 %, 22 novembre 2047	48 514	48 331	
100 000	Enbridge Gas Inc., 3,65 %, 1 ^{er} avril 2050	114 606	108 923	
46 000	Enbridge Gas Inc., 3,8 %, 1 ^{er} juin 2046	52 542	50 925	
41 000	Enbridge Gas Inc., 4,5 %, 23 novembre 2043	49 620	49 557	
27 000	Enbridge Gas Inc., 6,9 %, 15 novembre 2032	39 602	38 127	
125 000	Enbridge Inc., 2,99 %, 3 octobre 2029	128 205	129 098	
150 000	Enbridge Inc., 3,2 %, 8 juin 2027	159 067	158 344	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
101 000	Enbridge Inc., 4,24 %, 27 août 2042	105 286	103 925	
121 000	Enbridge Inc., 4,57 %, 11 mars 2044	139 220	130 451	
39 000	Enbridge Inc., 4,87 %, 21 novembre 2044	44 754	43 850	
19 000	Enbridge Inc., 5,57 %, 14 novembre 2035	22 384	22 186	
24 000	Enbridge Inc., 5,75 %, 2 septembre 2039	31 391	29 442	
28 000	Enbridge Inc., 7,2 %, 18 juin 2032	37 267	37 237	
36 000	Enbridge Inc., 7,22 %, 24 juillet 2030	48 358	46 842	
50 000	Pipelines Enbridge Inc., 2,82 %, 12 mai 2031	50 268	50 603	
40 000	Pipelines Enbridge Inc., 3 %, 10 août 2026	39 360	42 272	
88 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,52 %, 22 février 2029	95 501	95 395	
60 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,13 %, 9 août 2046	66 818	62 268	
62 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,2 %, 12 mai 2051	63 138	65 292	
93 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,33 %, 22 février 2049	105 430	99 798	
37 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 17 août 2043	43 873	40 525	
50 000	Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 29 septembre 2045	59 554	55 092	
75 000	Pipelines Enbridge Inc., 5,33 %, 6 avril 2040	92 067	89 712	
26 000	Pipelines Enbridge Inc., 5,35 %, 10 novembre 2039	32 902	31 052	
46 000	Énergir inc., 5,7 %, 10 juillet 2036	64 924	61 014	
47 000	Énergir inc., série U, 3,53 %, 16 mai 2047	46 210	50 592	
25 000	ENMAX Corp., série 4, 3,84 %, 5 juin 2028	25 100	27 012	
15 000	EPCOR Utilities Inc., 2,9 %, 19 mai 2050	16 153	14 259	
18 000	EPCOR Utilities Inc., 3,11 %, 8 juillet 2049	17 991	17 813	
20 000	EPCOR Utilities Inc., 3,55 %, 27 novembre 2047	21 228	21 372	
9 000	EPCOR Utilities Inc., 4,55 %, 28 février 2042	11 204	10 880	
35 000	EPCOR Utilities Inc., 5,75 %, 24 novembre 2039	47 831	47 642	
10 000	EPCOR Utilities Inc., 6,65 %, 15 avril 2038	15 051	14 627	
107 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,95 %, 3 mars 2031	106 867	110 694	
62 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,23 %, 14 juin 2029	62 297	66 853	
81 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 décembre 2027	81 461	88 135	
64 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,7 %, 16 décembre 2026	67 243	71 076	
35 000	Finning International Inc., 2,63 %, 14 août 2026	35 203	35 724	
20 000	Finning International Inc., 5,08 %, 13 juin 2042	22 694	23 896	
25 000	First Capital Realty Inc., série V, 3,46 %, 22 janvier 2027	26 225	26 083	
29 000	FPI First Capital, 3,45 %, 1 ^{er} mars 2028	29 769	29 988	
38 000	FPI First Capital, série U, 3,75 %, 12 juillet 2027	38 826	40 156	
36 000	Autorité Financière des Premières Nations, 1,71 %, 16 juin 2030	36 735	35 225	
62 000	Fortis Inc., 2,18 %, 15 mai 2028	62 512	62 572	
40 000	FortisAlberta Inc., 2,63 %, 8 juin 2051	40 636	35 919	
30 000	FortisAlberta Inc., 3,34 %, 21 septembre 2046	28 690	30 890	
46 000	FortisAlberta Inc., 3,67 %, 9 septembre 2047	55 621	50 096	
37 000	FortisAlberta Inc., 3,73 %, 18 septembre 2048	36 945	40 789	
35 000	FortisAlberta Inc., 4,27 %, 22 septembre 2045	45 689	41 426	
31 000	FortisAlberta Inc., 4,85 %, 11 septembre 2043	38 174	39 199	
36 000	FortisAlberta Inc., série 04-2, 6,22 %, 31 octobre 2034	51 052	49 042	
27 000	FortisBC Energy Inc., 2,42 %, 18 juillet 2031	27 092	27 402	
35 000	FortisBC Energy Inc., 2,54 %, 13 juillet 2050	35 314	31 211	
48 000	FortisBC Energy Inc., 2,82 %, 9 février 2049	47 051	45 466	
20 000	FortisBC Energy Inc., 3,38 %, 13 avril 2045	22 819	20 926	
34 000	FortisBC Energy Inc., 3,67 %, 9 avril 2046	37 854	37 266	
32 000	FortisBC Energy Inc., 3,69 %, 30 octobre 2047	35 575	35 305	
34 000	FortisBC Energy Inc., 3,78 %, 6 mars 2047	38 989	37 926	
46 000	FortisBC Energy Inc., 3,85 %, 7 décembre 2048	49 969	52 247	
44 000	FortisBC Energy Inc., 5,8 %, 13 mai 2038	64 173	59 788	
27 000	FortisBC Energy Inc., 5,9 %, 26 février 2035	34 470	35 972	
44 000	FortisBC Energy Inc., 6 %, 2 octobre 2037	59 116	60 759	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
15 000	FortisBC Energy Inc., 6,5 %, 1 ^{er} mai 2034	22 253	20 802	
25 000	FortisBC Inc., 4 %, 28 octobre 2044	30 495	27 853	
40 000	Société de financement GE Capital Canada, 5,73 %, 22 octobre 2037	46 156	48 751	
41 000	Gibson Energy Inc., 2,85 %, 14 juillet 2027	42 687	42 134	
63 000	Gibson Energy Inc., 3,6 %, 17 septembre 2029	63 731	67 000	
63 000	Société en commandite Holding FPI Granite, 2,38 %, 18 décembre 2030	63 682	61 152	
71 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, 3,06 %, 4 juin 2027	76 910	74 679	
92 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 3,26 %, 1 ^{er} juin 2037	95 253	95 628	
165 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 19-2, 2,75 %, 17 octobre 2039	165 381	159 905	
86 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2002-3, 6,98 %, 15 octobre 2032	126 184	120 482	
110 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2011-1, 5,3 %, 25 février 2041	149 914	146 154	
101 000	Great-West Lifeco Inc., 2,98 %, 8 juillet 2050	109 761	95 179	
70 000	Great-West Lifeco Inc., 6 %, 16 novembre 2039	97 829	96 384	
82 000	Great-West Lifeco Inc., 6,67 %, 21 mars 2033	115 590	113 907	
41 000	Great-West Lifeco Inc., 6,74 %, 24 novembre 2031	55 563	55 643	
31 000	FPI H&R, série R, subalternes, 2,91 %, 2 juin 2026	31 434	31 367	
43 000	FPI H&R, série S, 2,63 %, 19 février 2027	42 262	42 608	
39 000	Administration de l'aéroport international d'Halifax, 5,5 %, 19 juillet 2041	56 352	50 909	
68 000	Heathrow Funding Ltd., 2,69 %, 13 octobre 2029	69 132	69 213	
40 000	Heathrow Funding Ltd., 3,4 %, 8 mars 2030	42 096	42 229	
62 000	Heathrow Funding Ltd., 3,66 %, 13 janvier 2033	64 567	65 742	
42 000	Heathrow Funding Ltd., 3,73 %, 13 avril 2035	42 980	43 936	
50 000	Heathrow Funding Ltd., 3,78 %, 4 septembre 2032	54 255	53 642	
194 000	Hospital for Sick Children (The), série B, 3,42 %, 7 décembre 2057	220 869	208 970	
92 807	Hospital Infrastructure Partners (NOH) Partnership, série A, 5,44 %, 31 janvier 2045	118 927	113 920	
108 000	Hydro One Inc., 2,71 %, 28 février 2050	103 624	99 686	
137 000	Hydro One Inc., 3,63 %, 25 juin 2049	148 087	149 779	
70 000	Hydro One Inc., 3,72 %, 18 novembre 2047	77 612	77 417	
64 000	Hydro One Inc., 3,91 %, 23 février 2046	73 215	72 506	
46 000	Hydro One Inc., 4 %, 22 décembre 2051	54 084	53 403	
63 000	Hydro One Inc., 4,17 %, 6 juin 2044	66 072	73 659	
60 000	Hydro One Inc., 4,39 %, 26 septembre 2041	67 444	71 600	
80 000	Hydro One Inc., 4,59 %, 9 octobre 2043	100 560	98 619	
71 000	Hydro One Inc., 4,89 %, 13 mars 2037	90 453	88 449	
60 000	Hydro One Inc., 5 %, 19 octobre 2046	76 574	79 609	
110 000	Hydro One Inc., 5,36 %, 20 mai 2036	150 151	142 600	
89 000	Hydro One Inc., 5,49 %, 16 juillet 2040	122 861	119 914	
68 000	Hydro One Inc., 6,35 %, 31 janvier 2034	97 576	93 348	
64 000	Hydro One Inc., 6,59 %, 22 avril 2043	92 480	98 802	
78 000	Hydro One Inc., 6,93 %, 1 ^{er} juin 2032	111 293	109 565	
53 000	Hydro One Inc., série 17, 6,03 %, 3 mars 2039	74 946	74 332	
100 000	Hydro One Inc., série 26, 3,79 %, 31 juillet 2062	125 598	112 629	
45 000	Hydro One Inc., série 44, 3,64 %, 5 avril 2050	49 985	49 348	
12 000	Société de portefeuille d'Hydro Ottawa inc., 2,61 %, 3 février 2025	11 637	12 528	
46 000	Société financière IGM Inc., 4,12 %, 9 décembre 2047	54 307	51 121	
45 000	Société financière IGM Inc., 4,17 %, 13 juillet 2048	46 607	50 549	
50 000	Société financière IGM Inc., 4,21 %, 21 mars 2050	52 458	56 638	
40 000	Société financière IGM Inc., 4,56 %, 25 janvier 2047	45 469	47 325	
36 000	Société financière IGM Inc., 6 %, 10 décembre 2040	46 856	48 563	
27 000	Société financière IGM Inc., 7,11 %, 7 mars 2033	37 134	37 680	
97 570	InPower BC G.P., 4,47 %, 31 mars 2033	101 409	107 775	
69 000	Intact Corporation financière, 2,95 %, 16 décembre 2050	70 395	64 129	
51 000	Intact Corporation financière, 5,16 %, 16 juin 2042	67 024	65 011	
46 000	Intact Corporation financière, 6,4 %, 23 novembre 2039	65 051	65 392	
114 269	Integrated Team Solutions PCH Partnership, 4,88 %, 31 mai 2046	128 514	133 439	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
56 000	Inter Pipeline Ltd., 3,48 %, 16 décembre 2026	55 026	59 462	
90 000	Inter Pipeline Ltd., 4,23 %, 1 ^{er} juin 2027	99 149	98 772	
78 000	Inter Pipeline Ltd., 4,64 %, 30 mai 2044	81 715	81 698	
56 000	Keyera Corp., 3,93 %, 21 juin 2028	55 728	60 746	
57 000	Keyera Corp., 3,96 %, 29 mai 2030	60 799	61 137	
52 000	Labrador-Island Link Funding Trust, série B, 3,86 %, 1 ^{er} décembre 2045	69 357	65 062	
101 000	Les Compagnies Loblaw Itée, 2,28 %, 7 mai 2030	105 584	99 506	
56 000	Les Compagnies Loblaw Itée, 4,49 %, 11 décembre 2028	63 398	64 428	
30 000	Les Compagnies Loblaw Limitée, 5,9 %, 18 janvier 2036	40 074	38 052	
24 000	Les Compagnies Loblaw Limitée, 6,5 %, 22 janvier 2029	28 715	30 380	
18 000	Les Compagnies Loblaw Itée, 7 %, 7 juin 2040	27 097	24 974	
40 000	Lower Mattagami Energy L.P., 4,18 %, 23 avril 2052	43 312	48 311	
150 000	Lower Mattagami Energy L.P., série 2014-1, 3,42 %, 20 juin 2024	156 280	160 326	
119 000	Manulife Finance Delaware L.P., 5,06 %, 15 décembre 2041	135 517	144 469	
76 569	Maritime Link Financing Trust, série A, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2052	80 829	87 946	
45 000	Université McGill, série A, 6,15 %, 22 septembre 2042	62 883	67 439	
37 000	Université McGill, série B, 3,98 %, 29 janvier 2056	49 614	43 313	
56 000	Metro inc., 3,39 %, 6 décembre 2027	56 544	60 386	
61 000	Metro inc., 3,41 %, 28 février 2050	63 136	58 030	
56 000	Metro inc., 4,27 %, 4 décembre 2047	64 936	61 430	
50 000	Metro inc., 5,97 %, 15 octobre 2035	63 641	63 945	
52 000	Metro inc., série D, 5,03 %, 1 ^{er} décembre 2044	65 330	62 750	
60 000	Molson Coors International L.P., 3,44 %, 15 juillet 2026	58 575	63 495	
101 000	NAV Canada, 2,92 %, 29 septembre 2051	111 297	99 866	
44 000	NAV Canada, 3,21 %, 29 septembre 2050	46 427	45 982	
67 000	NAV CANADA, 3,29 %, 30 mars 2048	74 814	70 866	
30 000	NAV Canada, 3,53 %, 23 février 2046	31 826	32 902	
124 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,05 %, 22 juillet 2044	137 627	131 553	
70 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., série D, 3,7 %, 23 février 2043	68 266	70 579	
68 000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co. Ltd., série F, 4,25 %, 1 ^{er} juin 2029	73 605	76 727	
62 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., série G, 4,75 %, 1 ^{er} juin 2037	75 959	72 629	
64 000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co. Ltd., série H, 4,15 %, 1 ^{er} juin 2033	73 764	70 854	
78 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., série I, 4,35 %, 14 septembre 2028	86 795	86 584	
94 000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co. Ltd., série J, 2,8 %, 1 ^{er} juin 2027	89 728	97 732	
104 000	North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., série K, 3,65 %, 1 ^{er} juin 2035	106 498	109 125	
158 789	Northern Courier Pipeline L.P., 3,37 %, 30 juin 2042	166 670	162 395	
29 940	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série A, 4,12 %, 30 juin 2042	30 049	32 956	
30 971	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série B, 4,11 %, 31 mars 2042	31 337	34 075	
120 241	Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série D, 3,74 %, 31 décembre 2032	117 473	127 532	
62 000	Nova Scotia Power Inc., 3,57 %, 5 avril 2049	70 174	65 598	
21 000	Nova Scotia Power Inc., 3,61 %, 1 ^{er} mai 2045	24 371	22 077	
42 500	Nova Scotia Power Inc., 4,15 %, 6 mars 2042	44 832	47 874	
50 000	Nova Scotia Power Inc., 4,5 %, 20 juillet 2043	64 178	59 394	
45 000	Nova Scotia Power Inc., 6,95 %, 25 août 2033	63 409	62 600	
27 000	Nova Scotia Power Inc., série X, 5,61 %, 15 juin 2040	38 412	35 888	
111 000	Ontario Electricity Financial Corp., 8,25 %, 22 juin 2026	156 914	147 263	
40 000	Ontario Electricity Financial Corp., série FV6, 8,9 %, 18 août 2022	53 185	43 814	
1 000	Ontario Infrastructure Projects Corp., série 2007-A1, 4,7 %, 1 ^{er} juin 2037	1 182	1 271	
48 000	Ontario Power Generation Inc., 1,17 %, 22 avril 2026	46 980	47 175	
20 000	Ontario Power Generation Inc., 2,95 %, 21 février 2051	18 698	18 704	
76 000	Ontario Power Generation Inc., 3,22 %, 8 avril 2030	81 554	81 585	
80 000	Ontario Power Generation Inc., 3,32 %, 4 octobre 2027	82 455	86 728	
13 000	Ontario Power Generation Inc., 3,84 %, 22 juin 2048	14 172	14 257	
20 000	Ontario Power Generation Inc., 4,25 %, 18 janvier 2049	24 332	23 397	
48 000	Ontario Power Generation Inc., série 4, 2,98 %, 13 septembre 2029	50 833	50 885	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
12 000	Ontario Power Generation Inc., série 5, 3,65 %, 13 septembre 2050	12 780	12 799	
146 384	Ottawa MacDonald-Cartier International Airport Authority, série E, 3,93 %, 9 juin 2045	168 124	154 938	
96 000	Pembina Pipeline Corp., 3,62 %, 3 avril 2029	97 134	102 738	
60 000	Pembina Pipeline Corp., 3,71 %, 11 août 2026	60 592	64 572	
60 000	Pembina Pipeline Corp., 4,24 %, 15 juin 2027	62 740	66 309	
109 000	Pembina Pipeline Corp., 4,54 %, 3 avril 2049	116 982	113 994	
57 000	Pembina Pipeline Corp., 4,67 %, 28 mai 2050	60 747	60 911	
85 000	Pembina Pipeline Corp., 4,74 %, 21 janvier 2047	95 112	91 308	
61 000	Pembina Pipeline Corp., 4,75 %, 30 avril 2043	59 603	65 332	
76 000	Pembina Pipeline Corp., série 4, 4,81 %, 25 mars 2044	84 026	82 057	
81 000	Pembina Pipeline Corp., série 10, 4,02 %, 27 mars 2028	84 196	88 723	
124 000	Pembina Pipeline Corp., série 11, 4,75 %, 26 mars 2048	139 177	133 602	
88 000	Pembina Pipeline Corp., série 15, 3,31 %, 1 ^{er} février 2030	91 070	91 538	
2 567	Plenary Health Care Partnerships Humber L.P., 4,9 %, 31 mai 2039	2 869	3 023	
256 715	Plenary Properties LTAP L.P., 6,29 %, 31 janvier 2044	347 917	344 511	
51 000	Power Corporation du Canada, 4,46 %, 27 juillet 2048	58 672	60 283	
50 000	Power Corporation du Canada, 4,81 %, 31 janvier 2047	58 802	61 491	
43 000	Corporation Financière Power, 6,9 %, 11 mars 2033	55 359	58 297	
167 000	PSP Capital Inc., 0,9 %, 15 juin 2026	167 281	163 950	
74 000	PSP Capital Inc., 1,73 %, 21 juin 2022	72 178	75 024	
56 000	PSP Capital Inc., série 7, 3,29 %, 4 avril 2024	58 231	59 827	
56 000	PSP Capital Inc., série 9, 2,09 %, 22 novembre 2023	54 578	57 886	
103 000	PSP Capital Inc., série 12, 2,05 %, 15 janvier 2030	104 595	105 041	
56 000	Reliance L.P., 2,67 %, 1 ^{er} août 2028	56 096	56 584	
54 000	Reliance L.P., 2,68 %, 1 ^{er} décembre 2027	56 343	54 831	
44 000	FPI RioCan, série AC, 2,36 %, 10 mars 2027	43 834	43 979	
60 000	FPI RioCan, série AD, 1,97 %, 15 juin 2026	60 073	59 402	
125 000	Rogers Communications Inc., 3,25 %, 1 ^{er} mai 2029	126 833	130 972	
188 000	Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	212 191	201 904	
124 000	Rogers Communications Inc., 6,11 %, 25 août 2040	168 241	158 420	
61 000	Rogers Communications Inc., 6,56 %, 22 mars 2041	89 807	81 884	
70 000	Rogers Communications Inc., 6,68 %, 4 novembre 2039	102 683	94 443	
162 121	Royal Office Finance L.P., série A, 5,21 %, 12 novembre 2032	195 035	200 886	
44 000	Saputo inc., 1,42 %, 19 juin 2026	44 115	43 044	
100 000	Saputo inc., 2,24 %, 16 juin 2027	104 034	100 726	
53 000	Fiducie de capital Banque Scotia, série 06-1, 5,65 %, 31 décembre 2056	61 494	69 784	
1 639	SEC L.P. and Arci Ltd., 5,19 %, 29 août 2033	1 718	1 768	
190 510	SGTP Highway Bypass L.P., série A, 4,11 %, 31 janvier 2045	209 464	206 164	
63 000	Shaw Communications Inc., 2,9 %, 9 décembre 2030	67 269	63 135	
74 000	Shaw Communications Inc., 3,3 %, 10 décembre 2029	74 229	77 374	
55 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 1 ^{er} mars 2027	55 054	59 398	
37 000	Shaw Communications Inc., 4,25 %, 9 décembre 2049	40 518	38 028	
74 000	Shaw Communications Inc., 4,4 %, 2 novembre 2028	74 207	83 101	
180 000	Shaw Communications Inc., 6,75 %, 9 novembre 2039	257 726	242 528	
46 000	FPI SmartCentres, série P, 3,44 %, 28 août 2026	43 950	48 685	
31 000	FPI SmartCentres série S, 3,83 %, 21 décembre 2027	29 551	33 352	
56 000	FPI SmartCentres, série U, 3,53 %, 20 décembre 2029	56 485	58 610	
27 000	FPI SmartCentres, série V, 3,19 %, 11 juin 2027	28 768	28 158	
37 000	FPI SmartCentres, série W, 3,65 %, 11 décembre 2030	39 779	38 705	
37 000	FPI SmartCentres, série Y, 2,31 %, 18 décembre 2028	37 091	35 951	
19 000	Sobeys Inc., 6,64 %, 7 juin 2040	26 608	25 901	
30 000	Sobeys Inc., série D, 6,06 %, 29 octobre 2035	37 811	37 283	
179 575	SSL Finance Inc. / SSL Financement Inc., série A, 4,1 %, 31 octobre 2045	202 969	197 290	
38 000	Stantec Inc., 2,05 %, 8 octobre 2027	38 002	37 432	
31 000	Summit Industrial Income REIT, série C, 2,25 %, 12 janvier 2027	31 234	31 147	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
45 000	Fiducie de capital Sun Life, série B, 7,09 %, 30 juin 2032	62 989	61 348	
82 000	Financière Sun Life inc., 5,4 %, 29 mai 2042	101 077	104 674	
87 000	Suncor Énergie Inc., 3 %, 14 septembre 2026	93 452	91 711	
94 000	Suncor Énergie Inc., 3,1 %, 24 mai 2029	96 075	98 422	
78 000	Suncor Énergie Inc., 3,95 %, 4 mars 2051	75 608	78 242	
157 000	Suncor Énergie Inc., 5 %, 9 avril 2030	188 845	184 650	
76 000	Suncor Énergie Inc., 5,39 %, 26 mars 2037	93 731	91 188	
47 000	Suncor Énergie Inc., série 5, 4,34 %, 13 septembre 2046	51 797	50 104	
128 000	TCHC Issuer Trust, série A, 4,88 %, 11 mai 2037	159 313	163 565	
80 000	TELUS Corp., 2,05 %, 7 octobre 2030	80 656	75 962	
72 000	TELUS Corp., 3,63 %, 1 ^{er} mars 2028	71 182	78 123	
93 000	TELUS Corp., 4,4 %, 1 ^{er} avril 2043	103 142	99 446	
78 000	TELUS Corp., 4,4 %, 29 janvier 2046	87 746	83 648	
62 000	TELUS Corp., 4,75 %, 17 janvier 2045	68 743	69 676	
56 000	TELUS Corp., 5,15 %, 26 novembre 2043	68 537	66 014	
72 000	TELUS Corp., série CAA, 3,15 %, 19 février 2030	71 961	75 299	
129 000	TELUS Corp., série CAB, 3,95 %, 16 février 2050	136 528	129 581	
75 000	TELUS Corp., série CAC, 2,35 %, 27 janvier 2028	79 108	75 779	
70 000	TELUS Corp., série CAE, 4,1 %, 5 avril 2051	69 178	72 017	
140 000	TELUS Corp., série CP, 4,85 %, 5 avril 2044	167 726	159 026	
74 000	TELUS Corp., série CW, 4,7 %, 6 mars 2048	88 838	83 286	
125 000	TELUS Corp., série CY, 3,3 %, 2 mai 2029	128 082	132 859	
96 000	TELUS Corp., série CZ, 2,75 %, 8 juillet 2026	100 212	99 999	
56 000	Teranet Holdings L.P., 5,75 %, 17 décembre 2040	62 928	66 786	
34 000	Teranet Holdings L.P., 6,1 %, 17 juin 2041	43 383	42 179	
44 000	Terasen Gas (Vancouver Island) Inc., 6,05 %, 15 février 2038	63 766	60 954	
62 000	Industries Toromont Limitée, 3,84 %, 27 octobre 2027	62 757	67 553	
6 000	Toronto Hydro Corp., 4,08 %, 16 septembre 2044	7 378	7 011	
22 000	Toronto Hydro Corp., 5,54 %, 21 mai 2040	27 822	29 837	
35 000	Toronto Hydro Corp., série 16, 1,5 %, 15 octobre 2030	34 806	33 044	
31 000	Tourmaline Oil Corp., série 1, 2,08 %, 25 janvier 2028	31 113	30 267	
88 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3 %, 18 septembre 2029	88 745	91 125	
63 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	62 893	67 113	
270 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,8 %, 5 avril 2027	289 149	293 487	
171 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,18 %, 3 juillet 2048	180 679	175 549	
109 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,33 %, 16 septembre 2047	119 904	114 602	
155 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,34 %, 15 octobre 2049	166 579	163 476	
109 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,35 %, 6 juin 2046	117 435	114 759	
121 000	TransCanada PipeLines Ltd., 4,55 %, 15 novembre 2041	138 422	130 706	
22 000	TransCanada PipeLines Ltd., 6,28 %, 26 mai 2028	26 214	26 722	
29 000	TransCanada PipeLines Ltd., 8,05 %, 17 février 2039	46 030	43 789	
91 000	Transurban Finance Co. Pty Ltd., 4,56 %, 14 novembre 2028	97 294	101 298	
55 778	Trillium Windpower L.P., série 1, 5,8 %, 15 février 2033	62 479	66 461	
38 000	TriSummit Utilities Inc., 4,26 %, 5 décembre 2028	40 909	43 207	
92 000	Union Gas Ltd., 4,2 %, 2 juin 2044	98 765	107 142	
55 000	Union Gas Ltd., 4,88 %, 21 juin 2041	68 305	68 610	
58 000	Union Gas Ltd., 5,2 %, 23 juillet 2040	81 786	74 790	
61 000	Union Gas Ltd., 6,05 %, 2 septembre 2038	87 889	84 615	
27 000	Union Gas Ltd., série 6, 5,46 %, 11 septembre 2036	33 230	34 936	
67 000	Université d'Ottawa, 6,28 %, 15 avril 2043	108 861	100 864	
46 000	Université de Toronto, série B, 5,84 %, 15 décembre 2043	67 919	65 990	
97 000	Université de Toronto, série E, 4,25 %, 7 décembre 2051	116 584	118 794	
25 000	Université Western Ontario, série A, 4,8 %, 24 mai 2047	29 760	32 121	
36 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série F, 3,86 %, 10 novembre 2045	37 692	40 610	
45 000	Administration de l'aéroport de Vancouver, série G, 3,66 %, 23 novembre 2048	47 305	49 654	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
62 000	Administration de l'aéroport international de Vancouver, série H, 2,87 %, 18 octobre 2049	57 751	59 525	
125 000	Verizon Communications Inc., 2,38 %, 22 mars 2028	125 324	126 602	
125 000	Verizon Communications Inc., 2,5 %, 16 mai 2030	133 067	124 822	
47 000	Verizon Communications Inc., 3,63 %, 16 mai 2050	50 012	45 880	
70 000	Verizon Communications Inc., 4,05 %, 22 mars 2051	72 028	73 416	
63 000	Waste Management of Canada Corp., 2,6 %, 23 septembre 2026	63 478	65 762	
40 000	Westcoast Energy Inc., 4,79 %, 28 octobre 2041	47 995	45 656	
30 000	Westcoast Energy Inc., 7,15 %, 20 mars 2031	38 707	40 247	
20 168	Winnipeg Airports Authority Inc., 5,21 %, 28 septembre 2040	23 119	23 410	
62 000	Groupe WSP Global Inc., subalternes, 2,41 %, 19 avril 2028	62 323	62 526	
39 000	Université York, 6,48 %, 7 mars 2042	56 160	58 593	
		33,331,140	33,247,690	32.81
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES ET OBLIGATIONS GARANTIES				
348 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,1 %, 15 mars 2031	333 525	327 335	
406 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,25 %, 15 juin 2026	405 294	406 507	
321 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,4 %, 15 mars 2031	306 651	310 506	
360 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,75 %, 15 juin 2022	359 153	365 156	
882 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,75 %, 15 juin 2030	942 011	885 167	
360 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,8 %, 15 décembre 2024	361 751	371 180	
574 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,9 %, 15 septembre 2026	561 595	592 173	
489 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,95 %, 15 décembre 2025	505 285	506 458	
455 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,1 %, 15 septembre 2029	466 261	471 605	
360 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 juin 2023	372 755	372 885	
313 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 septembre 2023	330 296	325 253	
554 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 juin 2027	557 279	585 078	
205 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 mars 2028	208 641	216 712	
564 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,4 %, 15 décembre 2022	581 624	580 575	
189 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,55 %, 15 mars 2025	194 039	199 989	
558 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,65 %, 15 décembre 2028	581 426	601 328	
583 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,9 %, 15 juin 2024	627 625	619 269	
137 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série 55, 3,15 %, 15 septembre 2023	146 191	144 735	
150 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	152 899	157 306	
281 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série 100, 1,9 %, 15 mars 2031	282 065	284 297	
349 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série FEB, 2,65 %, 15 mars 2028	360 094	375 555	
412 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série MAR, 0,95 %, 15 juin 2025	410 204	411 009	
377 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série SEPT, 2,55 %, 15 décembre 2023	389 538	394 685	
143 000	Société canadienne des postes, série 1, 4,36 %, 16 juillet 2040	180 446	186 790	
30 000	Société canadienne des postes, série 2, 4,08 %, 16 juillet 2025	33 606	33 555	
32 000	Exportation et développement Canada, 1,8 %, 1er septembre 2022	32 093	32 544	
610 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} août 2022	609 832	609 829	
752 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} novembre 2022	751 902	751 027	
650 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} février 2023	649 989	648 615	
610 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mai 2023	608 821	607 808	
104 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} août 2023	103 696	103 460	
752 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} avril 2024	748 215	743 934	
691 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	677 310	668 243	
965 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} septembre 2025	968 894	950 006	
2 924 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1 ^{er} décembre 2030	2 739 541	2 696 001	
512 000	Gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} septembre 2022	515 757	516 133	
585 000	Gouvernement du Canada, 1 %, 1 ^{er} septembre 2026	584 416	583 407	
1 090 000	Gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} juin 2027	1 110 360	1 084 681	
352 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	364 377	358 052	
3 278 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} juin 2030	3 371 422	3 254 338	
289 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2023	295 926	294 804	
329 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	333 335	337 298	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
985 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2026	1 030 450	1 009 521	
90 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1 ^{er} juin 2031	89 294	90 517	
500 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} mars 2023	516 295	511 176	
823 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} septembre 2023	863 781	849 418	
989 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} juin 2028	1 078 134	1 044 451	
385 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1 ^{er} décembre 2051	452 995	399 170	
244 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} mars 2024	255 695	254 663	
266 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	290 284	280 944	
900 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	1 003 848	968 999	
280 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1 ^{er} juin 2024	298 910	295 014	
228 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2022	236 384	233 201	
122 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} décembre 2048	168 782	146 431	
47 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} décembre 2064	71 477	58 879	
133 000	Gouvernement du Canada, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2045	198 692	177 793	
113 000	Gouvernement du Canada, 4 %, 1 ^{er} juin 2041	173 855	156 480	
96 000	Gouvernement du Canada, 5 %, 1 ^{er} juin 2037	156 324	141 516	
780 000	Gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2029	1 091 918	1 043 800	
99 000	Gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2033	158 628	144 250	
49 000	Gouvernement du Canada, 8 %, 1 ^{er} juin 2023	59 117	56 034	
286 000	Gouvernement du Canada, 8 %, 1 ^{er} juin 2027	415 345	398 676	
48 000	Gouvernement du Canada, 9 %, 1 ^{er} juin 2025	64 122	63 121	
300 000	Muskat Falls / Labrador Transmission Assets Funding Trust, série A, 3,63 %, 1 ^{er} juin 2029	353 550	342 742	
96 000	Muskat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust, série C, 3,86 %, 1 ^{er} décembre 2048	130 956	121 759	
61 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 1,6 %, 3 juillet 2030	62 008	59 081	
38 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,25 %, 23 novembre 2028	43 777	42 045	
15 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 4,45 %, 9 juin 2044	20 660	19 357	
		33 401 421	32 874 326	32,44
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES				
52 000	Financement-Québec, 5,25 %, 1 ^{er} juin 2034	67 050	69 135	
103 000	Hydro-Québec, 2,1 %, 15 février 2060	97 075	89 371	
221 000	Hydro-Québec, 4 %, 15 février 2055	284 127	288 311	
109 000	Hydro-Québec, 6 %, 15 février 2040	159 187	166 537	
5 000	Hydro-Québec, 6,5 %, 16 janvier 2035	7 549	7 400	
107 000	Hydro-Québec, série 19, 6,5 %, 15 février 2035	163 128	159 901	
67 000	Hydro-Québec, série IC, 9,63 %, 15 juillet 2022	80 535	73 358	
28 000	Hydro-Québec, série JG, 6 %, 15 août 2031	40 148	38 155	
158 000	Hydro-Québec, série JM, 5 %, 15 février 2045	228 507	226 720	
190 000	Hydro-Québec, série JN, 5 %, 15 février 2050	286 448	281 055	
20 000	Newfoundland & Labrador Hydro, 3,6 %, 1 ^{er} décembre 2045	22 830	22 235	
9 000	Newfoundland & Labrador Hydro, série AB, 6,65 %, 27 août 2031	11 947	12 522	
28 000	OPB Finance Trust, série E, 2,95 %, 2 février 2026	27 509	29 964	
72 000	OPB Finance Trust, série F, 2,98 %, 25 janvier 2027	76 183	77 038	
36 000	Province de l'Alberta, 1,6 %, 1 ^{er} septembre 2022	36 914	36 540	
665 000	Province de l'Alberta, 2,05 %, 1 ^{er} juin 2030	675 948	670 408	
304 000	Province de l'Alberta, 2,2 %, 1 ^{er} juin 2026	296 332	316 937	
127 000	Province de l'Alberta, 2,35 %, 1 ^{er} juin 2025	128 078	133 120	
61 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 15 décembre 2022	61 793	62 877	
447 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 1 ^{er} juin 2027	459 864	473 528	
59 000	Province de l'Alberta, 2,65 %, 1 ^{er} septembre 2023	61 414	61 599	
258 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 1 ^{er} décembre 2028	271 732	278 947	
169 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 20 septembre 2029	177 515	182 274	
193 000	Province de l'Alberta, 3,05 %, 1 ^{er} décembre 2048	196 858	205 867	
81 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 ^{er} juin 2024	84 838	86 294	
263 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1 ^{er} juin 2050	302 762	282 560	
140 000	Province de l'Alberta, 3,3 %, 1 ^{er} décembre 2046	151 755	155 605	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
10 000	Province de l'Alberta, 3,4 %, 1 ^{er} décembre 2023	10 413	10 653	
85 000	Province de l'Alberta, 3,45 %, 1 ^{er} décembre 2043	98 503	96 808	
53 000	Province de l'Alberta, 3,5 %, 1 ^{er} juin 2031	54 722	59 859	
72 000	Province de l'Alberta, 3,9 %, 1 ^{er} décembre 2033	84 876	84 534	
20 000	Province de la Colombie-Britannique, 1,55 %, 18 juin 2031	19 020	19 237	
314 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,2 %, 18 juin 2030	322 952	323 178	
122 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,3 %, 18 juin 2026	120 288	128 189	
183 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	194 320	194 731	
66 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,7 %, 18 décembre 2022	69 008	68 203	
35 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,75 %, 18 juin 2052	35 009	36 389	
139 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	144 244	148 755	
154 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 décembre 2028	162 513	167 962	
189 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 juin 2050	215 922	204 070	
158 000	Province de la Colombie-Britannique, 3,2 %, 18 juin 2044	164 000	177 929	
250 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,3 %, 18 juin 2042	315 648	326 230	
51 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,7 %, 18 juin 2037	64 919	67 392	
18 000	Province de la Colombie-Britannique, 4,9 %, 18 juin 2048	27 114	26 253	
38 000	Province de la Colombie-Britannique, 5,4 %, 18 juin 2035	54 363	52 509	
255 000	Province de la Colombie-Britannique, 5,7 %, 18 juin 2029	333 565	329 686	
57 000	Province de la Colombie-Britannique, 6,35 %, 18 juin 2031	79 100	79 765	
33 000	Province de la Colombie-Britannique, 9,5 %, 9 juin 2022	38 265	35 808	
91 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD, 3,3 %, 18 décembre 2023	98 801	96 926	
97 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD-35, 2,8 %, 18 juin 2048	91 073	101 970	
58 000	Province de la Colombie-Britannique, taux échelonné	70 545	73 156	
125 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2030	130 014	126 388	
33 000	Province du Manitoba, 2,05 %, 5 septembre 2052	31 806	28 765	
100 000	Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	101 432	105 193	
120 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2023	121 980	124 576	
154 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	154 092	163 108	
43 000	Province du Manitoba, 2,6 %, 2 juin 2027	41 529	45 686	
102 000	Province du Manitoba, 2,75 %, 2 juin 2029	107 052	109 257	
66 000	Province du Manitoba, 2,85 %, 5 septembre 2046	60 630	68 745	
140 000	Province du Manitoba, 3 %, 2 juin 2028	140 167	152 486	
87 000	Province du Manitoba, 3,2 %, 5 mars 2050	94 990	96 428	
71 000	Province du Manitoba, 3,4 %, 5 septembre 2048	75 095	81 504	
51 000	Province du Manitoba, 4,05 %, 5 septembre 2045	57 632	64 230	
38 000	Province du Manitoba, 4,1 %, 5 mars 2041	46 332	47 376	
56 000	Province du Manitoba, 4,6 %, 5 mars 2038	76 749	72 724	
50 000	Province du Manitoba, 4,63 %, 5 mars 2063	81 834	74 644	
23 000	Province du Manitoba, 4,65 %, 5 mars 2040	31 770	30 420	
40 000	Province du Manitoba, 5,7 %, 5 mars 2037	61 104	57 300	
18 000	Province du Manitoba, 6,3 %, 5 mars 2031	24 166	24 721	
50 000	Province du Nouveau-Brunswick, 1,8 %, 14 août 2025	52 472	51 311	
82 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	79 780	85 909	
71 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,6 %, 14 août 2026	72 071	75 384	
25 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,85 %, 2 juin 2023	25 848	26 091	
43 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,05 %, 14 août 2050	50 737	46 003	
81 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,1 %, 14 août 2028	82 992	88 719	
33 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,1 %, 14 août 2048	38 034	35 666	
59 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2043	67 014	68 350	
11 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2055	13 555	13 018	
28 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,65 %, 3 juin 2024	30 947	30 261	
50 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,8 %, 14 août 2045	63 391	60 278	
40 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,55 %, 26 mars 2037	47 317	51 061	
59 000	Province du Nouveau-Brunswick, 4,8 %, 26 septembre 2039	75 949	78 628	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
67 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,75 %, 2 juin 2030	67 324	65 247	
35 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,3 %, 2 juin 2025	33 884	36 515	
172 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2028	183 688	184 170	
43 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2029	43 429	45 887	
30 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,7 %, 17 octobre 2048	33 045	34 136	
12 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,5 %, 17 avril 2037	13 760	14 798	
19 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,65 %, 17 octobre 2040	24 704	24 238	
5 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 6,55 %, 17 octobre 2030	6 746	6 842	
26 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6R, 5,6 %, 17 octobre 2033	33 729	34 605	
86 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6X, 3,3 %, 17 octobre 2046	83 252	91 510	
81 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 6Z, 3 %, 2 juin 2026	85 858	87 164	
45 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 7B, 1,95 %, 2 juin 2022	46 139	45 676	
56 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 7H, 2,65 %, 17 octobre 2050	54 370	52 263	
41 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 1,1 %, 1 ^{er} juin 2028	39 340	39 604	
89 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 2 %, 1 ^{er} septembre 2030	88 675	89 467	
120 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 2,1 %, 1 ^{er} juin 2027	112 982	124 203	
51 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 3,15 %, 1 ^{er} décembre 2051	58 136	56 251	
9 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 3,45 %, 1 ^{er} juin 2045	9 327	10 371	
53 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 3,5 %, 2 juin 2062	65 152	64 022	
30 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,5 %, 1 ^{er} juin 2037	38 725	38 396	
4 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,7 %, 1 ^{er} juin 2041	4 947	5 372	
12 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 4,9 %, 1 ^{er} juin 2035	15 208	15 696	
92 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 5,8 %, 1 ^{er} juin 2033	123 596	126 382	
18 000	Province de la Nouvelle-Écosse, 6,6 %, 1 ^{er} juin 2027	23 794	23 189	
13 000	Province de la Nouvelle-Écosse, série D8, 2,15 %, 1 ^{er} juin 2025	12 715	13 530	
164 000	Province de l'Ontario, 1,05 %, 8 septembre 2027	164 592	159 489	
628 000	Province de l'Ontario, 1,35 %, 2 décembre 2030	612 899	594 430	
310 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	322 595	317 658	
193 000	Province de l'Ontario, 1,85 %, 1 ^{er} février 2027	203 559	197 711	
317 000	Province de l'Ontario, 1,9 %, 2 décembre 2051	286 160	268 561	
96 000	Province de l'Ontario, 1,95 %, 27 janvier 2023	96 111	98 259	
929 000	Province de l'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	988 247	939 645	
140 000	Province de l'Ontario, 2,15 %, 2 juin 2031	139 993	141 411	
116 000	Province de l'Ontario, 2,3 %, 8 septembre 2024	118 706	121 158	
495 000	Province de l'Ontario, 2,4 %, 2 juin 2026	490 093	520 831	
163 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 8 septembre 2023	167 237	170 037	
466 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	476 971	492 809	
815 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2027	831 608	866 394	
147 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 5 février 2025	151 222	155 679	
400 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 2 décembre 2050	435 876	401 622	
690 000	Province de l'Ontario, 2,7 %, 2 juin 2029	717 774	736 967	
355 000	Province de l'Ontario, 2,8 %, 2 juin 2048	360 079	368 147	
350 000	Province de l'Ontario, 2,85 %, 2 juin 2023	365 590	365 381	
700 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2028	714 936	758 419	
334 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 décembre 2046	332 703	352 726	
408 000	Province de l'Ontario, 2,9 %, 2 juin 2049	405 828	430 702	
300 000	Province de l'Ontario, 3,15 %, 2 juin 2022	313 817	307 872	
529 000	Province de l'Ontario, 3,45 %, 2 juin 2045	571 422	611 701	
290 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	312 996	312 297	
341 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2043	402 104	396 630	
286 000	Province de l'Ontario, 4,6 %, 2 juin 2039	377 608	375 439	
440 000	Province de l'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	595 376	589 129	
325 000	Province de l'Ontario, 4,7 %, 2 juin 2037	416 073	425 476	
80 000	Province de l'Ontario, 5,6 %, 2 juin 2035	108 929	111 529	
32 000	Province de l'Ontario, 5,7 %, 2 décembre 2039	45 749	47 366	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
159 000	Province de l'Ontario, 5,85 %, 8 mars 2033	224 550	218 944	
86 000	Province de l'Ontario, 6,2 %, 2 juin 2031	119 014	118 513	
388 000	Province de l'Ontario, 6,5 %, 8 mars 2029	531 125	519 332	
47 000	Province de l'Ontario, 7,5 %, 7 février 2024	60 838	55 030	
147 000	Province de l'Ontario, 8 %, 2 juin 2026	208 151	193 781	
31 000	Province de l'Ontario, 8 %, 2 décembre 2026	43 051	41 589	
66 000	Province de l'Ontario, 8,1%, 8 septembre 2023	82 449	76 673	
39 000	Province de l'Ontario, 8,5 %, 2 décembre 2025	54 664	51 138	
67 000	Province de l'Ontario, 9,5 %, 13 juillet 2022	78 668	73 260	
397 000	Province de l'Ontario, série KJ, 7,6 %, 2 juin 2027	552 381	533 970	
2 000	Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 3,6 %, 17 janvier 2053	2 087	2 346	
8 000	Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 4,6 %, 19 mai 2041	10 371	10 421	
240 000	Province de Québec, 1,5 %, 1 ^{er} septembre 2031	226 432	229 152	
886 000	Province de Québec, 1,9 %, 1 ^{er} septembre 2030	936 788	887 342	
380 000	Province de Québec, 2,3 %, 1 ^{er} septembre 2029	390 533	395 869	
579 000	Province de Québec, 2,5 %, 1 ^{er} septembre 2026	602 743	613 417	
285 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2025	303 135	304 148	
492 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2027	499 919	529 145	
492 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2028	524 527	530 093	
44 000	Province de Québec, 2,85 %, 1 ^{er} décembre 2053	44 873	46 486	
219 000	Province de Québec, 3 %, 1 ^{er} septembre 2023	228 554	230 392	
403 000	Province de Québec, 3,1 %, 1 ^{er} décembre 2051	487 255	446 268	
237 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2022	249 505	247 323	
183 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2045	199 322	215 117	
286 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2048	330 792	338 295	
160 000	Province de Québec, 3,75 %, 1 ^{er} septembre 2024	172 579	174 478	
118 000	Province de Québec, 4,25 %, 1 ^{er} décembre 2043	157 326	153 607	
144 000	Province de Québec, 5 %, 1 ^{er} décembre 2038	190 951	197 633	
271 000	Province de Québec, 5 %, 1 ^{er} décembre 2041	398 388	381 653	
46 000	Province de Québec, 5,35 %, 1 ^{er} juin 2025	54 340	53 423	
115 000	Province de Québec, 5,75 %, 1 ^{er} décembre 2036	167 930	166 399	
176 000	Province de Québec, 6,25 %, 1 ^{er} juin 2032	252 889	247 255	
75 000	Province de Québec, 8,5 %, 1 ^{er} avril 2026	104 917	99 682	
94 000	Province de Québec, 9,38 %, 16 janvier 2023	126 966	106 776	
15 000	Province de Québec, obligation à coupon détaché, 1 ^{er} avril 2035	9 571	10 564	
5 000	Province de Québec, série NG, 9,5 %, 30 mars 2023	6 397	5 779	
210 000	Province de Québec, série OS, 6 %, 1 ^{er} octobre 2029	280 024	277 419	
27 000	Province de Québec, série QV, 2,25 %, 22 février 2024	27 224	28 111	
115 000	Province de la Saskatchewan, 2,2 %, 2 juin 2030	123 688	117 762	
87 000	Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	86 699	92 180	
200 000	Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	197 506	213 213	
15 000	Province de la Saskatchewan, 2,8 %, 2 décembre 2052	15 039	15 527	
88 000	Province de la Saskatchewan, 3,05 %, 2 décembre 2028	95 312	96 220	
79 000	Province de la Saskatchewan, 3,1 %, 2 juin 2050	88 785	86 544	
80 000	Province de la Saskatchewan, 3,2 %, 3 juin 2024	82 940	85 465	
89 000	Province de la Saskatchewan, 3,3 %, 2 juin 2048	94 992	100 895	
32 000	Province de la Saskatchewan, 3,4 %, 3 février 2042	33 113	36 649	
35 000	Province de la Saskatchewan, 3,75 %, 5 mars 2054	44 330	43 540	
43 000	Province de la Saskatchewan, 3,9 %, 2 juin 2045	51 757	53 182	
40 000	Province de la Saskatchewan, 5,75 %, 5 mars 2029	48 938	51 327	
20 000	Province de la Saskatchewan, série EC, 5 %, 5 mars 2037	27 719	26 927	
		32 227 115	32 377 943	31,95

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS MUNICIPALES				
76 000	Ville de Montréal, 1,75 %, 1 ^{er} septembre 2030	77 612	74 166	
35 000	Ville de Montréal, 2,3 %, 1 ^{er} septembre 2029	37 647	36 047	
12 000	Ville de Montréal, 2,4 %, 1 ^{er} décembre 2041	11 376	11 513	
86 000	Ville de Montréal, 3 %, 1 ^{er} septembre 2027	86 630	93 031	
30 000	Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} septembre 2028	34 195	32 812	
21 000	Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} décembre 2036	20 852	22 734	
25 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2023	26 202	26 529	
22 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	22 795	23 731	
115 000	Ville de Montréal, 4,1 %, 1 ^{er} décembre 2034	140 731	137 663	
58 000	Ville de Montréal, 4,25 %, 1 ^{er} décembre 2032	63 499	69 459	
50 000	Ville d'Ottawa, 3,1 %, 27 juillet 2048	48 585	53 113	
22 000	Ville d'Ottawa, 4,2 %, 30 juillet 2053	30 547	28 430	
30 000	Ville de Toronto, 2,15 %, 25 août 2040	29 819	27 873	
55 000	Ville de Toronto, 2,4 %, 7 juin 2027	51 636	57 766	
47 000	Ville de Toronto, 2,45 %, 6 février 2025	46 408	49 240	
67 000	Ville de Toronto, 2,65 %, 9 novembre 2029	74 330	70 984	
30 000	Ville de Toronto, 2,8 %, 22 novembre 2049	32 203	29 979	
12 000	Ville de Toronto, 3,25 %, 24 juin 2046	12 078	12 992	
36 000	Ville de Toronto, 3,5 %, 2 juin 2036	39 313	40 602	
9 000	Ville de Toronto, 3,8 %, 13 décembre 2042	9 884	10 638	
20 000	Ville de Toronto, 3,9 %, 29 septembre 2023	21 870	21 434	
51 000	Ville de Toronto, 4,15 %, 10 mars 2044	59 312	63 080	
40 000	Ville de Toronto, 4,7 %, 10 juin 2041	49 892	52 555	
11 000	Ville de Vancouver, 3,7 %, 18 octobre 2052	13 962	13 011	
50 000	Ville de Winnipeg, 4,3 %, 15 novembre 2051	68 819	64 161	
20 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,1 %, 1 ^{er} juin 2025	20 316	20 008	
36 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 1 ^{er} décembre 2022	35 969	36 894	
36 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	35 309	38 014	
39 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,55 %, 9 octobre 2029	42 882	41 087	
23 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,6 %, 23 avril 2023	23 096	23 857	
90 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,95 %, 14 octobre 2024	95 424	95 877	
37 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,05 %, 23 octobre 2028	36 610	40 433	
20 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,35 %, 1 ^{er} juin 2022	21 030	20 562	
16 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,75 %, 26 septembre 2023	17 220	17 108	
40 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 4,95 %, 1 ^{er} décembre 2027	47 515	48 223	
20 000	Municipalité régionale de Peel, 2,5 %, 16 juin 2051	20 241	18 779	
39 000	Municipalité régionale de Peel, 3,85 %, 30 octobre 2042	42 076	46 374	
20 000	Municipalité régionale de Peel, 5,1 %, 29 juin 2040	29 344	27 314	
39 000	Municipalité régionale d'York, 1,7 %, 27 mai 2030	40 082	38 203	
24 000	Municipalité régionale d'York, 2,35 %, 9 juin 2027	23 140	25 125	
34 000	Municipalité régionale d'York, 2,5 %, 2 juin 2026	36 941	35 867	
50 000	Municipalité régionale d'York, série F, 4 %, 31 mai 2032	62 060	58 572	
		1 739 452	1 755 840	1,73
OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES				
73 000	Asian Development Bank, 4,65 %, 16 février 2027	85 423	85 537	
65 000	Banque interaméricaine de développement, 0,75 %, 15 octobre 2025	65 196	63 971	
59 000	Banque interaméricaine de développement, 0,88 %, 27 août 2027	58 822	56 976	
39 000	Banque interaméricaine de développement, 1,7 %, 10 octobre 2024	40 596	39 973	
65 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,75 %, 2 juillet 2025	65 437	64 274	
62 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,88 %, 28 septembre 2027	62 368	60 544	
91 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,9 %, 16 janvier 2025	92 429	93 962	
30 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,95 %, 20 septembre 2029	32 008	30 546	

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
	OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES (suite)			
62 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 2,25 %, 17 janvier 2023	62 247	63 723	
13 000	International Finance Corp., 2,38 %, 19 juillet 2023	13 231	13 479	
		577 757	572 985	0,57
Total des obligations		101 276 885	100 828 784	99,50
Ajustement au titre des coûts de transaction		-		
Total des placements		101 276 885	100 828 784	99,50
Autres actifs (passifs) nets			511 135	0,50
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			101 339 919	100,00

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	-	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	2 713 163	3 213 163
Parts rachetables émises contre trésorerie	500 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(1 200 000)	(300 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	2 013 163	2 913 163

s.o. – données historiques non disponibles.

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,180

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	12 695	-
Garanties (hors trésorerie)	13 347	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	4	-
Charges	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres	2	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	41,6	-

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

FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Obligations provinciales et obligations garanties	37,9
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	24,8
Services publics	11,6
Énergie	5,4
Services financiers	4,7
Services de communication	4,6
Produits industriels	4,1
Biens de consommation de base	3,5
Immobilier	1,7
Biens de consommation discrétionnaire	0,6
Obligations étrangères	0,5
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Technologies de l'information	0,1
Soins de santé	0,0
Matériaux	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

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

au 30 juin 2021

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	37,0
AA/Aa/A+	12,0
A	32,8
BBB/Baa/B++	17,7
Total	99,5

au 31 décembre 2020

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	29,2
AA/Aa/A+	15,2
A	35,9
BBB/Baa/B++	19,2
Total	99,5

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

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

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

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

Risque de change

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2021

	Moins de un an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus	
				5 ans de (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	1 083	11 769	10 681	77 296	100 829

au 31 décembre 2020

	Moins de un an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus	
				5 ans de (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	1 414	21 206	17 837	102 601	143 058

Au 30 juin 2021, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2020), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 285 000 \$ (3 196 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	100 829	-	100 829
Total	-	100 829	-	100 829

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	143 057	-	143 057
Total	-	143 057	-	143 057

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	71 048	77 053
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	92	334
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	7	30
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	-
Intérêts à recevoir	343	406
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	71 490	77 823
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	143
Frais de gestion à payer	11	-
Comptes créditeurs et charges à payer	10	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	21	143
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	71 469	77 680

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au	au	au	au	au	au
	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020
Parts non couvertes	71 469	77 680	49,29	50,12	1 450 000	1 550 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	-
Intérêts aux fins des distributions	860	1 490
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	185	321
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(1 464)	1 400
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(419)	3 211
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	-
Rabais sur frais	49	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	50	-
Total des revenus	(369)	3 211
Charges		
Frais de gestion (note 5)	67	97
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	3
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	2	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	76	100
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(3)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(445)	3 114

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts non couvertes	(445)	3 114	(0,29)	1,51	1 514 641	2 066 209

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	77 680	103 104
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(445)	3 114
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(815)	(1 365)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(2)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(817)	(1 365)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	27 284
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(4 949)	(41 992)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(4 949)	(14 708)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(6 211)	(12 959)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	71 469	90 145

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(445)	3 114
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(185)	(321)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	6	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	1 464	(1 400)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	31 938	33 686
Achat de placements et de dérivés	(27 220)	(39 301)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	-	-
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	63	197
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	11	(9)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	34	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	5 666	(4 034)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(959)	(1 446)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	5 288
Montant versé au rachat de parts rachetables	(4 949)	(459)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(5 908)	3 383
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(242)	(651)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	334	1 409
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	92	758
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	924	1 687
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS					
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS					
	80 000	407 International Inc., 1,8 %, 22 mai 2025	82 796	81 581	
	62 000	407 International Inc., 2,47 %, 8 septembre 2022	62 217	63 044	
	42 000	AIMCo Realty Investors L.P., série 1, 2,27 %, 26 juin 2024	42 017	43 255	
	84 000	Alimentation Couche-Tard inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	88 926	88 103	
	84 000	Alimentation Couche-Tard inc., série 3, 3,9 %, 1 ^{er} novembre 2022	87 812	87 453	
	84 000	Alimentation Couche-Tard inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	91 651	90 093	
	24 000	Allied Properties REIT, série C, 3,64 %, 21 avril 2025	25 883	25 572	
	72 000	Fonds de placement immobilier Allied, série H, 1,73 %, 12 février 2026	70 682	71 021	
	107 000	AltaGas Ltd., 1,23 %, 18 mars 2024	107 146	106 615	
	61 000	AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	62 484	62 051	
	141 000	AltaGas Ltd., 2,61 %, 16 décembre 2022	141 596	144 437	
	85 000	AltaGas Ltd., 3,57 %, 12 juin 2023	90 493	88 515	
	37 000	AltaGas Ltd., 3,84 %, 15 janvier 2025	39 925	39 687	
	40 000	AltaGas Ltd., 4,12 %, 7 avril 2026	43 879	43 742	
	61 000	AltaGas Ltd., 4,4 %, 15 mars 2024	66 226	65 518	
	34 000	AltaLink L.P., 2,75 %, 29 mai 2026	35 959	35 925	
	65 000	AltaLink L.P., 3,4 %, 6 juin 2024	69 318	69 133	
	257 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	266 613	267 926	
	55 000	ARC Resources Ltd., subalternes, 2,35 %, 10 mars 2026	55 121	55 436	
	76 000	Artis REIT, série D, 3,82 %, 18 septembre 2023	76 879	77 923	
	170 000	AT&T Inc., 2,85 %, 25 mai 2024	178 245	177 320	
	150 000	AT&T Inc., 4 %, 25 novembre 2025	168 434	164 435	
	55 000	Athene Global Funding, 2,1 %, 24 septembre 2025	55 083	55 705	
	100 000	Bank of America Corp., 3,41 %, 20 septembre 2025	103 707	106 188	
	123 000	Banque de Montréal, 1,55 %, 28 mai 2026	122 761	122 419	
	82 000	Banque de Montréal, 1,76 %, 10 mars 2026	82 494	82 524	
	151 000	Banque de Montréal, 2,08 %, 17 juin 2030	153 180	153 309	
	197 000	Banque de Montréal, 2,28 %, 29 juillet 2024	205 187	203 129	
	164 000	Banque de Montréal, 2,37 %, 17 janvier 2025	167 729	169 670	
	240 000	Banque de Montréal, 2,57 %, 1 ^{er} juin 2027	241 444	244 130	
	192 000	Banque de Montréal, 2,7 %, 11 septembre 2024	199 548	201 452	
	121 000	Banque de Montréal, 2,88 %, 17 septembre 2029	126 849	126 186	
	70 000	Banque de Montréal, 4,61 %, 10 septembre 2025	82 289	79 315	
	192 000	La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 février 2025	192 898	197 297	
	163 000	La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,29 %, 28 juin 2024	164 713	168 808	
	164 000	La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,49 %, 23 septembre 2024	164 986	170 199	
	181 000	La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,84 %, 3 juillet 2029	189 389	188 411	
	534 000	La Banque de Nouvelle-Écosse, 3,89 %, 18 janvier 2029	580 453	568 626	
	124 792	Bankers Hall L.P., 4,38 %, 20 novembre 2023	128 247	129 124	
	44 000	BCI QuadReal Realty, 1,07 %, 4 février 2026	42 911	43 067	
	55 000	BCI QuadReal Realty, série 1, 1,68 %, 3 mars 2025	56 390	55 702	
	305 000	Bell Canada, 2,7 %, 27 février 2024	318 078	315 900	
	70 000	Bell Canada, 2,75 %, 29 janvier 2025	74 650	72 916	
	232 000	Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	249 883	246 584	
	91 000	Bell Canada, 3,55 %, 2 mars 2026	98 384	97 838	
	169 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	185 572	180 652	
	282 000	Bell Canada, série M-26, 3,35 %, 22 mars 2023	289 147	291 812	
	22 000	BMW Canada Inc., série X, 0,99 %, 14 janvier 2025	22 066	21 728	
	69 000	Bow Centre Street L.P., série C, 3,8 %, 13 juin 2023	66 983	70 027	
	80 000	BP Capital Markets PLC, 3,47 %, 15 mai 2025	86 841	85 938	
	96 000	Brookfield Asset Management Inc., 4,82 %, 28 janvier 2026	109 198	108 206	
	214 000	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,32 %, 22 février 2024	226 838	224 744	
	61 000	Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 24 août 2025	63 338	63 179	
	169 000	Brookfield Property Finance ULC, 4,3 %, 1 ^{er} mars 2024	178 097	176 582	
	143 000	Brookfield Property Finance ULC, 4,35 %, 3 juillet 2023	148 806	148 801	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
50 000	Brookfield Renewable Partners ULC, 3,75 %, 2 juin 2025	54 485	53 781	
139 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,1 %, 19 janvier 2026	138 917	135 854	
884	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,64 %, 12 juillet 2021	859	884	
114 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,96 %, 21 avril 2031	114 416	114 095	
208 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2 %, 17 avril 2025	210 558	212 462	
121 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,01 %, 21 juillet 2030	121 990	122 283	
164 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,35 %, 28 août 2024	163 676	169 392	
183 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,95 %, 19 juin 2029	192 112	190 881	
192 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,3 %, 26 mai 2025	211 286	207 094	
423 000	Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,45 %, 4 avril 2028	436 498	440 526	
63 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,8 %, 22 septembre 2025	68 255	66 309	
153 000	Canadian Natural Resources Ltd., 1,45 %, 16 novembre 2023	154 004	153 913	
60 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,55 %, 3 juin 2024	63 965	63 490	
122 000	La Société Canadian Tire Limitée, série F, 3,17 %, 6 juillet 2023	128 649	126 853	
61 000	Canadian Utilities Ltd., 3,12 %, 9 novembre 2022	61 910	62 973	
52 000	Banque canadienne de l'Ouest, 1,93 %, 16 avril 2026	52 185	52 166	
100 000	Banque Canadienne de l'Ouest, 2,61 %, 30 janvier 2025	103 009	103 613	
55 000	Capital Power Corp., 4,28 %, 18 septembre 2024	59 967	59 481	
28 000	Capital Power Corp., 4,99 %, 23 janvier 2026	32 274	31 524	
90 000	Cenovus Energy Inc., 3,55 %, 12 mars 2025	94 427	95 171	
28 000	Central 1 Credit Union, 1,32 %, 29 janvier 2026	27 404	27 551	
71 000	Chartwell Retirement Residences, 3,79 %, 11 décembre 2023	74 620	74 125	
18 000	Chartwell Retirement Residences, série B, 4,21 %, 28 avril 2025	19 126	19 162	
34 000	CHIP Mortgage Trust, 1,74 %, 15 décembre 2045	34 284	33 773	
95 000	Propriétés de Choix L.P., série 10, 3,6 %, 20 septembre 2022	96 369	97 582	
57 000	FPI Propriétés de Choix, 4,29 %, 8 février 2024	61 586	61 003	
67 000	FPI Propriétés de Choix, série B, 4,9 %, 5 juillet 2023	73 386	71 440	
25 000	FPI Propriétés de Choix, série F, 4,06 %, 24 novembre 2025	27 752	27 238	
76 000	FPI Propriétés de Choix, série G, 3,2 %, 7 mars 2023	75 706	78 590	
42 000	FPI Propriétés de Choix, série J, 3,55 %, 10 janvier 2025	45 439	44 698	
69 000	FPI Propriétés de Choix, série K, 3,56 %, 9 septembre 2024	74 343	73 262	
43 000	CI Financial Corp., 3,22 %, 22 juillet 2024	44 663	44 852	
55 000	CI Financial Corp., 3,76 %, 26 mai 2025	58 288	58 640	
68 000	Citigroup Inc., 4,09 %, 9 juin 2025	74 422	73 984	
56 000	Coast Capital Savings Federal Credit Union, 5 %, 3 mai 2028	57 041	59 361	
71 000	Cogeco Communications inc., 4,18 %, 26 mai 2023	73 989	74 479	
49 000	FPI Crombie, série D, 4,07 %, 21 novembre 2022	49 675	50 898	
21 000	FPI Crombie, série E, 4,8 %, 31 janvier 2025	23 575	23 080	
49 000	FPI CT, série A, 2,85 %, 9 juin 2022	48 402	49 874	
24 000	FPI CT, série B, 3,53 %, 9 juin 2025	25 920	25 593	
60 000	Daimler Canada Finance Inc., 1,65 %, 22 septembre 2025	60 536	60 117	
150 000	Daimler Canada Finance Inc., 2,54 %, 21 août 2023	155 296	154 556	
74 000	Daimler Canada Finance Inc., 2,57 %, 22 novembre 2022	76 195	75 777	
18 000	Daimler Canada Finance Inc., 2,97 %, 13 mars 2024	19 133	18 814	
120 000	Daimler Canada Finance Inc., 3,3 %, 16 août 2022	124 818	123 446	
76 000	Dollarama Inc., 2,2 %, 10 novembre 2022	73 250	77 368	
184 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	198 111	193 882	
30 000	FPI industriel Dream, série A, 1,66 %, 22 décembre 2025	29 868	29 817	
141 000	Emera Inc., 2,9 %, 16 juin 2023	147 458	145 913	
63 000	Enbridge Gas Inc., 3,15 %, 22 août 2024	65 724	66 647	
45 000	Enbridge Gas Inc., 3,31 %, 11 septembre 2025	48 757	48 407	
66 000	Enbridge Inc., 2,44 %, 2 juin 2025	68 661	68 080	
205 000	Enbridge Inc., 3,19 %, 5 décembre 2022	206 663	211 583	
127 000	Enbridge Inc., 3,94 %, 30 juin 2023	136 378	133 234	
63 000	Enbridge Inc., 3,95 %, 19 novembre 2024	68 568	67 825	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
78 000	Enbridge Inc., série 10, 3,94 %, 13 janvier 2023	82 079	81 541	
46 000	Pipelines Enbridge Inc., 2,93 %, 30 novembre 2022	45 935	47 339	
72 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,45 %, 29 septembre 2025	78 336	77 316	
76 000	Pipelines Enbridge Inc., 3,79 %, 17 août 2023	81 493	79 911	
74 000	Equitable Bank, 1,77 %, 21 septembre 2023	75 057	74 674	
30 000	Equitable Bank, 1,88 %, 26 novembre 2025	29 763	29 676	
31 000	Banque Équitable, 1,94 %, 10 mars 2025	30 984	31 056	
67 000	Equitable Bank, 2,95 %, 26 septembre 2022	67 336	68 583	
21 000	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	23 474	23 263	
111 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,09 % 21 janvier 2026	110 842	108 428	
98 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec 1,99 % 28 mai 2031	98 178	97 870	
117 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,42 % 4 octobre 2024	119 284	121 155	
113 000	Fédération des caisses Desjardins du Québec 2,86 % 26 mai 2030	114 345	117 655	
76 000	First Capital Realty Inc., série P, 3,95 %, 5 décembre 2022	78 113	78 895	
36 000	First Capital Realty Inc., série R, 4,79 %, 30 août 2024	39 689	39 168	
36 000	First Capital Realty Inc., série S, 4,32 %, 31 juillet 2025	39 197	38 952	
38 000	First Capital Realty Inc., série T, 3,6 %, 6 mai 2026	40 169	39 948	
92 000	FPI First Capital, série Q, 3,9 %, 30 octobre 2023	97 953	96 818	
12 000	First National Financial Corp., série 2, 3,58 %, 25 novembre 2024	12 569	12 536	
24 000	First National Financial Corp., série 3, 2,96 %, 17 novembre 2025	24 288	24 472	
177 000	Fortis Inc., 2,85 %, 12 décembre 2023	187 236	184 321	
63 000	FortisAlberta Inc., 3,3 %, 30 septembre 2024	66 100	66 995	
16 000	FortisBC Energy Inc., 2,58 %, 8 avril 2026	16 806	16 729	
57 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 1,75 %, 15 avril 2026	56 216	56 384	
113 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 2,6 %, 1 ^{er} juin 2022	111 300	114 962	
113 000	Financière General Motors du Canada Ltée, 5,95 %, 14 mai 2024	127 902	127 103	
184 000	Financière General Motors du Canada Ltée, série 5, 3,25 %, 7 novembre 2023	193 579	192 464	
39 000	Gibson Energy Inc., 2,45 %, 14 juillet 2025	39 925	39 956	
82 000	Goldman Sachs Group Inc. (The), 3,31 %, 31 octobre 2025	86 454	86 846	
122 000	Société en commandite Holding FPI Granite, série 3, 3,87 %, 30 novembre 2023	131 955	129 409	
107 000	FPI H&R, 3,37 %, 30 janvier 2024	111 404	111 012	
78 000	FPI H&R, série O, 3,42 %, 23 janvier 2023	78 646	80 294	
50 000	FPI H&R, série Q, 4,07 %, 16 juin 2025	53 216	53 251	
61 000	Heathrow Funding Ltd., catégorie A-34, 3,25 %, 21 mai 2027	64 006	64 293	
55 000	Honda Canada Finance Inc., 1,34 %, 17 mars 2026	54 113	54 283	
55 000	Honda Canada Finance Inc., 2,5 %, 4 juin 2024	57 096	57 005	
55 000	Honda Canada Finance Inc., 3,44 %, 23 mai 2025	60 622	59 189	
123 000	Banque HSBC Canada, 1,78 %, 20 mai 2026	123 615	123 293	
42 000	Hydro One Inc., 1,76 %, 28 février 2025	42 989	42 753	
56 000	Hydro One Inc., 2,77 %, 24 février 2026	59 334	59 085	
36 000	Hydro One Inc., 2,97 %, 26 juin 2025	39 498	38 235	
63 000	Hyundai Capital Canada Inc., série A, 2,01 %, 12 mai 2026	63 324	63 176	
27 000	Intact Corporation financière, 3,77 %, 2 mars 2026	29 447	29 394	
131 000	Inter Pipeline Ltd., 2,61 %, 13 septembre 2023	134 626	134 680	
141 000	Inter Pipeline Ltd., 2,73 %, 18 avril 2024	146 266	145 685	
30 000	Inter Pipeline Ltd., 3,17 %, 24 mars 2025	31 487	31 492	
34 000	Ivanhoe Cambridge II Inc., série 2, 2,3 %, 12 décembre 2024	34 354	35 127	
31 000	John Deere Financial Inc., 1,63 %, 9 avril 2026	31 144	31 024	
63 000	John Deere Financial Inc., 2,41 %, 14 janvier 2025	66 839	65 357	
32 000	Banque Laurentienne du Canada, 1,15 %, 3 juin 2024	32 093	31 813	
85 000	Banque Laurentienne du Canada, 2,55 %, 20 juin 2022	85 721	86 565	
107 000	Banque Laurentienne du Canada, 3 %, 12 septembre 2022	106 683	109 849	
116 000	Banque Laurentienne du Canada, 3,45 %, 27 juin 2023	121 642	121 393	
245 000	Les Compagnies Loblaw Limitée, 4,86 %, 12 septembre 2023	270 710	263 013	
55 000	Banque Manuvie du Canada, 1,34 %, 26 février 2026	54 278	54 432	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
56 000	Banque Manuvie du Canada, 1,5 %, 25 juin 2025	57 082	56 248	
55 000	Banque Manuvie du Canada, 2,38 %, 19 novembre 2024	57 743	57 054	
113 000	Société Financière Manuvie, 2,24 %, 12 mai 2030	117 018	115 795	
77 000	Société Financière Manuvie, 3,05 %, 20 août 2029	79 313	80 841	
122 000	McDonald's Corp., 3,13 %, 4 mars 2025	130 297	129 483	
76 000	Metro inc., 2,68 %, 5 décembre 2022	76 265	77 846	
141 000	Molson Coors International L.P., 2,84 %, 15 juillet 2023	145 764	145 383	
73 000	Mondelēz International Inc., 3,25 %, 7 mars 2025	77 845	77 493	
75 000	Morguard Corp., série C, 4,33 %, 15 septembre 2022	75 399	75 959	
70 000	Morguard Corp., série G, 4,4 %, 28 septembre 2023	69 964	71 131	
122 000	National Australia Bank Ltd., 3,52 %, 12 juin 2030	128 371	128 072	
85 000	Banque Nationale du Canada, 1,57 %, 18 août 2026	85 782	85 139	
110 000	Banque Nationale du Canada, 2,55 %, 12 juillet 2024	111 295	114 244	
82 000	Banque Nationale du Canada, 2,58 %, 3 février 2025	86 956	85 450	
211 000	Banque Nationale du Canada, 3,18 %, 1 ^{er} février 2028	212 594	217 945	
33 000	NAV CANADA, série 21-1, subalternes, 0,94 %, 9 février 2026	32 154	32 214	
153 000	Nissan Canada Inc., 1,63 %, 18 mars 2024	153 106	152 576	
57 000	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co. Ltd., 3,2 %, 24 avril 2026	60 393	60 427	
35 000	OMERS Realty Corp., 3,33 %, 12 novembre 2024	37 724	37 439	
27 000	OMERS Realty Corp., série 10, 3,33 %, 5 juin 2025	29 022	28 964	
162 000	Ontario Electricity Financial Corp., 8,5 %, 26 mai 2025	218 287	206 732	
64 000	Ontario Electricity Financial Corp., série FV6, 8,9 %, 18 août 2022	75 571	70 103	
51 000	Ontario Power Generation Inc., 1,17 %, 22 avril 2026	50 221	50 123	
169 000	Pembina Pipeline Corp., 2,56 %, 1 ^{er} juin 2023	175 636	173 509	
135 000	Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janvier 2024	141 452	140 285	
122 000	Pembina Pipeline Corp., 3,77 %, 24 octobre 2022	125 908	126 436	
57 000	Pembina Pipeline Corp., série 5, 3,54 %, 3 février 2025	61 109	60 536	
106 000	Penske Truck Leasing Canada Inc., 2,85 %, 7 décembre 2022	104 843	108 627	
162 000	PSP Capital Inc., 1,73 %, 21 juin 2022	158 595	164 242	
85 000	PSP Capital Inc., série 7, 3,29 %, 4 avril 2024	90 351	90 809	
85 000	PSP Capital Inc., série 9, 2,09 %, 22 novembre 2023	84 781	87 863	
187 000	PSP Capital Inc., série 11, 3 %, 5 novembre 2025	206 899	201 490	
43 000	Reliance L.P., 3,75 %, 15 mars 2026	46 258	46 137	
49 000	Reliance L.P., 3,84 %, 15 mars 2025	52 884	52 572	
92 000	FPI RioCan, série AA, 3,21 %, 29 septembre 2023	95 604	95 629	
60 000	FPI RioCan, série AB, 2,58 %, 12 février 2025	61 572	61 636	
66 000	FPI RioCan, série T, 3,73 %, 18 avril 2023	67 594	68 923	
92 000	FPI RioCan, série W, 3,29 %, 12 février 2024	96 624	96 207	
92 000	FPI RioCan, série Y, 2,83 %, 3 octobre 2022	91 256	94 096	
169 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 6 juin 2022	176 457	173 983	
183 000	Rogers Communications Inc., 4 %, 13 mars 2024	196 236	194 743	
123 000	Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	123 059	122 696	
157 000	Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 ^{er} mai 2025	162 249	160 056	
140 000	Banque Royale du Canada, 2,09 %, 30 juin 2030	142 518	142 167	
208 000	Banque Royale du Canada, 2,35 %, 2 juillet 2024	211 132	214 928	
245 000	Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} novembre 2024	249 761	255 373	
166 000	Banque Royale du Canada, 2,74 %, 25 juillet 2029	166 343	172 376	
166 000	Banque Royale du Canada, 2,88 %, 23 décembre 2029	167 259	173 330	
90 000	Banque Royale du Canada, 4,93 %, 16 juillet 2025	107 311	102 982	
85 000	Saputo inc., 1,94 %, 13 juin 2022	85 837	85 920	
111 000	Saputo inc., 2,83 %, 21 novembre 2023	117 047	115 091	
46 000	Saputo inc., 2,88 %, 19 novembre 2024	48 448	48 123	
42 000	Saputo inc., 3,6 %, 14 août 2025	45 551	45 157	
205 000	Shaw Communications Inc., 3,8 %, 2 novembre 2023	221 687	216 580	
100 000	Shaw Communications Inc., 4,35 %, 31 janvier 2024	108 189	106 997	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS (suite)				
21 000	Sienna Senior Living Inc., série B, 3,45 %, 27 février 2026	21 643	21 959	
51 000	FPI SmartCentres, série I, 3,99 %, 30 mai 2023	54 146	53 652	
19 000	FPI SmartCentres, série N, 3,56 %, 6 février 2025	20 296	20 160	
42 000	FPI SmartCentres, série X, 1,74 %, 16 décembre 2025	41 671	41 453	
141 000	Sobeys Inc., 4,7 %, 8 août 2023	154 460	150 333	
30 000	Summit Industrial Income REIT, série A, 2,15 %, 17 septembre 2025	30 471	30 392	
23 000	Summit Industrial Income REIT, série B, 1,82 %, 1 ^{er} avril 2026	22 708	22 824	
101 000	Financière Sun Life inc., taux flottant, 13 août 2029	101 627	104 048	
61 000	Sysco Canada Inc., 3,65 %, 25 avril 2025	65 329	65 258	
555	Fiducie de capital TD IV, 6,63 %, 30 juin 2021	611	555	
310 000	TELUS Corp., 3,35 %, 1 ^{er} avril 2024	328 996	326 016	
130 000	TELUS Corp., 3,75 %, 17 janvier 2025	141 643	139 649	
73 000	TELUS Corp., 3,75 %, 10 mars 2026	79 446	79 157	
141 000	TELUS Corp., série CJ, 3,35 %, 15 mars 2023	143 803	145 854	
61 000	Teranet Holdings L.P., 3,65 %, 18 novembre 2022	60 970	63 052	
22 000	Teranet Holdings L.P., série 2020, 3,54 %, 11 juin 2025	23 512	23 383	
169 000	Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	175 537	173 478	
30 000	Groupe TMX Ltée, série D, 3 %, 11 décembre 2024	31 812	31 628	
20 000	Toronto Hydro Corp., série 8, 2,91 %, 10 avril 2023	20 640	20 652	
172 000	La Banque Toronto-Dominion, 1,13 %, 9 décembre 2025	172 817	168 997	
192 000	La Banque Toronto-Dominion, 1,94 %, 13 mars 2025	195 630	195 944	
197 000	La Banque Toronto-Dominion, 2,5 %, 2 décembre 2024	201 020	204 755	
325 000	La Banque Toronto-Dominion, 3,11 %, 22 avril 2030	334 871	342 519	
166 000	La Banque Toronto-Dominion, 3,22 %, 25 juillet 2029	171 948	174 863	
219 000	La Banque Toronto-Dominion, 3,23 %, 24 juillet 2024	232 721	233 104	
123 000	La Banque Toronto-Dominion, 4,86 %, 4 mars 2031	140 273	139 511	
44 000	Crédit Toyota Canada Inc., 1,18 %, 23 février 2026	43 049	43 258	
55 000	Toyota Crédit Canada Inc., 2,11 %, 26 février 2025	56 648	56 504	
110 000	Toyota Crédit Canada Inc., 2,31 %, 23 octobre 2024	114 239	113 696	
90 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,3 %, 17 juillet 2025	96 800	95 705	
211 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,69 %, 19 juillet 2023	224 939	220 801	
29 000	TransCanada PipeLines Ltd., 8,29 %, 5 février 2026	37 012	36 454	
28 000	TriSummit Utilities Inc., 3,15 %, 6 avril 2026	29 866	29 705	
23 000	Union Gas Ltd., 3,19 %, 17 septembre 2025	25 280	24 608	
15 000	Ventas Canada Finance Ltd., série B, 4,13 %, 30 septembre 2024	16 446	16 150	
84 000	Ventas Canada Finance Ltd., série D, 2,55 %, 15 mars 2023	83 233	85 970	
72 000	Ventas Canada Finance Ltd., série E, 2,8 %, 12 avril 2024	74 814	74 665	
187 000	Crédit VW Canada Inc., 1,2 %, 25 septembre 2023	187 134	187 318	
60 000	Crédit VW Canada Inc., 1,5 %, 23 septembre 2025	59 410	59 742	
89 000	Crédit VW Canada Inc., 2,85 %, 26 septembre 2024	91 154	93 090	
130 000	Walt Disney Co. (The), 2,76 %, 7 octobre 2024	133 949	136 237	
110 000	Wells Fargo & Co., 2,57 %, 1 ^{er} mai 2026	110 924	113 854	
98 000	Wells Fargo & Co., 2,98 %, 19 mai 2026	103 368	103 035	
110 000	Wells Fargo & Co., 3,87 %, 21 mai 2025	115 939	118 738	
76 000	Westcoast Energy Inc., 3,12 %, 5 décembre 2022	79 396	78 467	
65 000	Westcoast Energy Inc., 3,43 %, 12 septembre 2024	69 870	69 111	
39 000	Westcoast Energy Inc., 3,77 %, 8 décembre 2025	42 932	42 372	
		27 324 618	27 305 303	38,21
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES ET OBLIGATIONS GARANTIES				
516 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,75 %, 15 juin 2022	528 426	523 390	
1 349 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,8 %, 15 décembre 2024	1 363 287	1 390 893	
1 807 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,95 %, 15 décembre 2025	1 908 471	1 871 512	
445 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 juin 2023	451 132	460 927	
541 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 septembre 2023	568 460	562 178	
880 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,4 %, 15 décembre 2022	920 025	905 862	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS D'ÉTAT CANADIENNES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
723 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,55 %, 15 mars 2025	777 484	765 038	
2 200 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,9 %, 15 juin 2024	2 346 412	2 336 865	
197 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série 55, 3,15 %, 15 septembre 2023	208 442	208 123	
690 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série 70, 2,25 %, 15 décembre 2025	735 643	723 606	
1 637 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série MAR, 0,95 %, 15 juin 2025	1 658 721	1 633 061	
541 000	Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, série SEPT, 2,55 %, 15 décembre 2023	559 536	566 379	
71 000	Société canadienne des postes, série 2, 4,08 %, 16 juillet 2025	79 953	79 414	
85 000	Exportation et développement Canada, 1,65 %, 31 juillet 2024	84 584	87 224	
68 000	Exportation et développement Canada, 1,8 %, 1er septembre 2022	67 431	69 157	
1 016 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er août 2022	1 015 784	1 015 715	
1 253 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er novembre 2022	1 252 887	1 251 379	
1 084 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er février 2023	1 083 888	1 081 690	
1 016 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er mai 2023	1 014 697	1 012 349	
169 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er août 2023	168 512	168 122	
1 253 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er avril 2024	1 244 538	1 239 561	
956 000	Gouvernement du Canada, 0,25 %, 1er mars 2026	923 741	924 516	
1 335 000	Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1er septembre 2025	1 318 823	1 314 257	
854 000	Gouvernement du Canada, 1,00 %, 1er septembre 2022	853 212	860 893	
486 000	Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1er mars 2025	497 175	494 357	
481 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er juin 2023	497 446	490 660	
455 000	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 1er septembre 2024	470 075	466 476	
833 000	Gouvernement du Canada, 1,75 %, 1er mars 2023	863 139	851 620	
1 372 000	Gouvernement du Canada, 2 %, 1er septembre 2023	1 439 600	1 416 040	
406 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1er mars 2024	427 827	423 742	
368 000	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 1er juin 2025	391 879	388 674	
388 000	Gouvernement du Canada, 2,5 %, 1er juin 2024	412 803	408 805	
440 000	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 1er juin 2022	456 392	450 038	
78 000	Gouvernement du Canada, 8 %, 1er juin 2023	94 162	89 197	
65 000	Gouvernement du Canada, 9 %, 1er juin 2025	86 706	85 477	
82 000	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,05 %, 4 juin 2025	90 118	87 940	
		26 861 411	26 705 137	37,37
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES				
44 000	Hydro-Québec, série IC, 9,63 %, 15 juillet 2022	52 468	48 176	
42 000	Hydro Terre-Neuve-et-Labrador, série Y, 8,4 %, 27 février 2026	55 635	55 200	
35 000	OPB Finance Trust, série E, 2,95 %, 2 février 2026	37 505	37 455	
54 000	Province de l'Alberta, 1,6 %, 1er septembre 2022	54 542	54 810	
524 000	Province de l'Alberta, 2,35 %, 1er juin 2025	558 705	549 252	
103 000	Province de l'Alberta, 2,55 %, 15 décembre 2022	106 739	106 169	
62 000	Province de l'Alberta, 2,65 %, 1er septembre 2023	64 881	64 731	
316 000	Province de l'Alberta, 3,1 %, 1er juin 2024	335 945	336 653	
27 000	Province de l'Alberta, 3,4 %, 1er décembre 2023	29 023	28 764	
113 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,7 %, 18 décembre 2022	115 905	116 771	
532 000	Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	585 273	569 336	
192 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD, 3,3 %, 18 décembre 2023	205 294	204 503	
55 000	Province de la Colombie-Britannique, série BCCD-T, 9 %, 23 août 2024	73 500	68 854	
403 000	Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	433 245	423 926	
173 000	Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2023	175 686	179 597	
128 000	Province du Manitoba, 3,3 %, 2 juin 2024	138 512	137 106	
100 000	Province du Manitoba, 4,4 %, 5 septembre 2025	116 229	113 202	
43 000	Province du Manitoba, 7,75 %, 22 décembre 2025	57 477	55 132	
112 000	Province du Nouveau-Brunswick, 1,8 %, 14 août 2025	115 950	114 937	
81 000	Province du Nouveau-Brunswick, 2,85 %, 2 juin 2023	82 670	84 536	
121 000	Province du Nouveau-Brunswick, 3,65 %, 3 juin 2024	134 115	130 771	
145 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,3 %, 2 juin 2025	153 004	151 276	
63 000	Province de Terre-Neuve-et-Labrador, série 7B, 1,95 %, 2 juin 2022	64 604	63 946	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES (suite)				
50 000	Province de la Nouvelle-Écosse, série D8, 2,15 %, 1 ^{er} juin 2025	53 127	52 039	
1 367 000	Province de l'Ontario, 1,75 %, 8 septembre 2025	1 431 019	1 400 768	
88 000	Province de l'Ontario, 1,95 %, 27 janvier 2023	90 916	90 071	
360 000	Province de l'Ontario, 2,3 %, 8 septembre 2024	368 152	376 007	
46 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 8 septembre 2023	47 436	47 986	
1 788 000	Province de l'Ontario, 2,6 %, 2 juin 2025	1 938 200	1 890 864	
355 000	Province de l'Ontario, 2,65 %, 5 février 2025	379 762	375 960	
384 000	Province de l'Ontario, 2,85 %, 2 juin 2023	398 425	400 875	
587 000	Province de l'Ontario, 3,15 %, 2 juin 2022	616 897	602 404	
1 518 000	Province de l'Ontario, 3,5 %, 2 juin 2024	1 642 796	1 634 713	
54 000	Province de l'Ontario, 7,5 %, 7 février 2024	67 065	63 226	
49 000	Province de l'Ontario, 8,1 %, 8 septembre 2023	60 429	56 924	
142 000	Province de l'Ontario, 8,5 %, 2 décembre 2025	194 478	186 196	
59 000	Province de l'Ontario, 9,5 %, 13 juillet 2022	73 515	64 512	
70 000	Province de Québec, 2,45 %, 1 ^{er} mars 2023	73 339	72 340	
70 000	Province de Québec, 2,6 %, 6 juillet 2025	76 294	74 297	
1 080 000	Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} septembre 2025	1 184 565	1 152 562	
39 000	Province de Québec, 3 %, 1 ^{er} septembre 2023	40 837	41 029	
390 000	Province de Québec, 3,5 %, 1 ^{er} décembre 2022	416 855	406 987	
755 000	Province de Québec, 3,75 %, 1 ^{er} septembre 2024	828 515	823 319	
45 000	Province de Québec, 5,35 %, 1 ^{er} juin 2025	52 677	52 262	
57 000	Province de Québec, 8,5 %, 1 ^{er} avril 2026	76 300	75 758	
75 000	Province de Québec, 9,38 %, 16 janvier 2023	97 279	85 194	
28 000	Province de Québec, série NG, 9,5 %, 30 mars 2023	35 923	32 361	
350 000	Province de Québec, série QV, 2,25 %, 22 février 2024	365 950	364 396	
168 000	Province de la Saskatchewan, 0,8 %, 2 septembre 2025	166 588	165 701	
140 000	Province de la Saskatchewan, 3,2 %, 3 juin 2024	149 219	149 564	
		14 673 465	14 433 418	20,20
OBLIGATIONS MUNICIPALES				
62 000	Ville de Montréal, 3 %, 1 ^{er} septembre 2025	68 491	66 445	
63 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2023	65 141	66 854	
126 000	Ville de Montréal, 3,5 %, 1 ^{er} septembre 2024	134 700	135 912	
39 000	Ville de Toronto, 2,45 %, 6 février 2025	41 005	40 859	
45 000	Ville de Toronto, 3,4 %, 21 mai 2024	48 057	48 253	
24 000	Ville de Toronto, 3,9 %, 29 septembre 2023	25 736	25 721	
40 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 1 ^{er} décembre 2022	39 602	40 994	
155 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 3 juin 2024	157 628	160 923	
136 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,5 %, 19 avril 2026	143 630	143 609	
33 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,6 %, 23 avril 2023	33 293	34 230	
79 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,65 %, 2 octobre 2025	85 985	83 838	
43 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,95 %, 14 octobre 2024	45 293	45 808	
47 000	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,75 %, 26 septembre 2023	49 189	50 256	
43 000	Municipalité régionale de York, 2,6 %, 15 décembre 2025	46 819	45 516	
		984 569	989 218	1,38
OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES				
150 000	Banque interaméricaine de développement, 0,75 %, 15 octobre 2025	150 600	147 625	
150 000	Banque interaméricaine de développement, 1,7 %, 10 octobre 2024	151 495	153 744	
206 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,75 %, 2 juillet 2025	207 261	203 700	
248 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,8 %, 26 juillet 2024	249 907	255 185	
206 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,9 %, 16 janvier 2025	212 035	212 705	
80 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 2,25 %, 17 janvier 2023	80 169	82 223	
83 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 2,5 %, 3 août 2023	85 654	86 410	
211 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 0,63 %, 14 janvier 2026	210 537	206 106	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS (suite)				
	OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES (suite)			
183 000	International Finance Corp., 1,38 %, 13 septembre 2024	179 266	185 728	
79 000	International Finance Corp., 2,38 %, 19 juillet 2023	81 131	81 909	
		1 608 055	1 615 335	2,26
Total des obligations		71 452 118	71 048 411	99,41
Ajustement au titre des coûts de transaction		-		
Total des placements		71 452 118	71 048 411	99,41
Autres actifs (passifs) nets			420 627	0,59
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			71 469 038	100,00

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	-	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 550 000	2 100 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	550 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(850 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 450 000	1 800 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,180

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	12 360	-
Garanties (hors trésorerie)	12 998	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	2	-
Charges	(1)	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	40,5	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Obligations d'état canadiennes et obligations garanties	30,2
Obligations provinciales et obligations garanties	26,4
Services financiers	21,4
Énergie	3,9
Services de communication	3,7
Biens de consommation discrétionnaire	2,9
Immobilier	2,6
Services publics	2,3
Obligations étrangères	2,2
Biens de consommation de base	2,0
Produits industriels	0,9
Autres actifs (passifs) nets	0,8
Technologies de l'information	0,7
Total	100,0

Risque de crédit

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

au 30 juin 2021

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	42,5
AA/Aa/A+	7,8
A	22,6
BBB/Baa/B++	26,5
Total	99,4

au 31 décembre 2020

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AAA/Aaa/A++	36,5
AA/Aa/A+	10,7
A	28,4
BBB/Baa/B++	23,6
Total	99,2

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

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

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds n'investissait pas dans des actions et n'était donc pas assujéti à l'autre risque de prix.

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

Risque de change

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2021

	Moins de	1 an à 3	3 à 5	Plus	Total
	un an	ans	ans	de	
	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers
	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	2 316	31 711	32 623	4 398	71 048

au 31 décembre 2020

	Moins de	1 an à 3	3 à 5	Plus	Total
	un an	ans	ans	de	
	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers
	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	2 135	35 692	34 731	4 495	77 053

Au 30 juin 2021, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2020), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 556 000 \$ (592 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers
	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)
Obligations	-	71 048	-	71 048
Total	-	71 048	-	71 048

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers	(en milliers	(en milliers	(en milliers
	de dollars)	de dollars)	de dollars)	de dollars)
Obligations	-	77 053	-	77 053
Total	-	77 053	-	77 053

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	9 880	6 648
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	62	56
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	21	1
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	9 963	6 705
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	-
Frais de gestion à payer	4	3
Comptes créditeurs et charges à payer	23	48
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	27	51
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 936	6 654

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au	au	au	au	au	au
	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020	30 juin 2021	31 déc. 2020
Parts non couvertes	9 936	6 654	33,12	33,27	300 000	200 000

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	82	62
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(60)	(1)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	35	158
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	57	219
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(8)	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	6	-
Total des autres revenus	(2)	-
Total des revenus	55	219
Charges		
Frais de gestion (note 5)	23	8
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	34	-
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	7	2
Taxe de vente harmonisée	7	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	72	10
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17)	209

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts non couvertes	(17)	209	(0,06)	2,09	258 011	100 000

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	6 654	2 663
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17)	209
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	-	(37)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	(37)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	3 299	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	3 299	-
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 282	172
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	9 936	2 835

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(17)	209
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	60	1
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	34	-
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(35)	(158)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	809	63
Achat de placements et de dérivés	(4 099)	(98)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(20)	(9)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	1	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(25)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(3 292)	8
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	-	(28)
Produit de l'émission de parts rachetables	3 298	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	3 298	(28)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	6	(20)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	56	44
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	62	24
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	55	51
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	402	Baidu Inc., CAAE	90 596	101 501	
USD	591	NetEase Inc., CAAE	66 132	84 344	
HKD	9 000	Tencent Holdings Ltd.	770 320	838 093	
			927 048	1 023 938	10,31
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	2 717	Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	875 788	762 993	
HKD	2 000	ANTA Sports Products Ltd. Sports Products Ltd.	41 283	58 297	
CNY	1 200	BYD Co. Ltd.	27 072	57 723	
HKD	1 000	BYD Co. Ltd., catégorie H	19 289	37 025	
CNY	1 400	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd.	53 990	80 518	
HKD	9 000	Geely Automobile Holdings Ltd.	27 463	35 088	
CNY	1 400	Great Wall Motor Co. Ltd.	11 641	11 695	
HKD	4 500	Great Wall Motor Co. Ltd., catégorie H	16 913	18 010	
CNY	6 900	Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai	80 213	68 894	
HKD	2 000	Haidilao International Holding Ltd.	15 301	13 043	
CNY	5 800	Haier Smart Home Co., Ltd.	29 523	28 800	
HKD	3 200	Haier Smart Home Co., Ltd.	14 417	13 828	
HKD	550	JD Health International Inc.	9 497	9 761	
USD	1 323	JD.com Inc., CAAE	113 390	130 750	
HKD	6 200	Meituan, catégorie B	241 920	316 753	
CNY	7 015	Midea Group Co. Ltd.	102 807	95 949	
USD	2 006	NIO Inc., CAAE	117 236	132 150	
USD	518	Pinduoduo Inc., CAAE	58 651	81 476	
CNY	5 700	SAIC Motor Corp. Ltd.	23 511	24 000	
HKD	4 000	Xinyi Glass Holdings Co. Ltd.	16 690	20 187	
			1 896 595	1 996 940	20,10
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
HKD	3 000	China Feihe Ltd.	9 311	8 017	
HKD	4 000	Chine Mengniu Dairy Co. Ltd.	27 499	29 946	
HKD	2 000	China Resources Beer (Holdings) Co. Ltd.	20 280	22 244	
CNY	1 794	Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd.	37 395	44 334	
CNY	1 200	Guangdong Haid Group Co. Ltd.	12 949	18 766	
CNY	1 500	Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd.	12 082	9 141	
CNY	7 400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd.	52 427	52 231	
CNY	800	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd.	20 495	31 767	
CNY	800	Kweichow Moutai Co. Ltd.	260 467	315 324	
CNY	1 100	Luzhou Laojiao Co. Ltd.	31 163	49 738	
CNY	3 032	Muyuan Foodstuff Co. Ltd.	36 723	35 340	
HKD	2 400	Nongfu Spring Co. Ltd.	18 342	14 906	
CNY	400	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd.	16 127	34 343	
HKD	3 000	Smooere International Holdings Ltd.	30 479	20 594	
CNY	600	Tsingtao Brewery Co. Ltd.	7 825	13 298	
HKD	16 500	WH Group Ltd.	19 569	18 364	
CNY	2 600	Wuliangye Yibin Co. Ltd.	104 073	148 431	
CNY	500	Yihai Kerry Arawana Holdings Co. Ltd.	8 254	8 141	
			725 460	874 925	8,81
ÉNERGIE					
CNY	2 700	China Coal Energy Co. Ltd.	2 438	3 700	
CNY	19 500	China Petroleum & Chemical Corp.	16 915	16 294	
HKD	42 000	China Petroleum & Chemical Corp., catégorie H	28 196	26 319	
CNY	4 500	Chine Shenhua Energy Co. Ltd.	15 537	16 834	
HKD	6 000	Chine Shenhua Energy Co. Ltd.	14 865	14 561	
CNY	1 600	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd.	96 576	163 986	
CNY	1 800	EVE Energy Co. Ltd.	26 700	35 852	
CNY	23 700	PetroChina Co. Ltd.	21 840	24 027	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
ÉNERGIE (suite)					
HKD	36 000	PetroChina Co. Ltd., série H	18 198	21 699	
CNY	5 400	Shaanxi Coal Industry Co. Ltd.	12 234	12 263	
			253 499	335 535	3,38
SERVICES FINANCIERS					
CNY	75 200	Agricultural Bank of China Ltd.	48 510	43 667	
HKD	48 000	Agricultural Bank of China Ltd.	23 916	20 665	
CNY	37 500	Bank of China Ltd.	24 342	22 135	
HKD	114 000	Bank of China Ltd., catégorie H	54 267	50 716	
CNY	35 700	Bank of Communications Co. Ltd.	34 120	33 524	
HKD	32 000	Bank of Communications Co. Ltd., catégorie H	24 568	26 635	
CNY	5 100	China CITIC Bank Corp. Ltd.	5 407	4 985	
HKD	21 000	China Citic Bank, catégorie H	13 330	12 323	
CNY	11 400	China Construction Bank Corp.	15 120	14 529	
HKD	146 000	China Construction Bank Corp., catégorie H	147 160	142 243	
CNY	2 100	China Life Insurance Co. Ltd.	14 990	13 639	
HKD	12 000	China Life Insurance Co. Ltd., catégorie H	37 167	29 467	
CNY	19 800	China Merchants Bank Co. Ltd.	160 621	205 627	
HKD	6 000	China Merchants Bank Co. Ltd., catégorie H	46 257	63 383	
CNY	43 800	China Minsheng Banking Corp. Ltd.	46 995	37 018	
HKD	10 500	China Minsheng Banking Corp. Ltd., catégorie H	8 538	6 228	
CNY	5 100	China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd.	36 139	28 315	
HKD	4 800	China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd., catégorie H	22 876	18 714	
CNY	11 500	CITIC Securities Co. Ltd.	58 426	54 966	
HKD	3 500	CITIC Securities Co. Ltd., catégorie H	9 864	10 872	
CNY	11 500	East Money Information Co. Ltd.	67 332	72 266	
CNY	51 600	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	53 049	51 125	
HKD	110 000	Industrial & Commercial Bank of China, catégorie H	94 194	79 982	
CNY	23 000	Industrial Bank Co. Ltd.	87 844	90 581	
CNY	2 700	People's Insurance Co. (Group) of China Ltd.	3 516	3 068	
HKD	12 000	People's Insurance Co. (Group) of China Ltd.	5 335	4 956	
CNY	12 600	Ping An Bank Co. Ltd.	42 561	54 621	
CNY	13 700	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	214 703	168 769	
HKD	8 200	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	122 781	99 437	
CNY	14 900	Postal Savings Bank of China Co. Ltd.	14 771	14 335	
HKD	15 000	Postal Savings Bank of China Co. Ltd.	11 641	12 509	
CNY	23 400	Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd.	48 708	44 845	
			1 599 048	1 536 145	15,46
SOINS DE SANTÉ					
CNY	3 500	Aier Eye Hospital Group Co. Ltd.	34 491	47 610	
CNY	300	Asymchem Laboratories (Tianjin) Co. Ltd.	14 526	21 422	
CNY	130	Autobio Diagnostics Co. Ltd.	2 968	1 888	
USD	60	BeiGene Ltd., CAAE	21 483	25 498	
CNY	1 432	Beijing Tiantan Biological Products Corp. Ltd.	9 594	9 399	
CNY	1 200	Beijing Tongrentang Co. Ltd.	6 254	9 395	
CNY	100	BGI Genomics Co. Ltd.	2 490	2 273	
CNY	300	Changchun High & New Technology Industry (Group) Inc.	22 297	22 250	
CNY	700	Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd.	20 753	25 050	
HKD	13 040	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	21 355	23 371	
CNY	900	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	5 517	5 838	
CNY	300	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd.	6 408	9 186	
CNY	600	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd.	16 814	22 227	
HKD	100	Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd.	2 691	2 902	
HKD	2 000	Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.	12 815	10 843	
CNY	1 480	Huadong Medicine Co. Ltd.	8 431	13 050	
CNY	1 785	Hualan Biological Engineering Inc.	15 734	12 548	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SOINS DE SANTÉ (suite)					
CNY	1 800	Humanwell Healthcare (Group) Co. Ltd.	8 367	9 752	
CNY	100	IMEIK Technology Development Co. Ltd.	13 195	15 118	
HKD	1 500	Innovent Biologics Inc.	15 930	21 658	
CNY	300	INTCO Medical Technology Co. Ltd.	6 016	7 175	
CNY	400	Jafron Biomedical Co. Ltd.	5 670	6 620	
CNY	5 764	Jiangsu Hengrui Medicine Co. Ltd.	82 099	75 082	
CNY	1 200	Jointown Pharmaceutical Group Co. Ltd.	3 844	3 535	
CNY	1 800	Lepu Medical Technology (Beijing) Co. Ltd.	9 884	11 080	
CNY	890	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	6 884	8 532	
CNY	4 080	Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co. Ltd.	11 646	7 123	
HKD	1 000	MicroPort Scientific Corp.	7 906	11 106	
CNY	300	Nanjing King-friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd	2 481	2 400	
CNY	200	Pharmaron Beijing Co. Ltd.	6 164	8 317	
HKD	100	Pharmaron Beijing Co. Ltd.	1 956	3 301	
HKD	900	Ping An Healthcare and Technology Co. Ltd.	14 396	13 877	
HKD	4 000	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd.	11 924	11 557	
CNY	1 800	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co. Ltd.	14 146	24 882	
HKD	1 000	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co. Ltd.	5 137	9 998	
CNY	1 800	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co.	6 777	7 289	
HKD	1 500	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd.	3 541	4 057	
CNY	3 300	Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd.	5 002	4 737	
CNY	400	Shenzhen Kangtai Biological Products Co. Ltd.	12 099	11 422	
CNY	600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd.	43 699	55 199	
CNY	600	Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd.	3 469	3 783	
CNY	600	Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co. Ltd.	3 127	3 353	
CNY	1 200	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co. Ltd.	5 248	4 588	
HKD	18 000	Sino Biopharmaceutical Ltd.	24 545	21 871	
CNY	300	Topchoice Medical Investment Corp.	10 705	23 630	
CNY	2 200	Walvax Biotechnology Co. Ltd.	16 204	26 014	
CNY	2 016	WuXi AppTec Co. Ltd.	35 011	60 499	
HKD	479	WuXi AppTec Co. Ltd.	8 321	13 848	
HKD	4 900	WuXi Biologics (Cayman) Inc.	61 381	111 183	
CNY	700	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd.	14 370	15 524	
USD	90	Zai Lab Ltd., CAAE	12 174	19 725	
CNY	300	Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co. Ltd.	12 072	25 774	
CNY	1 800	Zhejiang NHU Co. Ltd.	9 059	9 893	
			739 070	938 252	9,44
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	45	51job Inc., CAAE	4 355	4 334	
CNY	900	AECC Aero-Engine Control Co. Ltd.	2 942	3 593	
CNY	1 500	AECC Aviation Power Co. Ltd.	10 702	15 290	
CNY	2 800	Air China Ltd.	4 388	4 175	
HKD	4 000	Air China Ltd., catégorie H	4 381	3 642	
CNY	2 100	AVIC Aircraft Co. Ltd.	8 748	10 576	
CNY	700	Avic Aviation High-Technology Co. Ltd.	3 489	4 129	
CNY	2 400	AVIC Electromechanical Systems Co. Ltd.	4 431	4 632	
CNY	600	AVIC Helicopter Co. Ltd.	5 752	6 064	
CNY	840	AVIC Shenyang Aircraft Co. Ltd.	5 827	9 707	
CNY	1 500	Beijing New Building Materials PLC	9 774	11 283	
CNY	4 200	Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd.	4 863	4 258	
CNY	1 900	Centre Testing International Group Co. Ltd.	9 707	11 608	
CNY	3 100	China Aerospace Times Electronics Technology Co. Ltd.	4 648	4 468	
CNY	900	China Avionics Systems Co. Ltd.	2 671	2 855	
CNY	3 740	China Baoan Group Co. Ltd.	5 421	13 095	
HKD	3 000	China Conch Venture Holdings Ltd.	17 612	15 642	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		PRODUITS INDUSTRIELS (suite)			
CNY	1 200	China CSSC Holdings Ltd.	4 259	3 797	
CNY	7 800	China Eastern Airlines Corp. Ltd.	8 134	7 594	
HKD	6 000	China Everbright Environment Group Ltd.	5 317	4 210	
CNY	4 200	China First Heavy Industries	2 379	2 729	
CNY	4 500	China Gezhouba Group Co. Ltd.	5 734	6 459	
CNY	2 020	China International Marine Containers (Groupe) Co Ltd	4 395	7 038	
HKD	1 000	China Lesso Group Holdings Ltd.	3 190	3 055	
CNY	10 400	China Railway Group Ltd/	10 543	10 444	
CNY	1 500	China Railway Hi-tech Industry Corp. Ltd.	2 830	2 328	
CNY	13 000	China Shipbuilding Industry Co. Ltd.	10 262	10 264	
CNY	6 000	China Southern Airlines Co. Ltd.	7 633	6 922	
HKD	6 000	China Southern Airlines Co. Ltd., catégorie H	5 128	4 611	
CNY	27 100	China State Construction Engineering Corp. Ltd.	25 324	24 150	
CNY	3 000	China XD Electric Co. Ltd.	2 502	2 369	
HKD	6 000	CITIC Ltd.	7 555	8 008	
CNY	4 500	CNPC Capital Co. Ltd.	5 894	5 192	
CNY	5 400	COSCO SHIPPING Development Co. Ltd.	2 576	3 881	
CNY	6 000	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd.	9 187	35 117	
HKD	4 500	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd., catégorie H	4 207	14 035	
HKD	4 000	COSCO SHIPPING Ports Ltd.	3 815	3 865	
CNY	600	CSSC Offshore & Marine Engineering (Group) Co. Ltd	3 615	2 392	
CNY	9 300	Daqin Railway Co. Ltd.	12 861	11 727	
CNY	1 800	Dongfang Electric Corp. Ltd.	3 854	3 784	
CNY	3 760	Fangda Carbon New Material Co. Ltd.	6 290	5 361	
CNY	1 200	Gotion High-tech Co. Ltd.	5 896	10 018	
HKD	2 000	Greentown Service Group Co. Ltd.	3 900	3 846	
CNY	200	Guangdong KinLong Hardware Products Co. Ltd.	5 610	7 438	
CNY	1 800	Guangzhou Baiyun International Airport Co. Ltd.	5 211	3 857	
CNY	900	Guosheng Financial Holding Inc.	1 699	1 965	
HKD	1 000	Haitian International Holdings Ltd.	3 911	4 154	
CNY	1 500	Han's Laser Technology Industry Group Co. Ltd.	10 997	11 611	
CNY	300	Hefei Meiya Optoelectronic Technology Inc.	2 837	3 206	
CNY	600	Hongfa Technology Co. Ltd.	4 978	7 210	
CNY	1 500	Infore Environment Technology Group Co. Ltd.	2 441	1 975	
CNY	1 200	Inner Mongolia First Machinery Group Co. Ltd.	2 495	2 327	
CNY	300	JA Solar Technology Co. Ltd.	1 885	2 817	
HKD	1 300	JD Logistics Inc.	8 749	8 768	
HKD	2 000	Jiangsu Expressway Co. Ltd., catégorie H	3 060	2 803	
CNY	448	Jiangsu Hengli Hydraulic Co. Ltd.	6 552	7 377	
CNY	3 600	Jiangsu Zhongtian Technology Co. Ltd.	7 066	6 899	
CNY	600	Jiangxi Hongdu Aviation Industry Co. Ltd.	4 386	4 425	
CNY	1 200	Juneyao Airlines Co. Ltd.	3 174	3 509	
CNY	7 800	Metallurgical Corp. of China Ltd.	4 353	4 455	
CNY	3 600	NARI Technology Co. Ltd.	13 752	16 034	
CNY	5 400	Ningbo Zhoushan Port Co. Ltd.	4 175	4 088	
CNY	10 500	Power Construction Corp. of China Ltd.	8 202	7 787	
CNY	2 200	S.F. Holding Co. Ltd.	33 736	28 543	
CNY	8 800	SANY Heavy Industry Co. Ltd.	44 471	49 026	
CNY	600	Shandong Himile Mechanical Science & Technology Co Ltd	2 887	3 070	
CNY	6 900	Shanghai Construction Group Co. Ltd.	4 246	3 650	
CNY	5 400	Shanghai Electric Group Co. Ltd.	5 422	4 388	
HKD	6 000	Shanghai Electric Group Co. Ltd.	2 543	1 980	
CNY	1 500	Shanghai International Airport Co. Ltd.	20 066	13 836	
CNY	10 500	Shanghai International Port (Group) Co. Ltd.	10 113	9 598	
CNY	600	Shanghai M&G Stationery Inc.	7 309	9 723	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
CNY	600	Shanghai Mechanical & Electrical Industry Co. Ltd.	2 052	1 868	
CNY	3 000	Shanghai Tunnel Engineering Co. Ltd.	3 297	3 041	
CNY	1 500	Shenzhen Airport Co. Ltd.	2 613	2 234	
CNY	2 250	Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd.	25 168	32 021	
HKD	1 500	Shenzhen International Holdings Ltd.	3 505	2 569	
CNY	2 264	Sinotrans Ltd.	1 843	2 191	
HKD	1 500	Sinotruk (Hong Kong) Ltd.	5 020	3 980	
HKD	1 000	SITC International Holdings Co. Ltd.	2 654	5 174	
CNY	600	Spring Airlines Co. Ltd.	5 722	6 543	
CNY	1 300	Sungrow Power Supply Co. Ltd.	16 235	28 666	
CNY	2 400	Suzhou Gold Mantis Construction Decoration Co. Ltd.	4 298	3 643	
CNY	5 100	TBEA Co. Ltd.	8 964	12 559	
CNY	1 200	Topsec Technologies Group Inc.	5 365	4 547	
CNY	6 900	Weichai Power Co. Ltd.	22 878	23 630	
HKD	3 000	Weichai Power Co. Ltd., catégorie H	8 973	8 257	
CNY	6 600	XCMG Construction Machinery Co. Ltd.	7 667	8 057	
CNY	2 700	Xiamen C & D Inc.	4 486	4 191	
CNY	3 900	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd.	9 049	9 089	
HKD	1 200	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd., catégorie H	2 108	2 323	
SGD	4 500	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	4 765	5 845	
CNY	420	Yantai Eddie Precision Machinery Co. Ltd.	3 529	3 451	
CNY	1 800	YTO Express Group Co. Ltd.	4 859	3 453	
CNY	1 919	Yunda Holding Co. Ltd.	7 288	4 976	
CNY	2 100	Yutong Bus Co. Ltd., catégorie A	6 211	5 027	
CNY	1 500	Zhejiang Chint Electrics Co. Ltd.	9 062	9 596	
CNY	300	Zhejiang Dingli Machinery Co. Ltd.	5 276	3 374	
CNY	2 545	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co. Ltd.	10 095	11 696	
CNY	600	Zhejiang Weiming Environmental Protection Co. Ltd.	2 574	2 625	
CNY	740	Zhejiang Weixing New Building Materials Co. Ltd.	2 427	2 931	
CNY	7 500	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co. Ltd.	13 237	13 281	
HKD	1 800	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	2 685	2 333	
USD	696	ZTO Express (Cayman) Inc., CAAE	25 861	26 157	
			753 083	828 394	8,34
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
CNY	2 700	360 Security Technology Inc.	8 808	6 318	
HKD	1 500	AAC Technologies Holdings Inc.	12 878	13 896	
CNY	1 800	Addsino Co. Ltd.	7 587	6 509	
CNY	1 800	Aisino Corp.	5 824	4 495	
CNY	300	Avary Holding (Shenzhen) Co. Ltd.	2 807	2 063	
CNY	760	AVIC Jonhon Optron Technology Co. Ltd.	7 126	11 509	
CNY	840	Beijing Shiji Information Technology Co. Ltd.	4 254	3 785	
CNY	300	Beijing Venustech Inc.	1 721	1 668	
CNY	200	Beijing Yuanliu Hongyuan Electronic Technology Co Ltd	4 418	4 903	
CNY	43 900	BOE Technology Group Co. Ltd.	44 833	52 498	
HKD	500	BYD Electronic (International) Co. Ltd.	3 541	4 066	
CNY	1 500	Chaozhou Three-Circle Group Co. Ltd.	10 320	12 194	
CNY	3 000	China Greatwall Technology Group Co. Ltd.	9 023	8 394	
CNY	600	China National Software & Service Co. Ltd.	8 016	6 546	
CNY	1 500	China TransInfo Technology Co. Ltd.	5 419	4 801	
USD	75	Daqo New Energy Corp., CAAE	5 652	6 039	
CNY	3 300	DHC Software Co. Ltd.	5 942	5 015	
CNY	900	Fiberhome Telecommunication Technologies Co. Ltd.	4 093	3 213	
CNY	400	Flat Glass Group Co. Ltd.	2 470	3 030	
CNY	2 700	Foxconn Industrial Internet Co. Ltd.	7 703	6 421	
USD	176	GDS Holdings Ltd., CAAE	18 144	17 106	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
CNY	576	GigaDevice Semiconductor (Beijing) Inc.	15 442	20 742	
CNY	1 200	Glodon Co. Ltd.	13 699	15 684	
CNY	3 300	Goertek Inc.	19 165	27 030	
CNY	2 700	Guangzhou Haige Communications Group Inc. Co.	5 512	4 895	
CNY	400	Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co. Ltd.	8 420	9 528	
CNY	360	Hangzhou First Applied Material Co. Ltd.	4 604	7 253	
CNY	1 500	Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd.	5 341	16 199	
CNY	2 100	Hengtong Optic-Electric Co. Ltd.	5 938	4 588	
CNY	1 168	Hundsun Technologies Inc.	20 141	20 873	
CNY	2 700	iFlytek Co. Ltd.	19 917	34 969	
CNY	100	Ingenic Semiconductor Co. Ltd.	1 814	1 934	
CNY	1 300	Inspur Electronic Information Industry Co. Ltd.	7 347	7 008	
CNY	1 500	JCET Group Co. Ltd.	9 074	10 832	
HKD	1 500	Kingboard Holdings Ltd.	7 210	10 309	
HKD	1 500	Kingboard Laminates Holding Ltd.	3 212	4 167	
HKD	3 000	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	9 701	12 605	
HKD	1 000	Kingsoft Corp. Ltd.	7 252	7 423	
HKD	8 000	Lenovo Group Ltd.	8 732	11 391	
CNY	1 900	Lens Technology Co. Ltd.	10 538	10 709	
CNY	2 400	Lingyi iTech (Guangdong) Co.	4 923	4 227	
CNY	5 460	LONGi Green Energy Technology Co. Ltd.	47 520	92 960	
CNY	5 996	Luxshare Precision Industry Co. Ltd.	53 114	52 859	
CNY	160	Maxscend Microelectronics Co. Ltd.	10 762	16 481	
CNY	300	NAURA Technology Group Co. Ltd.	7 585	15 947	
CNY	900	Ninestar Corp.	5 081	5 554	
CNY	3 300	OFILM Group Co. Ltd.	8 466	5 616	
CNY	3 600	Sanan Optoelectronics Co. Ltd.	15 826	22 112	
CNY	200	Sangfor Technologies Inc.	9 133	9 946	
CNY	100	SG Micro Corp.	3 828	4 843	
CNY	390	Shanghai Baosight Software Co. Ltd.	3 565	3 804	
USD	130	Shanghai Baosight Software Co. Ltd., catégorie B	445	530	
CNY	1 800	Shengyi Technology Co. Ltd.	7 870	8 075	
CNY	240	Shennan Circuits Co. Ltd.	5 499	5 111	
CNY	300	Shenzhen Goodix Technology Co. Ltd.	9 222	7 453	
CNY	1 200	Shenzhen Kaifa Technology Co. Ltd.	4 988	4 402	
CNY	300	Shenzhen Kinwong Electronic Co. Ltd.	1 859	1 506	
CNY	100	Shenzhen SC New Energy Technology Corp.	2 829	2 223	
CNY	1 000	Shenzhen Sunway Communication Co. Ltd.	6 881	5 918	
HKD	1 100	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	26 621	43 043	
CNY	1 300	Sunwoda Electronic Co. Ltd.	6 722	8 112	
CNY	1 800	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co. Ltd.	8 109	7 189	
CNY	300	Thunder Software Technology Co. Ltd.	6 271	9 030	
CNY	3 000	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Co. Ltd.	12 061	22 192	
CNY	1 500	Tianma Microelectronics Co. Ltd.	4 447	4 076	
CNY	3 300	Tianshui Huatian Technology Co. Ltd.	8 274	9 733	
CNY	900	TongFu Microelectronics Co. Ltd.	4 170	4 146	
CNY	600	Unigroup Guoxin Microelectronics Co. Ltd.	10 458	17 730	
CNY	2 216	Unisplendour Corp. Ltd.	11 063	9 292	
CNY	600	Universal Scientific Industrial (Shanghai) Co Ltd	2 722	1 933	
CNY	600	Venustech Group Inc.	4 019	3 336	
HKD	2 000	Weimob Inc.	5 840	5 460	
CNY	300	Will Semiconductor Ltd.	12 325	18 513	
CNY	700	Wingtech Technology Co. Ltd.	15 959	12 999	
CNY	840	Wuhan Guide Infrared Co. Ltd.	3 732	4 440	
CNY	1 800	WUS Printed Circuit (Kunshan) Co. Ltd.	6 710	5 337	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
CNY	1 120	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co. Ltd.	9 991	12 909	
HKD	19 200	Xiaomi Corp., catégorie B	88 815	82 661	
HKD	6 000	Xinyi Solar Holdings Ltd.	11 663	16 035	
CNY	400	Yealink Network Technology Corp. Ltd.	5 347	6 424	
CNY	3 214	Yonyou Network Technology Co. Ltd.	21 774	20 486	
CNY	2 700	Zhejiang Dahua Technology Co. Ltd.	10 661	10 918	
CNY	700	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd.	4 367	6 775	
CNY	300	Zhongji Innolight Co. Ltd.	2 785	2 215	
CNY	3 900	ZTE Corp.	24 684	24 837	
HKD	1 800	ZTE Corp.	6 414	6 960	
			909 038	1 068 956	10,76
MATÉRIAUX					
CNY	10 800	Aluminum Corporation of China Ltd.	7 522	10 970	
HKD	6 000	Aluminum Corporation of China Ltd., catégorie H	2 700	4 430	
CNY	3 140	Angang Steel Co. Ltd.	1 954	2 678	
CNY	3 100	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	32 328	24 388	
HKD	1 500	Anhui Conch Cement Co. Ltd., catégorie H	13 452	9 854	
CNY	13 800	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd.	17 262	20 205	
CNY	5 100	BBMG Corp.	3 163	2 629	
CNY	500	Beijing Easpring Material Technology Co. Ltd.	5 463	5 384	
CNY	2 400	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	16 078	25 444	
CNY	1 500	Chifeng Jilong Gold Mining Co. Ltd.	5 046	4 309	
HKD	1 500	China Hongqiao Group Ltd.	1 840	2 516	
CNY	3 771	Chine Jushi Co. Ltd.	10 140	11 209	
CNY	900	Chine Minmetals Rare Earth Co. Ltd.	2 745	3 329	
CNY	11 700	China Molybdenum Co. Ltd.	10 484	11 570	
HKD	9 000	China Molybdenum Co. Ltd., catégorie H	5 659	6 616	
HKD	6 000	China National Building Material Co. Ltd., catégorie H	9 858	8 725	
CNY	3 300	China Northern Rare Earth (Group) High-Tech Co. Ltd.	9 108	13 091	
HKD	6 000	China Resources Cement Holding Ltd.	9 804	7 061	
CNY	1 200	Citic Pacific Special Steel Group Co. Ltd.	4 772	4 793	
CNY	3 420	CSG Holding Co. Ltd.	3 855	6 712	
CNY	900	ENN Ecological Holdings Co. Ltd.	2 233	2 848	
CNY	1 200	Ganfeng Lithium Co. Ltd.	14 956	27 847	
CNY	6 000	GEM Co. Ltd.	7 283	10 751	
CNY	600	Guangdong Hongda Blasting Co. Ltd.	4 553	3 193	
CNY	510	Guangzhou Tinci Materials Technology Co. Ltd.	4 002	10 417	
CNY	600	Hangjin Technology Co. Ltd.	2 513	3 333	
CNY	1 800	Hangzhou Iron & Steel Co.	2 598	1 770	
CNY	600	Hangzhou Oxygen Plant Group Co. Ltd.	3 252	3 977	
CNY	2 700	Hengli Petrochemical Co. Ltd.	12 264	13 578	
CNY	2 590	Hengyi Petrochemical Co. Ltd.	6 475	5 931	
CNY	7 500	Hesteel Co. Ltd.	3 432	3 536	
CNY	1 500	Huafon Chemical Co. Ltd.	2 773	4 082	
CNY	1 120	Huaxin Cement Co. Ltd.	5 307	3 771	
CNY	2 540	Hunan Valin Steel Co. Ltd.	2 880	3 213	
CNY	33 300	Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co. Ltd.	9 191	9 892	
CNY	5 100	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Group Co Ltd	5 329	4 975	
CNY	1 200	Jiangsu Eastern Shenghong Co. Ltd.	1 999	4 806	
CNY	2 400	Jiangsu Shagang Co. Ltd.	5 460	5 018	
CNY	300	Jiangsu Yangnong Chemical Co. Ltd.	5 362	6 426	
CNY	100	Jiangsu Yoke Technology Co. Ltd.	1 163	1 552	
CNY	1 500	Jiangxi Copper Co. Ltd.	5 401	6 433	
HKD	3 000	Jiangxi Copper Co. Ltd., série H	6 052	7 606	
CNY	1 500	Jinduicheng Molybdenum Group Co. Ltd.	1 925	1 863	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		MATÉRIAUX (suite)			
CNY	3 000	Kingfa Sci. & Tech. Co. Ltd.	9 075	11 993	
CNY	900	Lianhe Chemical Technology Co. Ltd.	3 914	4 812	
CNY	1 500	Lomon Billions Group Co. Ltd.	7 295	9 941	
CNY	1 800	Luxi Chemical Group Co. Ltd.	4 023	6 461	
CNY	4 200	Maanshan Iron & Steel Co. Ltd.	2 365	3 453	
CNY	4 200	Nanjing Iron & Steel Co. Ltd.	2 754	2 865	
HKD	3 000	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	4 963	4 765	
CNY	1 680	Ningbo Shanshan Co. Ltd.	4 196	7 508	
CNY	900	Ningxia Baofeng Energy Group Co. Ltd.	2 209	2 360	
CNY	6 900	Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co. Ltd.	3 281	3 028	
CNY	3 600	Rongsheng Petrochemical Co. Ltd., catégorie A	9 434	11 915	
CNY	1 800	Sansteel Minguang Co. Ltd. Fujian	2 735	2 325	
CNY	2 250	Shandong Chenming Paper Holdings Ltd.	2 845	3 510	
CNY	2 284	Shandong Gold Mining Co. Ltd.	11 732	8 413	
HKD	750	Shandong Gold Mining Co. Ltd.	2 438	1 643	
CNY	2 340	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co. Ltd.	9 400	13 879	
CNY	9 900	Shandong Nanshan Aluminum Co. Ltd.	5 301	6 830	
CNY	1 000	Shandong Sinocera Functional Material Co. Ltd.	8 146	9 343	
CNY	2 100	Shandong Sun Paper Industry Joint Stock Co. Ltd.	5 357	5 373	
CNY	420	Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd.	6 132	10 995	
CNY	3 300	Shanxi Taigang Stainless Steel Co. Ltd.	2 615	4 737	
CNY	4 800	Shanying International Holdings Co. Ltd.	3 267	3 174	
CNY	1 500	Shenghe Resources Holding Co. Ltd.	3 213	4 990	
CNY	300	Shenzhen Capchem Technology Co. Ltd.	5 342	5 755	
CNY	300	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co. Ltd.	1 922	1 707	
CNY	4 200	Shenzhen Zhongjin Lingnan Nonfemet Co. Ltd.	3 557	3 638	
CNY	1 300	Sichuan Yahua Industrial Group Co. Ltd.	5 722	5 675	
CNY	900	Sinoma Science & Technology Co. Ltd.	3 852	4 514	
CNY	3 000	SINOPEC Shanghai Petrochemical Co. Ltd.	2 083	2 162	
CNY	100	Skshu Paint Co. Ltd.	3 260	3 373	
CNY	900	Tangshan Jidong Cement Co. Ltd.	2 772	2 130	
CNY	1 420	Tianqi Lithium Corp.	7 931	16 878	
CNY	1 800	Tongkun Group Co. Ltd.	5 963	8 310	
CNY	10 800	Tongling Nonferrous Metals Group Holding Co. Ltd.	5 167	5 630	
CNY	900	Transfar Zhilian Co. Ltd.	1 178	1 330	
CNY	2 100	Wanhua Chemical Group Co. Ltd.	33 080	43 795	
CNY	300	Weihai Guangwei Composites Co. Ltd.	4 344	4 367	
CNY	2 700	Western Mining Co. Ltd.	5 034	6 173	
CNY	1 200	Xiamen Tungsten Co. Ltd.	3 541	4 790	
CNY	1 200	Xinyangfeng Agricultural Technology Co. Ltd.	3 049	3 594	
CNY	2 400	Xinyu Iron & Steel Co. Ltd.	2 313	2 567	
CNY	2 100	Yintai Gold Co. Ltd.	3 961	3 827	
CNY	1 800	Yunnan Aluminium Co. Ltd.	2 530	4 105	
CNY	3 900	Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co. Ltd.	3 324	3 222	
CNY	1 500	Yunnan Copper Co. Ltd.	4 023	3 688	
CNY	400	Yunnan Energy New Material Co. Ltd.	7 984	17 946	
CNY	1 500	Yunnan Tin Co. Ltd.	3 191	4 608	
CNY	1 200	Zhejiang Hailiang Co. Ltd.	1 966	2 447	
CNY	1 060	Zhejiang Huayou Cobalt Co. Ltd.	12 246	23 199	
CNY	1 000	Zhejiang Juhua Co. Ltd.	1 479	1 694	
CNY	4 200	Zhejiang Longsheng Group Co. Ltd.	11 746	11 059	
CNY	840	Zhejiang Satellite Petrochemical Co. Ltd.	3 064	6 309	
CNY	3 000	Zhongjin Gold Corp. Ltd.	5 235	4 956	
CNY	2 400	Zhuzhou Kibing Group Co. Ltd.	5 588	8 537	
CNY	900	Zibo Qixiang Tengda Chemical Co. Ltd.	1 464	2 142	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX (suite)					
CNY	20 100	Zijin Mining Group Co. Ltd.	28 156	37 326	
HKD	10 000	Zijin Mining Group Co. Ltd.	11 067	16 647	
			613 460	755 144	7,60
IMMOBILIER					
HKD	4 000	Agile Group Holdings Ltd.	7 107	6 416	
HKD	250	A-Living Smart City Services Co. Ltd.	1 385	1 541	
HKD	3 000	China Evergrande Group	9 346	4 841	
CNY	4 800	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	14 580	10 073	
HKD	5 000	China Overseas Land & Investment Ltd.	15 146	14 064	
HKD	4 000	China Resources Land Ltd.	25 011	20 059	
HKD	800	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd.	6 039	6 780	
CNY	9 600	China Vanke Co. Ltd.	56 787	43 805	
HKD	2 700	China Vanke Co. Ltd.	13 455	10 462	
HKD	6 000	CIFI Holdings Group Co. Ltd.	6 643	5 798	
HKD	12 000	Country Garden Holdings Co.	21 316	16 647	
HKD	3 000	Country Garden Services Holdings Co. Ltd.	25 897	40 135	
HKD	1 800	ESR Cayman Ltd.	6 892	7 520	
CNY	6 300	Gemdale Corp.	16 846	12 363	
CNY	4 800	Greenland Holdings Corp. Ltd.	5 814	5 013	
HKD	900	Hopson Development Holdings Ltd.	4 915	5 109	
CNY	3 000	Jiangsu Zhongnan Construction Group Co. Ltd.	5 222	3 404	
CNY	5 400	Jinke Properties Group Co. Ltd.	8 420	5 992	
USD	245	KE Holdings Inc., CAAE	20 289	14 465	
HKD	3 000	Logan Property Holdings Co. Ltd.	6 254	5 559	
HKD	2 500	Longfor Group Holdings Ltd.	17 590	17 341	
CNY	12 000	Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.	36 396	27 689	
CNY	3 000	Risesun Real Estate Development Co. Ltd.	4 613	3 243	
CNY	1 500	Seazen Holdings Co. Ltd.	11 476	11 959	
CNY	720	Shanghai Lingang Holdings Co. Ltd.	2 522	2 470	
CNY	1 060	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd	2 465	2 706	
HKD	1 500	Shimao Group Holdings Ltd.	7 309	4 554	
HKD	3 000	Sunac China Holdings Ltd.	18 431	12 748	
HKD	1 000	Sunac Services Holdings Ltd.	4 024	4 600	
CNY	4 040	Youngor Group Co. Ltd.	5 764	5 102	
CNY	3 900	Zhejiang China Commodities City Group Co. Ltd.	3 656	3 849	
			391 610	336 307	3,38
SERVICES PUBLICS					
HKD	1 000	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	4 737	4 393	
HKD	12 000	Beijing Enterprises Water Group Ltd.	6 537	5 626	
CNY	2 800	Beijing OriginWater Technology Co. Ltd.	4 348	3 923	
HKD	3 600	China Gas Holdings Ltd.	16 285	13 605	
CNY	7 600	China National Nuclear Power Co. Ltd.	7 308	7 370	
HKD	2 000	China Resources Gas Group Ltd.	16 190	14 861	
HKD	4 000	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	6 288	6 761	
CNY	14 100	China Yangtze Power Co. Ltd.	51 963	55 773	
CNY	17 400	GD Power Development Co. Ltd.	7 341	8 103	
HKD	6 000	Guangdong Investment Ltd.	14 224	10 677	
CNY	2 400	Guangxi Guiguan Electric Power Co. Ltd.	2 343	2 856	
CNY	5 400	Huadian Power International Co. Ltd.	3 689	3 560	
CNY	3 000	Huaneng Lancang River Hydropower Inc.	2 661	3 329	
CNY	7 200	Huaneng Power International Inc.	7 101	5 823	
HKD	6 000	Huaneng Power International Inc., série H	3 156	2 908	
CNY	3 300	Hubei Energy Group Co. Ltd.	2 493	2 903	
HKD	6 000	Kunlun Energy Co. Ltd.	6 118	6 850	
CNY	4 200	SDIC Power Holdings Co. Ltd.	7 468	7 735	

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		SERVICES PUBLICS (suite)			
CNY	3 300	Shenergy Co. Ltd.	3 574	3 883	
CNY	2 240	Shenzhen Energy Group Co. Ltd.	2 841	3 936	
CNY	2 700	Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd.	5 446	6 380	
CNY	6 000	Zhejiang Zheneng Electric Power Co. Ltd.	4 389	4 220	
			186 500	185 475	1,87
Total des actions			8 994 411	9 880 011	99,45
Ajustement au titre des coûts de transaction			(10 214)		
Total des placements			8 984 197	9 880 011	99,45
Autres actifs (passifs) nets				55 913	0,55
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				9 935 924	100,00

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	6	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	200 000	100 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	300 000	100 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,550

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	79	-
Garanties (hors trésorerie)	88	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Biens de consommation discrétionnaire	20,5
Services financiers	16,1
Services de communication	11,0
Technologies de l'information	10,7
Produits industriels	9,2
Biens de consommation de base	8,8
Soins de santé	8,4
Matériaux	7,0
Immobilier	3,7
Énergie	2,7
Services publics	1,8
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions chinoises et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale en Chine.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	975 145

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	657 829

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Renminbi chinois	5 521	-	5 521	55,5
Dollar de Hong Kong	3 026	-	3 026	30,4
Dollar américain	1 407	-	1 407	14,2
Dollar de Singapour	6	-	6	0,1
Total	9 960	-	9 960	100,2

au 31 décembre 2020~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Renminbi chinois	3 640	-	3 640	54,7
Dollar de Hong Kong	1 981	-	1 981	29,8
Dollar américain	1 038	-	1 038	15,6
Dollar de Singapour	3	-	3	0,0
Total	6 662	-	6 662	100,1

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 996 000 \$ (666 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	9 880	-	-	9 880
Total	9 880	-	-	9 880

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	5 612	1 035	-	6 647
Total	5 612	1 035	-	6 647

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	84 495	86 429
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	67	269
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	8	9
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	-	113
Intérêts à recevoir	364	216
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	38
	84 934	87 074
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	462
Frais de gestion à payer	38	21
Comptes créditeurs et charges à payer	4	5
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	42	488
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	84 892	86 586

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	FNB parts	84 892	86 586	51,45	52,48	1 650 000

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	-	893
Intérêts aux fins des distributions	521	395
Distributions de revenu provenant des placements	559	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	513	485
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(2 242)	1 240
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	(649)	3 013
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	-	-
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	52	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	4	-
Total des autres revenus	56	-
Total des revenus	(593)	3 013
Charges		
Frais de gestion (note 5)	239	258
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	2
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	20	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	264	261
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(2)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(857)	2 754

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
FNB parts	(857)	2 754	(0,51)	1,61	1 686 188	1 708 791

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	FNB parts	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	86 586	92 438
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(857)	2 754
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(839)	(1 020)
Profits nets réalisés	(14)	-
Remboursement de capital	(6)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(859)	(1 020)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	5 182	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(5 160)	(10 190)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	22	(10 190)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(1 694)	(8 456)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	84 892	83 982

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(857)	2 754
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(513)	(485)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	4	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	2 242	(1 240)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	22 341	71 415
Achat de placements et de dérivés	(21 882)	(73 291)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	113	(6)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	(148)	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	17	(21)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	-	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	1 317	(873)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 321)	(1 134)
Produit de l'émission de parts rachetables	228	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(426)	(1)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(1 519)	(1 135)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(202)	(2 008)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	269	2 769
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	67	761
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	672	952
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	374	330
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
OBLIGATIONS				
SERVICES DE COMMUNICATION				
810 000	Bell Canada, 4,7 %, 11 septembre 2023	856 577	865 849	
872 000	Bell Canada, série M-26, 3,35 %, 22 mars 2023	875 124	902 341	
1 223 000	TELUS Corp., 2,35 %, 28 mars 2022	1 195 832	1 237 314	
264 000	TELUS Corp., série CJ, 3,35 %, 15 mars 2023	264 743	273 088	
		3 192 276	3 278 592	3,86
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE				
3 000 000	Dollarama Inc., 3,55 %, 6 novembre 2023	3 164 430	3 161 118	
2 060 000	Crédit VW Canada Inc., 2,65 %, 27 juin 2022	2 089 631	2 099 880	
		5 254 061	5 260 998	6,20
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE				
690 000	Alimentation Couche-Tard inc., 3,06 %, 26 juillet 2024	675 730	723 700	
1 285 000	Alimentation Couche-Tard inc., série 5, 3,6 %, 2 juin 2025	1 303 909	1 378 206	
3 000 000	Les Compagnies Loblaw Limitée, 4,86 %, 12 septembre 2023	3 226 920	3 220 570	
1 031 000	PepsiCo Inc., 2,15 %, 6 mai 2024	1 049 104	1 059 986	
		6 255 663	6 382 462	7,52
ÉNERGIE				
1 031 000	Canadian Natural Resources Ltd., 3,31 %, 11 février 2022	1 056 770	1 046 862	
102 000	Enbridge Inc., 3,19 %, 5 décembre 2022	102 265	105 275	
35 000	Enbridge Inc., 3,94 %, 30 juin 2023	35 833	36 718	
1 545 000	Pembina Pipeline Corp., 3,71 %, 11 août 2026	1 706 696	1 662 740	
1 945 000	TransCanada Pipelines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	2 118 573	2 071 970	
1 694 000	TransCanada PipeLines Ltd., 3,65 %, 15 novembre 2021	1 726 445	1 713 106	
		6 746 582	6 636 671	7,82
SERVICES FINANCIERS				
2 500 000	Bank of America Corp., 3,3 %, 24 avril 2024	2 631 750	2 605 548	
736 000	Société de financement GE Capital Canada, 4,6 %, 26 janvier 2022	753 283	752 567	
521 000	Wells Fargo Financial Canada Corp., 3,46 %, 24 janvier 2023	528 156	542 469	
		3 913 189	3 900 584	4,60
PRODUITS INDUSTRIELS				
3 000 000	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,8 %, 22 septembre 2025	3 168 330	3 157 563	
211 000	Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 3,04 %, 21 septembre 2022	214 120	215 967	
1 032 000	Industries Toromont Limitée, 3,84 %, 27 octobre 2027	1 047 123	1 124 424	
		4 429 573	4 497 954	5,30
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION				
2 428 000	Apple Inc., 2,51 %, 19 août 2024	2 553 026	2 531 222	2,98
MATÉRIAUX				
892 000	CCL Industries Inc., série 1, 3,86 %, 13 avril 2028	940 380	970 106	1,14
SERVICES PUBLICS				
2 000 000	AltaGas Ltd., 3,84 %, 15 janvier 2025	2 148 200	2 145 247	
2 010 000	AltaGas Ltd., 3,98 %, 4 octobre 2027	2 143 651	2 199 775	
3 458 000	Capital Power Corp., 4,28 %, 18 septembre 2024	3 739 454	3 739 763	
		8 031 305	8 084 785	9,52
OBLIGATIONS PROVINCIALES ET OBLIGATIONS GARANTIES				
135 000	Province de l'Alberta, 2,9 %, 20 septembre 2029	132 909	145 604	0,17
Total des obligations		41 448 964	41 688 978	49,11

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE				
74 373	FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	3 628 102	3 737 243	
792 955	FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	38 425 592	39 068 893	
Total du (des) fonds négocié(s) en bourse		42 053 694	42 806 136	50,42
Ajustement au titre des coûts de transaction		(630)		
Total des placements		83 502 028	84 495 114	99,53
Autres actifs (passifs) nets			397 146	0,47
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables			84 892 260	100,00

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2021

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	71 469	39 069	54,7
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	101 340	3 737	3,7

au 31 décembre 2020

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	77 680	56 182	72,3
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	143 827	3 949	2,7

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	4	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	FNB parts	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 650 000	1 800 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(200 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 650 000	1 600 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
FNB parts	0,550

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	688	-
Garanties (hors trésorerie)	727	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

Participations dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2021
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	3 737
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	39 069

Placements	2020
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	54 495
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	3 812

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

FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Fonds négocié(s) en bourse	69,2
Services financiers	7,6
Énergie	5,4
Services publics	4,0
Services de communication	3,9
Biens de consommation de base	3,7
Biens de consommation discrétionnaire	2,5
Produits industriels	1,6
Matériaux	1,2
Obligations provinciales et obligations garanties	0,7
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Total	100,0

Risque de crédit

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

au 30 juin 2021

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	3,0
A	8,4
BBB/Baa/B++	37,7
Total	49,1

au 31 décembre 2020

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	0,4
A	5,8
BBB/Baa/B++	24,2
Total	30,4

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

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

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était exposé à l'autre risque de prix puisque certains de ses actifs étaient investis dans un Fonds négocié en bourse.

Au 30 juin 2021, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 4 281 000 \$ (6 013 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

Risque de change

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, les placements du Fonds étaient principalement libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, l'exposition du Fonds au risque de change était peu importante.

Risque de taux d'intérêt

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

au 30 juin 2021

	Moins de un an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	6 850	12 989	13 676	8 174	41 689

au 31 décembre 2020

	Moins de un an (en milliers de dollars)	1 an à 3 ans (en milliers de dollars)	3 à 5 ans (en milliers de dollars)	Plus de 5 ans (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Exposition aux taux d'intérêt	3 940	11 351	4 371	6 636	26 298

Au 30 juin 2021, si le taux d'intérêt en vigueur avait augmenté ou diminué de 0,25 % (0,25 % au 31 décembre 2020), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 313 000 \$ (191 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	41 689	-	41 689
Fonds négocié(s) en bourse	42 806	-	-	42 806
Total	42 806	41 689	-	84 495

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Obligations	-	26 298	-	26 298
Fonds négocié(s) en bourse	60 131	-	-	60 131
Total	60 131	26 298	-	86 429

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	51 883	43 966
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	719	722
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	14
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	4	4
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	30	56
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	52 636	44 762
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	37	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	284
Frais de gestion à payer	37	16
Comptes créditeurs et charges à payer	4	5
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	78	305
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	52 558	44 457

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	FNB parts	52 558	44 457	32,85	28,68	1 600 000

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	401	451
Intérêts aux fins des distributions	86	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 213	(496)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	5 478	(3 916)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	7 178	(3 961)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(7)	72
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	26	-
Rabais sur frais	26	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	2	-
Total des autres revenus	47	72
Total des revenus	7 225	(3 889)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	214	180
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	25	24
Taxe de vente harmonisée	17	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	260	206
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(1)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 965	(4 094)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
FNB parts	6 965	(4 094)	4,28	(2,51)	1 627 901	1 632 967

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	FNB parts	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	44 457	45 947
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 965	(4 094)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(207)	(182)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(207)	(182)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	2 976	1 226
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 633)	(2 470)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	1 343	(1 244)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	8 101	(5 520)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	52 558	40 427

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 965	(4 094)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 213)	496
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	2	(9)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	3	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(5 478)	3 916
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 505	8 178
Achat de placements et de dérivés	(2 352)	(8 477)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	26	32
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	21	(16)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(1)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	478	27
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(491)	(321)
Produit de l'émission de parts rachetables	44	16
Montant versé au rachat de parts rachetables	(32)	(2)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(479)	(307)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(2)	9
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(1)	(280)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	722	778
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	719	507
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	402	458
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	86	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
BRÉSIL					
USD	5 700	PagSeguro Digital Ltd.	212 446	395 115	0,75
CANADA					
	10 397	Alimentation Couche-Tard inc., catégorie B	333 373	473 583	
	9 257	BCE Inc.	535 864	565 880	
	16 485	Canada Goose Holdings Inc.	533 105	893 157	
	5 511	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	551 665	720 784	
	21 814	Canadian Natural Resources Ltd.	804 006	981 630	
	2 829	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	418 122	554 937	
	5 484	CCL Industries Inc., catégorie B	297 017	374 393	
	4 394	CGI inc.	379 092	493 842	
	6 853	Emera Inc.	329 142	385 413	
	11 026	Enbridge Inc.	443 646	547 220	
	6 907	Fortis Inc.	306 624	378 987	
	10 517	Les Compagnies Loblaw Limitée	591 445	802 342	
	28 831	Société Financière Manuvie	670 916	703 476	
	7 711	Banque Royale du Canada	721 331	968 424	
	11 905	Financière Sun Life inc.	583 596	760 968	
	33 132	Suncor Énergie Inc.	1 088 444	983 690	
	24 140	Ressources Teck Limitée, catégorie B	586 558	689 197	
	11 831	TELUS Corp.	267 375	328 902	
	5 289	Industries Toromont Limitée	274 153	571 212	
	10 453	La Banque Toronto-Dominion	790 389	908 052	
	18 648	Transcontinental inc., catégorie A	273 237	434 125	
	7 894	West Fraser Timber Co. Ltd.	497 650	702 487	
			11 276 750	14 222 701	27,06
CHINE					
USD	741	Alibaba Group Holding Ltd., CAAE	177 883	208 307	0,40
ALLEMAGNE					
USD	1 599	SAP SE, CAAE	228 903	278 409	0,53
PAYS-BAS					
USD	4 039	Koninklijke Philips NV, CAAE	203 002	248 835	0,47
SUISSE					
USD	5 109	Roche Holding AG, CAAE	202 225	297 593	0,57
R.-U.					
USD	4 532	BAE Systems PLC, CAAE	185 519	164 435	
USD	4 356	BP PLC, CAAE	197 904	142 660	
USD	2 700	Unilever PLC, CAAE	190 029	195 795	
			573 452	502 890	0,96
É.-U.					
USD	5 263	Aflac Inc.	269 492	350 079	
USD	262	Alphabet Inc., catégorie C	352 542	813 991	
USD	1 503	Amgen Inc.	364 866	454 135	
USD	3 813	Apple Inc.	222 617	647 354	
USD	10 547	Bank of America Corp.	358 278	539 044	
USD	1 250	Boeing Co. (The)	221 394	371 198	
USD	1 305	CIGNA Corp.	283 498	383 503	
USD	5 468	Cisco Systems Inc.	255 856	359 241	
USD	3 935	Citigroup Inc.	344 144	345 106	
USD	6 493	DuPont de Nemours Inc.	612 641	623 052	
USD	1 768	Facebook Inc., catégorie A	400 484	762 046	
USD	1 061	Home Depot Inc. (The)	235 300	419 409	
USD	4 166	Intel Corp.	217 729	289 917	
USD	2 573	Johnson & Johnson	440 721	525 437	
USD	2 765	Microsoft Corp.	318 870	928 508	
USD	1 033	NVIDIA Corp.	244 814	1 024 533	

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		É.-U. (suite)			
USD	4 756	Pfizer Inc.	212 415	230 869	
USD	2 925	Procter & Gamble Co. (The)	344 632	489 233	
USD	718	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	339 134	497 119	
USD	4 217	RPM International Inc.	301 532	463 565	
USD	1 960	Target Corp.	195 314	587 335	
USD	616	Visa Inc., catégorie A	146 081	178 543	
Total des actions			6 682 354	11 283 217	21,47
FONDS NÉGOCIÉ(S) EN BOURSE					
	235 855	FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	5 682 035	7 542 643	
	64 321	FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	1 575 312	1 873 671	
USD	24 066	iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	1 560 034	1 998 461	
USD	27 152	iShares Global REIT ETF	869 255	932 989	
USD	37 225	iShares MSCI EAFE Small-Cap ETF	3 123 655	3 422 048	
USD	3 546	iShares Russell 2000 Growth ETF	817 935	1 370 071	
USD	8 083	iShares Russell 2000 Value Index Fund	1 212 455	1 660 963	
USD	10 956	iShares Russell Microcap Index Fund	1 273 854	2 072 468	
	17 088	iShares S&P/TSX Capped REIT Index ETF	280 809	328 090	
	104 939	iShares S&P/TSX Completion Index Fund	2 623 335	3 244 714	
Total du (des) fonds négocié(s) en bourse			19 018 679	24 446 118	46,51
Ajustement au titre des coûts de transaction			(11 359)		
Total des placements			38 564 335	51 883 185	98,72
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(36 617)	(0,07)
Autres actifs (passifs) nets				711 253	1,35
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				52 557 821	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Nationale du Canada, Toronto	A-1	19 juillet 2021	CAD	6 800 000	USD	5 515 138	1,23	(36 617)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(36 617)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(37)	-	-	(37)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(37)	-	-	(37)

au 31 décembre 2020

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

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2021

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	36 322	7 543	20,8
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	35 820	1 874	5,2
iShares S&P/TSX Completion Index Fund	176 244	3 245	1,8
iShares Russell Microcap Index Fund	1 683 550	2 072	0,1
iShares Global REIT ETF	4 032 347	933	-
iShares MSCI EAFE Small-Cap FNB	17 025 202	3 422	-
iShares S&P/TSX Capped FPI Index FNB	1 382 400	328	-
iShares Russell 2000 Growth FNB	15 377 563	1 370	-
iShares Russell 2000 Value Index Fund	20 723 514	1 661	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	103 634 923	1 998	-

au 31 décembre 2020

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	79 585	6 567	8,3
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	19 780	1 528	7,7
iShares S&P/TSX Completion Index Fund	153 230	2 832	1,8
iShares Russell Microcap Index Fund	1 261 097	2 126	0,2
SPDR Dow Jones International Real Estate FNB	1 173 151	309	-
iShares MSCI EAFE Small-Cap FNB	14 251 045	2 549	-
iShares Cohen & Steers FPI FNB	2 496 452	480	-
iShares S&P/TSX Capped FPI Index FNB	1 142 577	198	-
iShares Russell 2000 Growth FNB	14 999 052	1 823	-
iShares Russell 2000 Value Index Fund	14 976 019	1 313	-
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	87 373 200	1 841	-

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	1	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	FNB parts	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 550 000	1 700 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	100 000	50 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	(100 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 600 000	1 650 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
FNB parts	0,850

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	5 595	-
Garanties (hors trésorerie)	5 950	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	45	-
Charges	(19)	-
Revenu tiré des prêts de titres	26	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	42,3	-

Participations dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2021
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	7 543
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	1 874

Placements	2020
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	6 186
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	1 323

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

FNB d'actions mondiales ONE CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
É.-U.	47,6
Canada	47,1
Autres actifs (passifs) nets	1,1
R.-U.	1,0
Brésil	0,9
Allemagne	0,6
Pays-Bas	0,6
Suisse	0,6
Chine	0,5
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

Au 30 juin 2021, si la juste valeur des actions du portefeuille de placements avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020), toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait augmenté ou diminué, respectivement, d'environ 5 188 000 \$ (4 361 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	25 427	(6 837)	18 590	35,4
Total	25 427	(6 837)	18 590	35,4

au 31 décembre 2020~

Devise	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	22 189	(9 086)	13 103	29,5
Total	22 189	(9 086)	13 103	29,5

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

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

Risque de change (suite)

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 859 000 \$ (1 310 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	27 437	-	-	27 437
Fonds négocié(s) en bourse	24 446	-	-	24 446
Dérivés, nets	-	(36)	-	(36)
Total	51 883	(36)	-	51 847

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	20 921	1 479	-	22 400
Fonds négocié(s) en bourse	21 566	-	-	21 566
Dérivés, nets	-	14	-	14
Total	42 487	1 493	-	43 980

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	363 723	279 642
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	250	729
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	14	462
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	40	52
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	281	322
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	41
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	979
	364 308	282 227
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 755	57
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	41
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	1 792
Frais de gestion à payer	68	69
Comptes créditeurs et charges à payer	75	50
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	1 898	2 009
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	362 410	280 218

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts couvertes	58 662	24 079	35,17	31,93	1 668 008
Parts non couvertes	303 748	256 139	34,86	32,42	8 713 865	7 900 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 034	1 090
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	19 569	53
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(3 390)	(6 764)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	19 213	(5 621)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(565)	12
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	312	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	(253)	12
Total des revenus	18 960	(5 609)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	435	159
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	80	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	2
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	419	163
Taxe de vente harmonisée	20	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	955	325
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(2)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 005	(5 932)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts couvertes	2 581	(2 417)	2,31	(2,38)	1 116 260	1 013 790
Parts non couvertes	15 424	(3 515)	2,46	(1,84)	6 275 911	1 912 912

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	24 079	32 096	256 139	84 624	280 218	116 720
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 581	(2 417)	15 424	(3 515)	18 005	(5 932)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(709)	(276)	(4 848)	(451)	(5 557)	(727)
Profits nets réalisés	(1 115)	-	(2 824)	-	(3 939)	-
Remboursement de capital	(23)	-	(125)	-	(148)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 847)	(276)	(7 797)	(451)	(9 644)	(727)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	2 160	153 238	4 960	153 238	7 120
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	1 597	-	6 422	-	8 019	-
Acquisition des actifs de fonds dissous	42 550	-	7 491	-	50 041	-
Rachat de parts rachetables	(10 298)	(12 620)	(127 169)	(47 834)	(137 467)	(60 454)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	33 849	(10 460)	39 982	(42 874)	73 831	(53 334)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	34 583	(13 153)	47 609	(46 840)	82 192	(59 993)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	58 662	18 943	303 748	37 784	362 410	56 727

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	18 005	(5 932)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(19 569)	(53)
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(6)	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	80	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	3 390	6 764
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	30 262	6 347
Achat de placements et de dérivés	(162 996)	(5 952)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	40	60
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(1)	(12)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	37	(9)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(130 758)	1 213
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 417)	(771)
Produit de l'émission de parts rachetables	136 451	(109)
Montant versé au rachat de parts rachetables	(3 058)	(324)
Acquisition des actifs de fonds dissous	297	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	130 273	(1 204)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	6	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(485)	9
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	729	71
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	250	81
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	2 655	986
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	4 637	Activision Blizzard Inc.	533 496	548 591	
USD	35	Cable One Inc.	77 294	82 989	
USD	100 985	Comcast Corp., catégorie A	6 669 493	7 137 821	
USD	1 778	Electronic Arts Inc.	315 839	317 003	
USD	8 077	News Corp., catégorie A	223 275	258 016	
USD	1 154	Nexstar Media Group Inc., catégorie A	183 133	211 542	
USD	210 723	Verizon Communications Inc.	15 340 004	14 635 721	
			23 342 534	23 191 683	6,40
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	527	Advance Auto Parts Inc.	119 716	134 012	
USD	6 934	Best Buy Co. Inc.	1 020 213	988 298	
USD	5 574	BorgWarner Inc.	305 562	335 389	
USD	155	Churchill Downs Inc.	36 613	38 093	
USD	5 105	D.R. Horton Inc.	532 820	571 876	
USD	1 879	Dick's Sporting Goods Inc.	177 261	233 363	
USD	2 125	Dollar General Corp.	582 902	570 004	
USD	10 995	eBay Inc.	844 633	956 920	
USD	1 825	Foot Locker Inc.	115 165	139 424	
USD	4 355	Gentex Corp.	179 955	178 635	
USD	18 330	Hanesbrands Inc.	411 999	424 217	
USD	5 128	Hasbro Inc.	608 746	600 832	
USD	1 952	KB Home	96 611	98 530	
USD	722	LCI Industries	121 005	117 620	
USD	474	Lear Corp.	99 900	102 989	
USD	5 136	Lennar Corp., catégorie A	585 292	632 520	
USD	147	Lithia Motors Inc., catégorie A	54 742	62 618	
USD	13 643	Lowe's Cos. Inc.	3 192 126	3 280 395	
USD	2 868	M.D.C. Holdings Inc.	181 755	179 892	
USD	279	Murphy USA Inc.	46 689	46 126	
USD	12 299	Nike Inc., catégorie B	2 193 868	2 355 330	
USD	2 852	Penske Automotive Group Inc.	244 210	266 883	
USD	1 996	Polaris Inc.	339 302	338 872	
USD	338	Pool Corp.	169 372	192 172	
USD	3 721	PulteGroup Inc.	234 215	251 707	
USD	3 613	Service Corp. International	228 653	240 012	
USD	9 713	Target Corp.	2 478 518	2 910 607	
USD	1 168	Thor Industries Inc.	158 102	163 607	
USD	1 531	Toll Brothers Inc.	102 765	109 713	
USD	1 646	Tractor Supply Co.	346 558	379 633	
USD	94	UniFirst Corp.	25 872	27 341	
USD	3 483	Wendy's Co. (The)	102 709	101 116	
USD	1 896	Williams-Sonoma Inc.	326 164	375 222	
			16 264 013	17 403 968	4,80
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	182 034	Altria Group Inc.	10 851 514	10 758 961	
USD	5 341	Brown-Forman Corp., catégorie B	514 160	496 156	
USD	10 975	Campbell Soup Co.	660 240	620 234	
USD	330	Casey's General Stores Inc.	80 846	79 621	
USD	3 402	Church & Dwight Co. Inc.	380 131	359 383	
USD	3 397	Clorox Co. (The)	846 587	757 587	
USD	161 748	Coca-Cola Co. (The)	10 879 797	10 849 207	
USD	18 613	Conagra Brands Inc.	861 894	839 384	
USD	3 033	Constellation Brands Inc., catégorie A	836 425	879 358	
USD	4 033	Costco Wholesale Corp.	1 956 683	1 978 076	
USD	2 375	Energizer Holdings Inc.	131 039	126 535	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
USD	2 393	The Estée Lauder Cos. Inc., catégorie A	855 630	943 541	
USD	25 741	General Mills Inc.	1 972 368	1 944 188	
USD	3 896	Hershey Co. (The)	786 999	841 199	
USD	13 718	Hormel Foods Corp.	821 411	811 981	
USD	2 597	Ingredion Inc.	285 417	291 341	
USD	15 448	Kellogg Co.	1 222 076	1 231 877	
USD	34 051	Keurig Dr Pepper Inc.	1 434 770	1 487 467	
USD	21 781	Kroger Co. (The)	991 930	1 034 360	
USD	586	Lancaster Colony Corp.	136 177	140 567	
USD	4 751	McCormick & Co. Inc.	557 347	520 146	
USD	47 737	PepsiCo Inc.	8 714 404	8 767 928	
USD	70 340	Procter & Gamble Co. (The)	12 373 048	11 765 013	
USD	1 269	Spectrum Brands Holdings Inc.	128 356	133 772	
USD	9 251	Tyson Foods Inc., catégorie A	820 877	845 846	
USD	171	WD-40 Co.	55 994	54 326	
			59 156 120	58 558 054	16,16
ÉNERGIE					
USD	11 483	Cabot Oil & Gas Corp.	258 478	248 531	
USD	5 790	Diamondback Energy Inc.	508 981	673 875	
USD	429	EnerSys	48 124	51 972	
USD	3 832	Pioneer Natural Resources Co.	677 072	771 994	
			1 492 655	1 746 372	0,48
SERVICES FINANCIERS					
USD	7 700	Allstate Corp. (The)	1 138 150	1 245 039	
USD	3 134	Ameriprise Financial Inc.	862 312	966 875	
USD	5 797	Ares Management Corp., catégorie A	407 359	456 955	
USD	3 534	Arthur J. Gallagher & Co.	576 706	613 655	
USD	1 436	Assurant Inc.	259 941	278 011	
USD	2 859	Brown & Brown Inc.	178 635	188 329	
USD	2 585	CBOE Global Markets, Inc.	342 755	381 480	
USD	8 290	CME Group Inc.	2 086 321	2 185 560	
USD	1 211	Cohen & Steers Inc.	116 591	123 230	
USD	3 998	East West Bancorp Inc.	310 121	355 290	
USD	936	Erie Indemnity Co., catégorie A	261 289	224 337	
USD	1 201	Evercore Inc., catégorie A	184 549	209 573	
USD	408	FactSet Research Systems Inc.	172 221	169 737	
USD	1 314	First Republic Bank	266 510	304 869	
USD	968	GATX Corp.	106 026	106 158	
USD	1 026	Globe Life Inc.	122 254	121 142	
USD	12 335	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	866 239	947 550	
USD	1 183	Houlihan Lokey Inc.	108 872	119 941	
USD	7 578	Intercontinental Exchange Inc.	1 103 736	1 115 031	
USD	994	LPL Financial Holdings Inc.	147 142	166 317	
USD	204	MarketAxess Holdings Inc.	136 104	117 232	
USD	10 006	Marsh & McLennan Cos. Inc.	1 589 601	1 744 916	
USD	8 236	MGIC Investment Corp.	137 609	138 847	
USD	307	Morningstar Inc.	86 713	97 845	
USD	3 133	Nasdaq Inc.	593 962	682 749	
USD	6 833	OneMain Holdings Inc.	450 883	507 449	
USD	891	PennyMac Financial Services Inc.	72 932	68 169	
USD	573	Primerica Inc.	104 056	108 774	
USD	3 037	Progressive Corp. (The)	372 914	369 728	
USD	2 430	S&P Global Inc.	1 134 920	1 236 369	
USD	2 200	SEI Investments Co.	166 976	169 000	
USD	1 114	Selective Insurance Group Inc.	102 454	112 061	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SERVICES FINANCIERS (suite)					
USD	1 155	Signature Bank	275 630	351 706	
USD	4 575	SLM Corp.	91 160	118 754	
USD	6 588	T. Rowe Price Group Inc.	1 424 983	1 616 719	
USD	7 814	Travelers Cos. Inc. (The)	1 405 301	1 450 126	
USD	1 608	Voya Financial Inc.	120 782	122 586	
USD	1 617	W.R. Berkley Corp.	143 938	149 190	
USD	2 124	Western Alliance Bancorp	205 943	244 466	
			18 234 590	19 685 765	5,43
SOINS DE SANTÉ					
USD	2 278	Agilent Technologies Inc.	370 511	417 387	
USD	18 624	Amgen Inc.	5 710 180	5 627 288	
USD	3 450	Anthem Inc.	1 498 930	1 632 814	
USD	7 172	Baxter International Inc.	731 279	715 678	
USD	184	Bio-Techne Corp.	85 914	102 698	
USD	76 141	Bristol-Myers Squibb Co.	6 156 695	6 306 765	
USD	515	Brucker Corp.	39 802	48 505	
USD	3 368	Cerner Corp.	325 965	326 316	
USD	51	Chemed Corp.	30 228	29 998	
USD	78	CIGNA Corp.	21 093	22 922	
USD	11	Cooper Cos. Inc. (The)	5 090	5 403	
USD	2 598	Danaher Corp.	809 001	864 248	
USD	20 110	Eli Lilly and Co.	4 866 023	5 721 556	
USD	171	Ensign Group Inc. (The)	17 432	18 372	
USD	961	Humana Inc.	527 646	527 393	
USD	79 037	Johnson & Johnson	15 770 287	16 140 281	
USD	90 125	Merck & Co. Inc.	9 154 033	8 688 383	
USD	233 538	Pfizer Inc.	11 218 541	11 336 573	
USD	2 811	Quest Diagnostics Inc.	446 928	459 852	
USD	1 256	ResMed Inc.	344 702	383 816	
USD	4 231	Stryker Corp.	1 310 299	1 362 218	
USD	188	Teleflex Inc.	91 120	93 635	
USD	841	Thermo Fisher Scientific Inc.	519 243	525 912	
USD	15 998	UnitedHealth Group Inc.	7 417 009	7 941 174	
USD	216	West Pharmaceutical Services Inc.	86 649	96 150	
USD	2 709	Zoetis Inc.	589 228	625 811	
			68 143 828	70 021 148	19,32
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	23 864	3M Co.	5 659 180	5 875 836	
USD	3 060	A. O. Smith Corp.	242 102	273 336	
USD	385	AAON Inc.	30 964	29 871	
USD	202	Acuity Brands Inc.	38 261	46 832	
USD	655	AGCO Corp.	94 492	105 860	
USD	2 095	Air Lease Corp.	114 702	108 397	
USD	2 204	Allison Transmission Holdings Inc.	116 966	108 573	
USD	357	Altra Industrial Motion Corp.	26 094	28 774	
USD	1 713	AMETEK Inc.	267 149	283 478	
USD	620	Armstrong World Industries Inc.	70 237	82 435	
USD	525	Brink's Co. (The)	50 279	50 007	
USD	1 417	BWX Technologies Inc.	107 367	102 088	
USD	3 645	C.H. Robinson Worldwide Inc.	448 280	423 233	
USD	883	Carlisle Cos. Inc.	183 156	209 478	
USD	15 285	Caterpillar Inc.	3 845 945	4 123 498	
USD	1 288	Cintas Corp.	584 653	609 903	
USD	32 307	CSX Corp.	1 238 618	1 284 732	
USD	4 475	Cummins Inc.	1 333 321	1 352 465	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		PRODUITS INDUSTRIELS (suite)			
USD	298	Curtiss-Wright Corp.	44 344	43 870	
USD	4 560	Deere & Co.	1 773 007	1 993 720	
USD	2 347	Donaldson Co. Inc.	173 975	184 830	
USD	2 878	Dover Corp.	482 916	537 276	
USD	239	EMCOR Group Inc.	30 750	36 497	
USD	17 946	Emerson Electric Co.	1 985 650	2 140 942	
USD	1 235	Equifax Inc.	314 679	366 667	
USD	2 382	Expeditors International of Washington Inc.	325 346	373 815	
USD	556	Exponent Inc.	60 755	61 485	
USD	14 283	Fastenal Co.	901 213	920 671	
USD	2 888	FedEx Corp.	1 055 239	1 068 011	
USD	1 962	Fortune Brands Home & Security Inc.	231 436	242 261	
USD	492	Franklin Electric Co. Inc.	46 158	49 169	
USD	10 216	General Dynamics Corp.	2 248 788	2 384 078	
USD	2 052	Graco Inc.	186 349	192 555	
USD	188	HEICO Corp.	31 452	32 491	
USD	2 027	Hillenbrand Inc.	105 473	110 758	
USD	14 890	Honeywell International Inc.	3 925 336	4 048 684	
USD	1 623	Hubbell Inc.	348 521	375 898	
USD	1 272	Huntington Ingalls Industries Inc.	316 292	332 305	
USD	961	Ilex Corp.	251 170	262 136	
USD	8 681	Illinois Tool Works Inc.	2 349 854	2 405 722	
USD	869	Insperty Inc.	95 751	97 348	
USD	1 006	J.B. Hunt Transport Services Inc.	188 822	203 205	
USD	129	John Bean Technologies Corp.	19 246	22 806	
USD	1 026	Kansas City Southern	302 403	360 398	
USD	4 623	L3Harris Technologies Inc.	1 165 721	1 238 684	
USD	285	Landstar System Inc.	53 387	55 826	
USD	1 231	Lincoln Electric Holdings Inc.	188 099	200 983	
USD	538	MSA Safety Inc.	105 449	110 426	
USD	1 978	MSC Industrial Direct Co. Inc., catégorie A	212 181	220 012	
USD	560	Nordson Corp.	148 351	152 379	
USD	4 970	Norfolk Southern Corp.	1 541 451	1 635 141	
USD	3 939	Northrop Grumman Corp.	1 683 949	1 774 550	
USD	429	Old Dominion Freight Line Inc.	123 304	134 968	
USD	1 276	Oshkosh Corp.	167 564	197 147	
USD	1 714	Owens Corning	188 996	208 006	
USD	6 353	PACCAR Inc.	703 172	702 860	
USD	2 021	Parker Hannifin Corp.	717 573	769 382	
USD	509	Regal-Beloit Corp.	78 803	84 239	
USD	6 985	Republic Services Inc.	891 539	952 533	
USD	2 956	Robert Half International Inc.	308 869	326 009	
USD	2 468	Rockwell Automation Inc.	814 875	875 030	
USD	3 502	Rollins Inc.	164 536	148 465	
USD	687	Roper Technologies Inc.	381 888	400 425	
USD	542	Simpson Manufacturing Co. Inc.	69 819	74 201	
USD	1 807	Snap-On Inc.	446 974	500 474	
USD	3 135	Stanley Black & Decker Inc.	758 588	796 621	
USD	385	Tetra Tech Inc.	56 926	58 243	
USD	1 435	Toro Co. (The)	181 009	195 457	
USD	732	TransUnion	92 161	99 640	
USD	15 765	Union Pacific Corp.	4 217 217	4 297 937	
USD	21 008	United Parcel Service Inc., catégorie B	4 940 512	5 415 854	
USD	276	Valmont Industries Inc.	70 729	80 760	
USD	1 108	Verisk Analytics Inc.	259 725	239 974	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	997	W.W. Grainger Inc.	519 805	541 316	
USD	9 774	Waste Management Inc.	1 567 334	1 697 552	
USD	262	Watts Water Technologies Inc., catégorie A	42 071	47 388	
USD	761	Werner Enterprises Inc.	41 006	41 997	
USD	211	Woodward Governor Co.	30 126	32 140	
USD	2 330	Xylem Inc.	313 298	346 477	
			55 493 698	58 599 490	16,17
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	5 848	Amphenol Corp., catégorie A	484 144	495 916	
USD	7 166	Analog Devices Inc.	1 419 048	1 529 293	
USD	100 688	Apple Inc.	16 450 392	17 094 367	
USD	10 047	Applied Materials Inc.	1 397 822	1 773 487	
USD	10 148	Automatic Data Processing Inc.	2 356 160	2 498 532	
USD	2 904	Avnet Inc.	137 757	144 280	
USD	2 151	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	233 528	227 122	
USD	1 988	Broadridge Financial Solutions Inc.	384 389	398 062	
USD	456	Brooks Automation Inc.	46 547	53 858	
USD	1 932	CDW Corp.	376 185	418 270	
USD	151 560	Cisco Systems Inc.	9 329 915	9 957 310	
USD	1 457	Citrix Systems Inc.	237 791	211 801	
USD	604	Cognex Corp.	60 163	62 930	
USD	6 615	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	625 569	567 929	
USD	685	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	78 875	83 461	
USD	506	Enterpris Inc.	66 763	77 131	
USD	6 487	Fidelity National Information Services Inc.	1 184 431	1 139 209	
USD	1 342	Global Payments Inc.	325 865	311 981	
USD	120 080	Intel Corp.	8 552 208	8 356 504	
USD	1 879	Intuit Inc.	977 192	1 141 708	
USD	930	Jack Henry & Associates Inc.	190 484	188 499	
USD	2 217	KBR Inc.	94 897	104 844	
USD	2 383	KLA Corp.	856 058	957 706	
USD	1 681	Lam Research Corp.	1 256 530	1 355 907	
USD	2 027	Leidos Holdings Inc.	259 846	254 031	
USD	5 333	Mastercard Inc., catégorie A	2 385 575	2 413 532	
USD	1 041	Maximus Inc.	105 955	113 519	
USD	3 013	Microchip Technology Inc.	575 446	559 266	
USD	57 794	Microsoft Corp.	17 709 649	19 407 667	
USD	330	MKS Instruments Inc.	63 530	72 794	
USD	325	Monolithic Power Systems Inc.	143 514	150 452	
USD	7 612	NetApp Inc.	733 302	772 040	
USD	16 676	NortonLifeLock Inc.	489 229	562 680	
USD	840	NVIDIA Corp.	688 987	833 115	
USD	52 646	Oracle Corp.	4 673 108	5 079 837	
USD	10 719	Paychex Inc.	1 332 056	1 425 724	
USD	400	Power Integration Inc.	40 165	40 689	
USD	22 500	QUALCOMM Inc.	3 997 930	3 986 461	
USD	962	Science Applications International Corp.	109 732	104 618	
USD	2 633	Skyworks Solutions Inc.	559 752	625 846	
USD	636	Teradyne Inc.	97 296	105 612	
USD	25 742	Texas Instruments Inc.	5 705 119	6 136 251	
USD	565	TTEC Holdings Inc.	63 638	72 202	
USD	135	Universal Display Corp.	36 301	37 206	
USD	11 595	Visa Inc., catégorie A	3 199 710	3 360 733	
			90 092 553	95 264 382	26,29

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX					
USD	425	Advanced Drainage Systems Inc.	52 586	61 413	
USD	5 425	Air Products and Chemicals Inc.	1 979 450	1 934 599	
USD	1 448	Albemarle Corp.	279 328	302 376	
USD	875	AptarGroup Inc.	149 171	152 762	
USD	1 688	Avery Dennison Corp.	380 129	439 916	
USD	2 459	Avient Corp.	137 164	149 848	
USD	184	Balchem Corp.	27 805	29 939	
USD	2 710	Celanese Corp.	473 092	509 272	
USD	391	CMC Materials Inc.	76 450	73 061	
USD	2 970	Ecolab Inc.	796 911	758 302	
USD	2 402	FMC Corp.	337 509	322 168	
USD	6 083	Graphic Packaging Holding Co.	130 127	136 784	
USD	20 289	International Paper Co.	1 396 436	1 541 961	
USD	1 953	Louisiana Pacific Corp.	121 968	145 958	
USD	651	Martin Marietta Materials Inc.	255 822	283 904	
USD	4 176	Mosaic Co. (The)	144 191	165 184	
USD	258	NewMarket Corp.	120 890	102 975	
USD	10 508	Nucor Corp.	968 358	1 249 557	
USD	2 706	Packaging Corp. of America	454 290	454 247	
USD	4 371	PPG Industries Inc.	851 822	919 863	
USD	2 795	RPM International Inc.	316 329	307 248	
USD	890	Scotts Miracle-Gro Co. (The), catégorie A	215 199	211 735	
USD	1 111	Sensient Technologies Corp.	110 428	119 210	
USD	2 488	Sherwin-Williams Co. (The)	794 898	840 270	
USD	1 832	Silgan Holdings Inc.	90 298	94 244	
USD	6 582	Steel Dynamics Inc.	390 607	486 279	
USD	692	UFP Industries Inc.	56 838	63 769	
USD	590	United States Steel Corp.	15 101	17 553	
USD	1 589	Vulcan Materials Co.	324 051	342 870	
USD	2 025	Westlake Chemical Corp.	222 306	226 143	
USD	1 296	Worthington Industries Inc.	91 954	98 287	
			11 761 508	12 541 697	3,46
IMMOBILIER					
USD	13 830	Fidelity National Financial Inc.	717 742	745 064	
USD	6 760	Healthcare Realty Trust Inc.	257 234	253 067	
USD	2 689	Lamar Advertising Co., catégorie A	310 833	348 061	
USD	2 736	PotlatchDeltic Corp.	177 891	180 261	
USD	19 421	Weyerhaeuser Co.	839 761	828 636	
			2 303 461	2 355 089	0,65
SERVICES PUBLICS					
USD	5 733	Clearway Energy Inc.	215 145	188 183	
USD	45 502	NextEra Energy Inc.	4 357 699	4 133 307	
USD	393	Ormat Technologies Inc.	37 517	33 872	
			4 610 361	4 355 362	1,20
Total des actions			350 895 321	363 723 010	100,36
Ajustement au titre des coûts de transaction			(9 769)		
Total des placements			350 885 552	363 723 010	100,36
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(1 741 191)	(0,48)
Autres actifs (passifs) nets				428 513	0,12
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				362 410 332	100,00

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque de Montréal	A-1	07 juillet 2021	USD	1 005 000	CAD	1 232 005	0,82	13 794
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	USD	1 115 000	CAD	1 386 896	0,80	(4 741)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	57 996 048	USD	48 190 000	1,20	(1 740 340)
La Banque Toronto-Dominion	A-1+	07 juillet 2021	CAD	1 310 272	USD	1 065 000	1,23	(9 904)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(1 741 191)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	14	-	-	14
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	14	-	-	14
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 755)	-	-	(1 755)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1 755)	-	-	(1 755)

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	462	(57)	-	405
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	462	(57)	-	405
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(57)	57	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(57)	57	-	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	11	s.o.
Paiements indirects [†]	3	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2021	2020	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	754 175	1 104 175	7 900 000	2 850 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	100 000	4 450 000	200 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Émission de parts rachetables liée à l'acquisition des actifs de fonds dissous	1 213 833	-	213 865	-
Parts rachetables rachetées	(300 000)	(500 000)	(3 850 000)	(1 750 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 668 008	704 175	8 713 865	1 300 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,350*
Parts non couvertes	0,350

*Le 23 juin 2021, le taux des frais de gestion annuels des parts couvertes est passé de 0,38 % à 0,35 %.

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	1 882	-
Garanties (hors trésorerie)	1 976	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Technologies de l'information	25,3
Soins de santé	19,6
Biens de consommation de base	17,2
Produits industriels	15,5
Services de communication	7,0
Services financiers	5,0
Biens de consommation discrétionnaire	4,3
Matériaux	3,3
Services publics	1,4
Immobilier	0,7
Énergie	0,4
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,1
Total de la perte latente sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree	35 445 935

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree	27 025 033

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	364 070	(58 429)	305 641	84,3
Total	364 070	(58 429)	305 641	84,3

Parts couvertes

au 31 décembre 2020~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	24 054	(23 870)	184	0,8
Total	24 054	(23 870)	184	0,8

Parts non couvertes

au 31 décembre 2020~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	255 878	-	255 878	99,9
Total	255 878	-	255 878	99,9

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 3 056 400 \$ (25 606 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	363 723	-	-	363 723
Dérivés, nets	-	(1 741)	-	(1 741)
Total	363 723	(1 741)	-	361 982

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	279 642	-	-	279 642
Dérivés, nets	-	405	-	405
Total	279 642	405	-	280 047

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	51 965	50 124
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	815	364
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	359
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	60	55
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	7	9
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	348
	52 847	51 259
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1 256	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	8	9
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	205
Frais de gestion à payer	18	15
Comptes créditeurs et charges à payer	3	2
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	1 285	231
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	51 562	51 028

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts à couverture variable	51 562	51 028	34,37	31,89	1 500 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	641	522
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	2 585	(1 311)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 376	382
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	4 602	(407)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	5
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	3	-
Total des autres revenus	1	5
Total des revenus	4 603	(402)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	111	90
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	87	79
Taxe de vente harmonisée	10	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	218	171
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(1)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 385	(572)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts à couverture variable	4 385	(572)	2,79	(0,40)	1 571 823	1 419 780

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts à couverture variable	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	51 028	38 571
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 385	(572)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(396)	(337)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(5)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(401)	(337)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	-	11 474
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	(3 450)	(4 360)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(3 450)	7 114
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	534	6 205
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	51 562	44 776

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	4 385	(572)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 585)	1 311
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	9	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 376)	(382)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 012	7 911
Achat de placements et de dérivés	(1 574)	(15 050)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(5)	(9)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	1	(2)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	869	(6 792)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(606)	(278)
Produit de l'émission de parts rachetables	348	11 473
Montant versé au rachat de parts rachetables	(161)	(4 360)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(419)	6 835
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	450	43
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	364	18
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	815	61
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	549	435
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	654	Activision Blizzard Inc.	58 200	77 373	
USD	5	Cable One Inc.	9 545	11 856	
USD	14 445	Comcast Corp., catégorie A	781 738	1 021 001	
USD	251	Electronic Arts Inc.	45 061	44 751	
USD	1 139	News Corp., catégorie A	25 753	36 385	
USD	163	Nexstar Media Group Inc., catégorie A	19 546	29 880	
USD	30 143	Verizon Communications Inc.	2 280 787	2 093 576	
			3 220 630	3 314 822	6,43
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	75	Advance Auto Parts Inc.	14 776	19 072	
USD	992	Best Buy Co. Inc.	104 076	141 389	
USD	785	BorgWarner Inc.	38 723	47 234	
USD	23	Churchill Downs Inc.	4 332	5 653	
USD	721	D.R. Horton Inc.	46 701	80 768	
USD	266	Dick's Sporting Goods Inc.	18 825	33 036	
USD	301	Dollar General Corp.	59 097	80 739	
USD	1 573	eBay Inc.	84 387	136 902	
USD	258	Foot Locker Inc.	13 055	19 710	
USD	614	Gentex Corp.	20 164	25 185	
USD	2 581	Hanesbrands Inc.	46 417	59 733	
USD	733	Hasbro Inc.	87 219	85 883	
USD	275	KB Home	12 354	13 881	
USD	102	LCI Industries	17 440	16 617	
USD	67	Lear Corp.	13 646	14 558	
USD	735	Lennar Corp., catégorie A	72 326	90 518	
USD	22	Lithia Motors Inc., catégorie A	5 281	9 371	
USD	1 952	Lowe's Cos. Inc.	304 231	469 350	
USD	404	M.D.C. Holdings Inc.	23 988	25 340	
USD	40	Murphy USA Inc.	6 606	6 613	
USD	1 759	Nike Inc., catégorie B	223 293	336 859	
USD	402	Penske Automotive Group Inc.	29 612	37 618	
USD	282	Polaris Inc.	33 147	47 877	
USD	49	Pool Corp.	14 333	27 859	
USD	525	PulteGroup Inc.	22 975	35 514	
USD	511	Service Corp. International	28 722	33 946	
USD	1 389	Target Corp.	201 452	416 229	
USD	165	Thor Industries Inc.	16 338	23 112	
USD	216	Toll Brothers Inc.	10 711	15 479	
USD	233	Tractor Supply Co.	30 871	53 739	
USD	14	UniFirst Corp.	3 731	4 072	
USD	491	Wendy's Co. (The)	12 297	14 254	
USD	269	Williams-Sonoma Inc.	24 447	53 236	
			1 645 573	2 481 346	4,81
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	26 039	Altria Group Inc.	1 605 557	1 539 012	
USD	752	Brown-Forman Corp., catégorie B	60 850	69 858	
USD	1 570	Campbell Soup Co.	101 723	88 726	
USD	48	Casey's General Stores Inc.	9 174	11 581	
USD	481	Church & Dwight Co. Inc.	44 577	50 812	
USD	486	Clorox Co. (The)	109 299	108 386	
USD	23 137	Coca-Cola Co. (The)	1 570 846	1 551 909	
USD	2 662	Conagra Brands Inc.	121 809	120 047	
USD	434	Constellation Brands Inc., catégorie A	108 011	125 830	
USD	577	Costco Wholesale Corp.	212 137	283 003	
USD	335	Energizer Holdings Inc.	18 106	17 848	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
USD	342	The Estée Lauder Cos. Inc., catégorie A	111 718	134 848	
USD	3 682	General Mills Inc.	258 226	278 097	
USD	557	Hershey Co. (The)	93 572	120 264	
USD	1 962	Hormel Foods Corp.	118 789	116 133	
USD	366	Ingredion Inc.	41 459	41 059	
USD	2 210	Kellogg Co.	173 566	176 233	
USD	4 871	Keurig Dr Pepper Inc.	201 960	212 782	
USD	3 116	Kroger Co. (The)	124 685	147 976	
USD	84	Lancaster Colony Corp.	17 013	20 150	
USD	669	McCormick & Co. Inc.	66 412	73 243	
USD	6 829	PepsiCo Inc.	1 146 149	1 254 293	
USD	10 062	Procter & Gamble Co. (The)	1 532 452	1 682 962	
USD	181	Spectrum Brands Holdings Inc.	17 336	19 080	
USD	1 323	Tyson Foods Inc., catégorie A	110 069	120 966	
USD	26	WD-40 Co.	8 835	8 260	
			7 984 330	8 373 358	16,24
ÉNERGIE					
USD	1 618	Cabot Oil & Gas Corp.	37 371	35 019	
USD	815	Diamondback Energy Inc.	55 269	94 855	
USD	60	EnerSys	6 393	7 269	
USD	548	Pioneer Natural Resources Co.	87 450	110 400	
			186 483	247 543	0,48
SERVICES FINANCIERS					
USD	1 102	Allstate Corp. (The)	150 827	178 186	
USD	448	Ameriprise Financial Inc.	108 077	138 213	
USD	816	Ares Management Corp., catégorie A	51 663	64 322	
USD	499	Arthur J. Gallagher & Co.	65 807	86 648	
USD	204	Assurant Inc.	34 385	39 495	
USD	403	Brown & Brown Inc.	18 621	26 547	
USD	364	CBOE Global Markets, Inc.	46 486	53 717	
USD	1 186	CME Group Inc.	289 136	312 675	
USD	172	Cohen & Steers Inc.	16 289	17 503	
USD	564	East West Bancorp Inc.	33 528	50 121	
USD	132	Erie Indemnity Co., catégorie A	29 397	31 637	
USD	170	Evercore Inc., catégorie A	23 453	29 665	
USD	59	FactSet Research Systems Inc.	19 836	24 545	
USD	185	First Republic Bank	33 229	42 923	
USD	137	GATX Corp.	14 620	15 024	
USD	146	Globe Life Inc.	16 019	17 239	
USD	1 764	Hartford Financial Services Group Inc. (The)	107 582	135 507	
USD	168	Houlihan Lokey Inc.	14 687	17 033	
USD	1 084	Intercontinental Exchange Inc.	155 551	159 500	
USD	141	LPL Financial Holdings Inc.	13 881	23 592	
USD	31	MarketAxess Holdings Inc.	13 737	17 815	
USD	1 431	Marsh & McLennan Cos. Inc.	183 488	249 548	
USD	1 161	MGIC Investment Corp.	18 500	19 573	
USD	44	Morningstar Inc.	8 152	14 023	
USD	442	Nasdaq Inc.	73 001	96 321	
USD	962	OneMain Holdings Inc.	56 677	71 442	
USD	126	PennyMac Financial Services Inc.	10 540	9 640	
USD	82	Primerica Inc.	14 022	15 566	
USD	428	Progressive Corp. (The)	53 302	52 105	
USD	348	S&P Global Inc.	114 088	177 061	
USD	310	SEI Investments Co.	22 911	23 814	
USD	157	Selective Insurance Group Inc.	13 435	15 793	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SERVICES FINANCIERS (suite)					
USD	163	Signature Bank	27 866	49 635	
USD	645	SLM Corp.	8 063	16 742	
USD	942	T. Rowe Price Group Inc.	146 101	231 170	
USD	1 118	Travelers Cos. Inc. (The)	182 688	207 480	
USD	227	Voya Financial Inc.	16 339	17 305	
USD	229	W.R. Berkley Corp.	19 173	21 128	
USD	301	Western Alliance Bancorp	20 825	34 644	
			2 245 982	2 804 897	5,44
SOINS DE SANTÉ					
USD	322	Agilent Technologies Inc.	38 973	58 999	
USD	2 664	Amgen Inc.	819 311	804 934	
USD	493	Anthem Inc.	179 515	233 327	
USD	1 026	Baxter International Inc.	103 774	102 382	
USD	28	Bio-Techne Corp.	11 503	15 628	
USD	10 892	Bristol-Myers Squibb Co.	857 972	902 185	
USD	73	Bruker Corp.	3 584	6 875	
USD	476	Cerner Corp.	45 708	46 118	
USD	8	Chemed Corp.	4 265	4 706	
USD	12	CIGNA Corp.	3 130	3 526	
USD	2	Cooper Cos. Inc. (The)	914	982	
USD	372	Danaher Corp.	74 195	123 749	
USD	2 877	Eli Lilly and Co.	494 844	818 544	
USD	26	Ensign Group Inc. (The)	2 524	2 793	
USD	136	Humana Inc.	60 987	74 636	
USD	11 306	Johnson & Johnson	2 215 655	2 308 818	
USD	12 892	Merck & Co. Inc.	1 456 643	1 242 836	
USD	33 407	Pfizer Inc.	1 592 438	1 621 667	
USD	396	Quest Diagnostics Inc.	61 007	64 782	
USD	179	ResMed Inc.	32 644	54 700	
USD	605	Stryker Corp.	155 012	194 787	
USD	28	Teleflex Inc.	11 098	13 946	
USD	120	Thermo Fisher Scientific Inc.	57 340	75 041	
USD	2 288	UnitedHealth Group Inc.	856 205	1 135 730	
USD	30	West Pharmaceutical Services Inc.	6 493	13 354	
USD	383	Zoetis Inc.	60 431	88 478	
			9 206 165	10 013 523	19,42
PRODUITS INDUSTRIELS					
USD	3 414	3M Co.	790 476	840 601	
USD	431	A. O. Smith Corp.	27 911	38 499	
USD	56	AAON Inc.	4 647	4 345	
USD	30	Acuity Brands Inc.	4 776	6 955	
USD	92	AGCO Corp.	8 818	14 869	
USD	297	Air Lease Corp.	16 402	15 367	
USD	311	Allison Transmission Holdings Inc.	17 380	15 320	
USD	52	Altra Industrial Motion Corp.	3 610	4 191	
USD	241	AMETEK Inc.	27 174	39 882	
USD	89	Armstrong World Industries Inc.	8 298	11 833	
USD	75	Brink's Co. (The)	7 605	7 144	
USD	201	BWX Technologies Inc.	14 171	14 481	
USD	513	C.H. Robinson Worldwide Inc.	55 938	59 566	
USD	125	Carlisle Cos. Inc.	20 368	29 654	
USD	2 186	Caterpillar Inc.	410 857	589 726	
USD	184	Cintas Corp.	57 396	87 129	
USD	4 620	CSX Corp.	142 822	183 721	
USD	640	Cummins Inc.	148 185	193 425	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		PRODUITS INDUSTRIELS (suite)			
USD	43	Curtiss-Wright Corp.	6 430	6 330	
USD	652	Deere & Co.	159 967	285 067	
USD	330	Donaldson Co. Inc.	21 339	25 988	
USD	406	Dover Corp.	50 023	75 794	
USD	34	EMCOR Group Inc.	3 301	5 192	
USD	2 567	Emerson Electric Co.	225 616	306 241	
USD	175	Equifax Inc.	34 384	51 957	
USD	336	Expeditors International of Washington Inc.	33 512	52 730	
USD	80	Exponent Inc.	7 936	8 847	
USD	2 043	Fastenal Co.	94 899	131 690	
USD	413	FedEx Corp.	105 906	152 731	
USD	277	Fortune Brands Home & Security Inc.	22 543	34 203	
USD	70	Franklin Electric Co. Inc.	6 224	6 996	
USD	1 461	General Dynamics Corp.	315 314	340 949	
USD	290	Graco Inc.	20 067	27 213	
USD	28	HEICO Corp.	4 642	4 839	
USD	286	Hillenbrand Inc.	13 989	15 627	
USD	2 130	Honeywell International Inc.	455 283	579 160	
USD	230	Hubbell Inc.	38 793	53 270	
USD	181	Huntington Ingalls Industries Inc.	45 937	47 285	
USD	136	Ilex Corp.	28 106	37 097	
USD	1 242	Illinois Tool Works Inc.	269 969	344 189	
USD	123	Insperty Inc.	13 290	13 779	
USD	143	J.B. Hunt Transport Services Inc.	21 529	28 885	
USD	19	John Bean Technologies Corp.	2 614	3 359	
USD	146	Kansas City Southern	31 362	51 285	
USD	661	L3Harris Technologies Inc.	150 265	177 108	
USD	41	Landstar System Inc.	6 105	8 031	
USD	175	Lincoln Electric Holdings Inc.	21 236	28 572	
USD	77	MSA Safety Inc.	11 335	15 804	
USD	279	MSC Industrial Direct Co. Inc., catégorie A	27 971	31 033	
USD	80	Nordson Corp.	16 183	21 768	
USD	711	Norfolk Southern Corp.	167 996	233 921	
USD	563	Northrop Grumman Corp.	228 123	253 636	
USD	60	Old Dominion Freight Line Inc.	10 441	18 877	
USD	180	Oshkosh Corp.	18 520	27 811	
USD	241	Owens Corning	23 808	29 247	
USD	909	PACCAR Inc.	99 521	100 567	
USD	289	Parker Hannifin Corp.	72 571	110 020	
USD	72	Regal-Beloit Corp.	8 595	11 916	
USD	999	Republic Services Inc.	121 568	136 232	
USD	418	Robert Half International Inc.	32 942	46 100	
USD	353	Rockwell Automation Inc.	89 978	125 156	
USD	494	Rollins Inc.	17 918	20 943	
USD	97	Roper Technologies Inc.	47 232	56 537	
USD	77	Simpson Manufacturing Co. Inc.	8 268	10 541	
USD	255	Snap-On Inc.	52 001	70 626	
USD	448	Stanley Black & Decker Inc.	85 233	113 839	
USD	56	Tetra Tech Inc.	5 614	8 472	
USD	204	Toro Co. (The)	19 860	27 786	
USD	104	TransUnion	11 704	14 157	
USD	2 255	Union Pacific Corp.	494 771	614 770	
USD	3 005	United Parcel Service Inc., catégorie B	494 694	774 688	
USD	39	Valmont Industries Inc.	8 925	11 412	
USD	156	Verisk Analytics Inc.	33 795	33 787	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	142	W.W. Grainger Inc.	57 385	77 098	
USD	1 398	Waste Management Inc.	187 725	242 805	
USD	37	Watts Water Technologies Inc., catégorie A	5 658	6 692	
USD	108	Werner Enterprises Inc.	5 573	5 960	
USD	32	Woodward Governor Co.	3 622	4 874	
USD	330	Xylem Inc.	33 824	49 072	
			6 480 769	8 367 269	16,23
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	824	Amphenol Corp., catégorie A	60 084	69 876	
USD	1 025	Analog Devices Inc.	148 717	218 745	
USD	14 403	Apple Inc.	1 431 805	2 445 278	
USD	1 437	Applied Materials Inc.	105 386	253 658	
USD	1 452	Automatic Data Processing Inc.	281 744	357 496	
USD	410	Avnet Inc.	17 735	20 370	
USD	303	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	25 796	31 994	
USD	281	Broadridge Financial Solutions Inc.	42 444	56 265	
USD	64	Brooks Automation Inc.	3 994	7 559	
USD	272	CDW Corp.	37 664	58 887	
USD	21 680	Cisco Systems Inc.	1 238 124	1 424 350	
USD	207	Citrix Systems Inc.	32 580	30 091	
USD	87	Cognex Corp.	6 113	9 064	
USD	946	Cognizant Technology Solutions Corp., catégorie A	84 757	81 219	
USD	97	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	8 894	11 819	
USD	72	Enterpris Inc.	5 892	10 975	
USD	928	Fidelity National Information Services Inc.	167 316	162 970	
USD	190	Global Payments Inc.	40 034	44 170	
USD	17 177	Intel Corp.	1 117 101	1 195 367	
USD	269	Intuit Inc.	90 733	163 448	
USD	132	Jack Henry & Associates Inc.	25 081	26 755	
USD	313	KBR Inc.	11 781	14 802	
USD	341	KLA Corp.	73 519	137 045	
USD	241	Lam Research Corp.	86 886	194 392	
USD	286	Leidos Holdings Inc.	37 173	35 843	
USD	763	Mastercard Inc., catégorie A	264 324	345 308	
USD	148	Maximus Inc.	13 253	16 139	
USD	424	Microchip Technology Inc.	74 530	78 702	
USD	8 267	Microsoft Corp.	1 650 119	2 776 122	
USD	48	MKS Instruments Inc.	6 894	10 588	
USD	47	Monolithic Power Systems Inc.	12 091	21 758	
USD	1 089	NetApp Inc.	90 102	110 451	
USD	2 348	NortonLifeLock Inc.	62 629	79 226	
USD	120	NVIDIA Corp.	48 523	119 016	
USD	7 531	Oracle Corp.	556 917	726 670	
USD	1 533	Paychex Inc.	151 551	203 903	
USD	58	Power Integration Inc.	6 016	5 900	
USD	3 219	QUALCOMM Inc.	431 632	570 330	
USD	136	Science Applications International Corp.	15 573	14 790	
USD	371	Skyworks Solutions Inc.	53 269	88 184	
USD	91	Teradyne Inc.	9 527	15 111	
USD	3 682	Texas Instruments Inc.	584 655	877 697	
USD	81	TTEC Holdings Inc.	7 831	10 351	
USD	20	Universal Display Corp.	4 569	5 512	
USD	1 659	Visa Inc., catégorie A	364 073	480 850	
			9 589 431	13 619 046	26,41

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX					
USD	60	Advanced Drainage Systems Inc.	6 277	8 670	
USD	776	Air Products and Chemicals Inc.	217 386	276 728	
USD	205	Albemarle Corp.	37 053	42 809	
USD	123	AptarGroup Inc.	17 408	21 474	
USD	240	Avery Dennison Corp.	37 688	62 547	
USD	347	Avient Corp.	17 927	21 146	
USD	28	Balchem Corp.	4 122	4 556	
USD	383	Celanese Corp.	52 803	71 975	
USD	57	CMC Materials Inc.	8 752	10 651	
USD	425	Ecolab Inc.	98 384	108 511	
USD	339	FMC Corp.	42 334	45 468	
USD	857	Graphic Packaging Holding Co.	16 043	19 271	
USD	2 902	International Paper Co.	184 551	220 551	
USD	275	Louisiana Pacific Corp.	13 379	20 552	
USD	92	Martin Marietta Materials Inc.	27 211	40 122	
USD	589	Mosaic Co. (The)	17 352	23 298	
USD	37	NewMarket Corp.	19 818	14 768	
USD	1 503	Nucor Corp.	105 686	178 729	
USD	382	Packaging Corp. of America	54 769	64 125	
USD	625	PPG Industries Inc.	94 534	131 529	
USD	394	RPM International Inc.	36 506	43 312	
USD	126	Scotts Miracle-Gro Co. (The), catégorie A	20 455	29 976	
USD	157	Sensient Technologies Corp.	14 727	16 846	
USD	353	Sherwin-Williams Co. (The)	81 469	119 218	
USD	259	Silgan Holdings Inc.	12 069	13 324	
USD	928	Steel Dynamics Inc.	43 663	68 561	
USD	98	UFP Industries Inc.	6 923	9 031	
USD	85	United States Steel Corp.	2 000	2 529	
USD	225	Vulcan Materials Co.	37 277	48 550	
USD	286	Westlake Chemical Corp.	30 220	31 939	
USD	183	Worthington Industries Inc.	12 077	13 878	
			1 370 863	1 784 644	3,46
IMMOBILIER					
USD	1 978	Fidelity National Financial Inc.	96 947	106 561	
USD	953	Healthcare Realty Trust Inc.	36 029	35 676	
USD	380	Lamar Advertising Co., catégorie A	39 863	49 187	
USD	387	PotlatchDeltic Corp.	24 067	25 497	
USD	2 778	Weyerhaeuser Co.	118 692	118 529	
			315 598	335 450	0,65
SERVICES PUBLICS					
USD	809	Clearway Energy Inc.	33 563	26 555	
USD	6 509	NextEra Energy Inc.	556 191	591 264	
USD	57	Ormat Technologies Inc.	5 924	4 913	
			595 678	622 732	1,21
Total des actions			42 841 502	51 964 630	100,78
Ajustement au titre des coûts de transaction			(4 485)		
Total des placements			42 837 017	51 964 630	100,78
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(1 256 050)	(2,44)
Autres actifs (passifs) nets				853 843	1,66
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				51 562 423	100,00

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	41 857 285	USD	34 780 000	1,20	(1 256 050)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(1 256 050)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(1 256)	-	-	(1 256)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(1 256)	-	-	(1 256)

au 31 décembre 2020

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

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	-	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts à couverture variable	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 600 000	1 300 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	450 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	(100 000)	(150 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 500 000	1 600 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts à couverture variable	0,430

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	482	-
Garanties (hors trésorerie)	506	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Technologies de l'information	25,1
Soins de santé	19,4
Biens de consommation de base	17,0
Produits industriels	15,2
Services de communication	6,9
Services financiers	4,9
Biens de consommation discrétionnaire	4,2
Matériaux	3,1
Services publics	1,4
Autres actifs (passifs) nets	1,1
Immobilier	0,7
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,7
Énergie	0,3
Total	100,0

Risque de crédit

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

au 30 juin 2021

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	(2,4)
Total	(2,4)

au 31 décembre 2020

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	0,7
Total	0,7

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

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

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

Autre risque de prix (suite)

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree	5 172 020

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree	4 973 371

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021[~]

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	52 043	(43 113)	8 930	17,30
Total	52 043	(43 113)	8 930	17,30

au 31 décembre 2020[~]

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	50 174	(24 885)	25 289	49,6
Total	50 174	(24 885)	25 289	49,6

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 893 000 \$ (2 529 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	51 965	-	-	51 965
Dérivés, nets	-	(1 256)	-	(1 256)
Total	51 965	(1 256)	-	50 709

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	50 123	-	-	50 123
Dérivés, nets	-	359	-	359
Total	50 123	359	-	50 482

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	436 578	264 695
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	444	1 153
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	37	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	1 182	799
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	2 133
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	438 241	268 780
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	19
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	2 799
Frais de gestion à payer	73	28
Comptes créditeurs et charges à payer	50	16
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	123	2 862
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	438 118	265 918

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts non couvertes	438 118	265 918	33,37	29,55	13 129 440

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	4 832	4 619
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	37 859	(20 367)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(6 435)	(2 560)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	36 256	(18 308)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(3)	(2)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	3	-
Rabais sur frais	78	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	9	-
Total des autres revenus	87	(2)
Total des revenus	36 343	(18 310)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	336	272
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	170	28
Frais du comité d'examen indépendant	1	7
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	-	-
Taxe de vente harmonisée	31	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	538	307
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(7)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	35 805	(18 610)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts non couvertes	35 805	(18 610)	3,54	(2,07)	10 111 923	8 976 648

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	265 918	231 232
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	35 805	(18 610)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(12 336)	(3 648)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(81)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(12 417)	(3 648)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	289 260	46 060
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	10 079	-
Acquisition des actifs de fonds dissous	19 058	-
Rachat de parts rachetables	(169 585)	(10 624)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	148 812	35 436
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	172 200	13 178
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	438 118	244 410

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	35 805	(18 610)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(37 859)	20 367
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	170	28
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	6 435	2 560
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	214 239	115 325
Achat de placements et de dérivés	(387 409)	(118 099)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(383)	(463)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	45	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(3)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(168 960)	1 105
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(5 138)	(2 004)
Produit de l'émission de parts rachetables	175 498	521
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 189)	(136)
Acquisition des actifs de fonds dissous	80	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	168 251	(1 619)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(709)	(514)
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	1 153	918
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	444	405
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	4 449	4 156
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
	39 234	Cogeco Communications inc.	4 455 754	4 755 553	
	250 520	Québecor inc., catégorie B	8 407 594	8 282 191	
	351 267	Rogers Communications Inc., catégorie B	21 912 195	23 148 495	
	613 114	Shaw Communications Inc., catégorie B	22 166 100	22 016 924	
			56 941 643	58 203 163	13,28
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
	53 818	La Société Canadian Tire Limitée, catégorie A	9 475 045	10 556 939	
	41 169	Dollarama Inc.	2 222 532	2 335 929	
	80 169	Meubles Léon Limitée	1 860 769	1 803 803	
	176 924	Magna International Inc.	17 508 279	20 305 567	
			31 066 625	35 002 238	7,99
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
	292 631	Alimentation Couche-Tard inc., catégorie B	12 219 057	13 329 342	
	130 711	Empire Co. Ltd., catégorie A	5 503 856	5 110 800	
	20 577	Jamieson Wellness Inc.	759 827	695 503	
	150 193	Metro inc.	8 558 662	8 925 970	
	73 769	North West Co. Inc. (The)	2 630 994	2 595 931	
	294 540	Saputo inc.	10 906 492	10 889 144	
			40 578 888	41 546 690	9,48
ÉNERGIE					
	391 810	Inter Pipeline Ltd.	7 261 676	7 894 972	
	348 889	Corporation TC Énergie	22 562 775	21 400 851	
			29 824 451	29 295 823	6,69
SERVICES FINANCIERS					
	173 109	Banque de Montréal	19 836 032	21 995 230	
	272 847	La Banque de Nouvelle-Écosse	21 535 049	21 996 925	
	152 613	Banque Canadienne Impériale de Commerce	19 484 226	21 535 220	
	252 618	CI Financial Corp.	4 906 996	5 747 060	
	6 975	Equitable Group Inc.	961 488	927 884	
	8 749	goeasy Ltd.	973 969	1 387 854	
	458 506	Société financière IGM Inc.	20 437 731	20 064 223	
	15 710	Onex Corp.	1 235 971	1 414 057	
	175 564	Banque Royale du Canada	20 708 080	22 049 083	
	251 909	La Banque Toronto-Dominion	20 941 528	21 883 335	
			131 021 070	139 000 871	31,73
PRODUITS INDUSTRIELS					
	2 195	Boyd Group Services Inc.	469 556	495 148	
	163 106	Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	21 444 708	21 332 634	
	153 607	Chemin de fer Canadien Pacifique Limitée	12 530 177	14 641 819	
	13 660	Richelieu Hardware Ltd.	539 156	548 039	
	67 041	Ritchie Bros. Auctioneers Inc.	4 652 028	4 926 843	
	110 694	Métaux Russel Inc.	3 817 033	3 749 206	
	32 778	TFI International Inc.	2 623 934	3 709 486	
	36 588	Industries Toromont Limitée	3 242 552	3 951 504	
	71 265	Waste Connections Inc.	9 753 560	10 554 347	
			59 072 704	63 909 026	14,59
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
	2 412	Constellation Software Inc.	3 936 172	4 528 313	
	21 689	Enghouse Systems Ltd.	1 203 373	1 197 016	
	186 279	Thomson Reuters Corp.	19 881 969	22 936 533	
			25 021 514	28 661 862	6,54

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX					
	1 222 372	B2Gold Corp.	7 732 236	6 356 334	
	74 974	CCL Industries Inc., catégorie B	4 838 602	5 118 475	
	107 685	Dundee Precious Metals Inc.	930 811	808 714	
	63 501	Intertape Polymer Group Inc.	1 450 444	1 825 019	
	150 685	Kirkland Lake Gold Ltd.	7 380 841	7 198 222	
	399 175	Lundin Mining Corp.	4 728 681	4 462 776	
	66 031	Pan American Silver Corp.	2 544 283	2 337 497	
	33 842	Stella-Jones Inc.	1 607 717	1 510 368	
	137 600	Ressources Teck Limitée, catégorie B	3 822 921	3 928 480	
	42 133	West Fraser Timber Co. Ltd.	3 871 649	3 749 416	
	7 504	Winpak Ltd.	325 882	290 180	
			39 234 067	37 585 481	8,58
IMMOBILIER					
	149 988	WPT Industrial REIT	3 382 332	3 373 230	0,77
Total des actions			416 143 294	436 578 384	99,65
Ajustement au titre des coûts de transaction			(91 050)		
Total des placements			416 052 244	436 578 384	99,65
Autres actifs (passifs) nets				1 539 210	0,35
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				438 117 594	100,00

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	142	s.o.
Paiements indirects [†]	40	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	9 000 000	8 100 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	8 900 000	1 800 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Émission de parts rachetables liée à l'acquisition des actifs de fonds dissous	579 440	-
Parts rachetables rachetées	(5 350 000)	(450 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	13 129 440	9 450 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,210

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	-	-
Garanties (hors trésorerie)	-	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	5	-
Charges	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres	3	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	40,1	-

Participations dans des parties liées (note 9)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

Placements	2021
CI Financial Corp.	5 747

Placements	2020
	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Produits industriels	20,7
Services financiers	17,5
Matériaux	13,3
Énergie	11,5
Biens de consommation de base	10,7
Biens de consommation discrétionnaire	10,1
Services de communication	8,6
Technologies de l'information	6,8
Autres actifs (passifs) nets	0,5
Immobilier	0,3
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions canadiennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Canada.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree	43 178 891

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree	26 393 297

Risque de change

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, les placements du Fonds étaient libellés en dollars canadiens, la monnaie fonctionnelle du Fonds. Par conséquent, le Fonds n'avait aucune exposition au risque de change.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Hierarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	436 578	-	-	436 578
Total	436 578	-	-	436 578

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	264 695	-	-	264 695
Total	264 695	-	-	264 695

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	23 555	25 191
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	315	86
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	57	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	6	-
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	166
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	23 933	25 443
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	42
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	296
Frais de gestion à payer	11	12
Comptes créditeurs et charges à payer	-	8
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	11	358
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	23 922	25 085

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts couvertes	15 746	13 720	28,63	24,95	550 000
Parts non couvertes	8 176	11 365	27,25	25,26	300 000	450 000

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	442	839
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 298	(9 508)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	1 275	(900)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	3 015	(9 569)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(2)	(54)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	1	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	15	-
Total des autres revenus	14	(54)
Total des revenus	3 029	(9 623)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	66	142
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	15	14
Frais du comité d'examen indépendant	1	2
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	23	121
Taxe de vente harmonisée	9	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	114	279
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(2)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 915	(9 900)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts couvertes	2 186	(6 908)	3,97	(6,48)	550 000	1 065 385
Parts non couvertes	729	(2 993)	2,22	(3,24)	328 177	923 077

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	13 720	34 256	11 365	25 620	25 085	59 875
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 186	(6 908)	729	(2 993)	2 915	(9 901)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(160)	(226)	(87)	(222)	(247)	(448)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	-	-	-	-	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(160)	(226)	(87)	(222)	(247)	(448)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 013	-	1	-	1 014
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(6 161)	(3 831)	(4 047)	(3 831)	(10 208)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	-	(5 148)	(3 831)	(4 046)	(3 831)	(9 194)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 026	(12 282)	(3 189)	(7 261)	(1 163)	(19 543)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	15 746	21 974	8 176	18 359	23 922	40 332

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 915	(9 901)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 298)	9 508
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(1)	(13)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	15	14
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(1 275)	900
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	5 059	11 286
Achat de placements et de dérivés	(797)	(8 562)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(6)	(65)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	(2)	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(8)	(17)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	4 602	3 150
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(543)	(425)
Produit de l'émission de parts rachetables	-	1 014
Montant versé au rachat de parts rachetables	(3 831)	(3 608)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	(4 374)	(3 019)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	1	13
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	228	131
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	86	13
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	315	157
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	414	653
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
AUTRICHE					
EUR	802	Andritz AG	49 024	55 801	0,23
BELGIQUE					
EUR	1 240	Barco NV	27 440	42 027	
EUR	529	Bekaert SA	24 665	29 194	
EUR	209	Fagron NV	6 309	5 779	
EUR	380	Melexis NV	39 314	48 856	
EUR	2 612	Solvay SA	360 914	411 189	
EUR	1 279	UCB SA	145 688	165 583	
EUR	855	Umicore SA	43 193	64 662	
			647 523	767 290	3,21
FINLANDE					
EUR	1 089	Cargotec OYJ	54 945	69 725	
EUR	1 161	Fiskars OYJ Abp	24 801	31 268	
EUR	1 580	Huhtamaki OYJ	95 308	92 693	
EUR	2 843	Kemira OYJ	47 627	55 443	
EUR	7 682	Kone OYJ, catégorie B	680 875	776 135	
EUR	1 696	Konecranes OYJ	78 581	88 465	
EUR	1 427	Metso Outotec OYJ	13 526	20 528	
EUR	8 428	Neles OYJ	179 402	150 498	
EUR	161	Revenio Group OYJ	9 524	15 108	
EUR	4 122	Valmet Corp.	128 921	222 635	
			1 313 510	1 522 498	6,36
FRANCE					
EUR	2 454	Air Liquide SA	394 910	532 122	
EUR	326	Arkema	45 511	50 650	
EUR	42	bioMérieux	4 897	6 044	
EUR	642	Compagnie Générale des Établissements Michelin, série B, actions nominatives	107 848	126 804	
EUR	4 937	Danone	456 181	430 432	
EUR	203	Dassault Systèmes S.A.	31 346	60 963	
EUR	243	Gaztransport & Technigaz SA	18 266	24 301	
EUR	145	Hermès International	115 778	261 588	
EUR	873	Imerys SA	66 433	50 511	
EUR	155	Ipsos	6 420	8 092	
EUR	311	Kering	208 398	336 590	
EUR	896	Legrand SA	84 331	117 446	
EUR	1 699	L'Oréal SA	533 779	937 614	
EUR	976	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA	420 668	947 812	
EUR	951	Pernod Ricard SA	194 233	261 433	
EUR	1 508	Publicis Groupe	116 190	119 450	
EUR	54	Rémy Cointreau S.A.	8 574	13 806	
EUR	1 014	Rubis SCA	61 652	55 825	
EUR	5 993	Sanofi SA	716 121	777 631	
EUR	23	Sartorius Stedim Biotech	3 689	13 473	
EUR	3 474	Schneider Electric SE	396 457	676 876	
EUR	90	SEB SA	18 456	20 142	
EUR	456	Société BIC SA	56 215	39 241	
EUR	88	Teleperformance	19 211	44 235	
EUR	433	Vicat SA	29 333	25 911	
EUR	271	Wendel SE	34 447	45 129	
			4 149 344	5 984 121	25,01
ALLEMAGNE					
EUR	8 293	BASF SE	886 199	809 124	
EUR	8 936	Bayer AG, actions nominatives	981 507	672 004	
EUR	3 428	Bayerische Motoren Werke (BMW) AG	389 804	449 588	
EUR	249	Beiersdorf AG	35 914	37 206	

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
ALLEMAGNE (suite)					
EUR	689	Brenntag SE	49 371	79 345	
EUR	873	Continental AG	195 057	158 942	
EUR	723	Covestro AG	58 986	57 822	
EUR	2 878	Daimler AG, actions nominatives	241 955	318 244	
EUR	29 479	Deutsche Telekom AG, actions nominatives	648 898	771 081	
EUR	296	Duerr AG	17 673	13 944	
EUR	30	Eckert & Ziegler AG	1 904	4 245	
EUR	3 381	Evonik Industries AG	139 694	140 410	
EUR	1 074	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	122 571	110 465	
EUR	1 899	Fresenius SE & Co. KGaA	152 639	122 688	
EUR	354	GEA Group AG	17 448	17 758	
EUR	702	Hannover Rueckversicherungs SE	126 045	145 458	
EUR	474	Hapag-Lloyd AG	43 866	135 107	
EUR	325	HeidelbergCement AG	34 524	34 525	
EUR	798	Henkel AG & Co. KGaA	109 748	90 995	
EUR	1 884	Infineon Technologies AG	52 351	93 568	
EUR	580	Knorr-Bremse AG	93 273	82 618	
EUR	64	Krones AG	7 912	7 082	
EUR	253	Lanxess AG	22 047	21 482	
EUR	165	Merck KGaA	23 670	39 180	
EUR	4 174	SAP SE	617 004	728 432	
EUR	3 889	Siemens AG, actions nominatives	636 480	763 103	
EUR	2 865	Siemens Healthineers AG	164 506	217 431	
EUR	145	Siltronic AG	16 928	30 279	
EUR	241	Software AG	13 343	13 427	
EUR	230	Symrise AG	24 710	39 686	
EUR	42	Wacker Chemie AG	6 089	8 021	
			5 932 116	6 213 260	25,97
IRLANDE					
EUR	10 255	CRH PLC	482 824	640 027	
EUR	4 702	Glanbia PLC	76 469	94 528	
EUR	653	Kerry Group PLC, catégorie A	97 259	112 962	
			656 552	847 517	3,54
ITALIE					
EUR	351	Carel Industries SPA	9 674	10 438	
EUR	2 389	Davide Campari-Milano NV	29 988	39 626	
EUR	726	Ferrari NV	155 311	185 507	
EUR	146	Reply SPA	22 550	29 716	
			217 523	265 287	1,11
PAYS-BAS					
EUR	2 389	Akzo Nobel NV	305 158	365 559	
EUR	660	ASM International NV	107 305	268 471	
EUR	1 663	ASML Holding NV	505 393	1 414 963	
EUR	783	BE Semiconductor Industries NV	34 316	82 259	
EUR	281	Corbion NV	11 590	19 890	
EUR	789	EXOR NV	63 379	78 278	
EUR	237	IMCD Group NV	39 739	46 671	
EUR	22 266	Koninklijke Ahold Delhaize NV	725 466	819 730	
EUR	1 618	Koninklijke DSM NV	246 293	373 988	
EUR	1 660	Koninklijke Vopak NV	108 497	93 364	
EUR	3 547	SBM Offshore NV	78 926	66 750	
EUR	2 488	Wolters Kluwer NV	235 458	309 535	
			2 461 520	3 939 458	16,47

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
ESPAGNE					
EUR	14 327	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	512 484	475 276	
EUR	2 754	CIE Automotive SA	80 981	100 944	
EUR	2 977	Grifols SA	116 932	99 850	
EUR	47 010	Prosegur Cash SA	80 165	59 162	
EUR	17 075	Prosegur Compania de Seguridad SA, actions nominatives	74 801	69 206	
EUR	964	Viscofan SA	81 090	83 239	
			946 453	887 677	3,71
SUISSE					
EUR	2 048	STMicroelectronics NV	53 058	92 044	0,38
R.-U.					
EUR	4 309	Linde PLC	1 408 076	1 539 861	
EUR	19 869	Unilever PLC	1 473 092	1 440 354	
			2 881 168	2 980 215	12,46
Total des actions			19 307 791	23 555 168	98,45
Ajustement au titre des coûts de transaction			(39 007)		
Total des placements			19 268 784	23 555 168	98,45
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				57 063	0,24
Autres actifs (passifs) nets				310 422	1,31
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				23 922 653	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devises achetées	Position	Devises vendues	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	07 juillet 2021	CAD	15 374 188	EUR	10 430 000	1,47	57 063
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								57 063

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

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

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(42)	-	-	(42)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(42)	-	-	(42)

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	3	s.o.
Paiements indirects [†]	1	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2021	2020	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	550 000	1 250 000	450 000	1 000 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	50 000	-	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(350 000)	(150 000)	(200 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	550 000	950 000	300 000	800 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,550*
Parts non couvertes	0,550

*Le 23 juin 2021, le taux des frais de gestion annuels des parts couvertes est passé de 0,58 % à 0,55 %.

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	25	-
Garanties (hors trésorerie)	27	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	1	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	1	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Matériaux	23,8
Biens de consommation de base	19,5
Produits industriels	18,7
Biens de consommation discrétionnaire	11,6
Technologies de l'information	10,8
Soins de santé	10,0
Services de communication	3,6
Services financiers	1,2
Énergie	1,0
Services publics	0,3
Total de la perte latente sur le(s) contrat(s) de change à terme	(0,2)
Autres actifs (passifs) nets	(0,3)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions européennes et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale en Europe.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total d'actions européennes couvert WisdomTree	2 337 532

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total d'actions européennes couvert WisdomTree	2 498 265

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Euro	23 565	(15 317)	8 248	34,5
Dollar américain	10	-	10	0,0
Total	23 575	(15 317)	8 258	34,5

Parts couvertes

au 31 décembre 2020~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Euro	13 871	(13 843)	28	0,2
Dollar américain	4	-	4	0,0
Total	13 875	(13 843)	32	0,2

Parts non couvertes

au 31 décembre 2020~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Euro	11 490	-	11 490	101,1
Dollar américain	3	-	3	0,0
Total	11 493	-	11 493	101,1

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 826 000 \$ (1 152 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

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

FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	23 555	-	-	23 555
Dérivés, nets	-	57	-	57
Total	23 555	57	-	23 612

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	25 190	-	-	25 190
Dérivés, nets	-	(42)	-	(42)
Total	25 190	(42)	-	25 148

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	67 926	41 197
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	214	1 142
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	260	76
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	3	769
Montant à recevoir pour la souscription de parts	37 912	-
	106 315	43 184
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	21 833	1 692
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	171
Frais de gestion à payer	15	13
Comptes créditeurs et charges à payer	10	39
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	21 858	1 915
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	84 457	41 269

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts non couvertes	84 457	41 269	29,12	27,51	2 900 000

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 030	699
Intérêts aux fins des distributions	-	(1)
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(360)	(522)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 628	(4 646)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	3 298	(4 470)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(8)	(10)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	13	-
Total des autres revenus	5	(10)
Total des revenus	3 303	(4 480)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	86	67
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	153	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	126	79
Taxe de vente harmonisée	19	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	385	152
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(1)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 918	(4 631)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts non couvertes	2 918	(4 631)	1,83	(3,34)	1 596 133	1 385 165

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	41 269	35 476
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 918	(4 631)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(524)	(406)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	-	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(524)	(406)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	40 794	2 739
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	40 794	2 739
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	43 188	(2 298)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	84 457	33 178

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 918	(4 631)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	360	522
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(14)	(3)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	153	5
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 628)	4 646
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	3 685	1 596
Achat de placements et de dérivés	(7 393)	(2 758)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(184)	(156)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	(6)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(28)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(3 129)	(785)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(696)	(718)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 883	1 531
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	2 187	813
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	14	3
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(942)	28
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	1 142	121
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	214	152
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	720	465
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	(1)
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
BRÉSIL					
BRL	3 606	AES Brasil Energia S.A.	13 022	12 387	
BRL	49 368	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	214 317	204 065	
BRL	11 177	Banco Bradesco SA	76 624	60 406	
BRL	17 354	Banco do Brasil SA	138 000	137 557	
BRL	7 647	Banco Santander (Brasil) SA	76 205	76 674	
BRL	16 761	CCR SA	67 302	55 591	
BRL	5 012	Centrais Elétricas Brasileiras S.A.	43 846	53 370	
BRL	3 055	Cia Saneamento Basico de Sao Paulo NPV	41 471	27 578	
BRL	3 327	Companhia de Locação das Américas	23 662	22 603	
BRL	3 057	Companhia de Saneamento do Paraná	26 900	15 661	
BRL	4 852	Cosan SA	21 287	28 557	
BRL	3 213	CPFL Energia SA	22 617	21 297	
BRL	4 206	Cyrela Brazil Realty S.A. Empreendimentos e Participações	34 078	24 558	
BRL	3 952	EDP - Energias do Brasil SA	23 270	17 321	
BRL	3 910	Engie Brasil Energia SA	47 659	37 766	
BRL	4 510	Equatorial Energia SA	26 654	27 691	
BRL	11 576	Itaúsa SA	47 256	32 595	
BRL	7 907	JBS SA	42 202	56 958	
BRL	1 118	Localiza Rent a Car SA	14 050	17 658	
BRL	2 039	Lojas Renner SA	29 445	22 382	
BRL	10 821	Petrobras Distribuidora SA	82 075	71 139	
BRL	1 568	Porto Seguro SA	23 693	20 690	
BRL	2 103	Sul America SA	21 114	17 988	
BRL	5 848	TIM SA	18 460	16 654	
BRL	8 547	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	73 754	77 999	
BRL	53 172	Vale SA	822 430	1 483 281	
BRL	3 126	WEG SA	13 164	25 951	
BRL	1 830	YDUQS Part	20 134	14 799	
			2 104 691	2 681 176	3,17
CHILI					
CLP	97 565	AES Gener SA	30 083	16 563	
CLP	622 052	Banco de Chile	85 663	76 689	
CLP	535	Banco de Credito e Inversiones	33 084	28 207	
CLP	527 585	Banco Santander Chile	39 644	32 580	
CLP	8 118	Cencosud Shopping SA	16 290	16 581	
CLP	1 577	Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.	13 003	10 835	
CLP	607 114	Enel Americas SA	127 821	111 306	
CLP	6 963	Parque Arauco S.A.	14 220	12 197	
			359 808	304 958	0,36
CHINE					
HKD	77 009	Agile Group Holdings Ltd.	132 769	123 531	
CNY	117 300	Agricultural Bank of China Ltd.	79 038	68 114	
HKD	790 995	Agricultural Bank of China Ltd.	386 000	340 545	
CNY	3 827	Anhui Conch Cement Co. Ltd.	31 397	30 107	
HKD	31 264	Anhui Conch Cement Co. Ltd., catégorie H	235 061	205 390	
HKD	2 506	ANTA Sports Products Ltd. Sports Products Ltd.	49 277	73 046	
CNY	31 200	Bank of Beijing Co. Ltd.	33 801	29 119	
CNY	35 933	Bank of China Ltd.	25 374	21 210	
CNY	39 919	Bank of Communications Co. Ltd.	45 107	37 486	
CNY	5 389	Bank of Hangzhou Co. Ltd., catégorie A	13 979	15 233	
CNY	26 300	Bank of Jiangsu Co. Ltd.	31 825	35 786	
CNY	8 809	Bank of Nanjing Co. Ltd.	14 413	17 760	
CNY	20 400	Bank of Shanghai Co. Ltd.	34 020	32 058	
CNY	19 166	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd.	24 152	28 062	
HKD	72 732	Beijing Jingneng Clean Energy Co. Ltd.	26 546	21 687	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
CHINE (suite)					
HKD	54 171	Central China Management Co. Ltd.	16 124	19 781	
HKD	54 171	Central China Real Estate Ltd.	28 249	17 448	
HKD	46 825	China Aoyuan Group Ltd.	57 846	48 905	
HKD	291 505	China Cinda Asset Management Co. Ltd.	78 370	68 793	
HKD	80 584	China Coal Energy Co., catégorie H	40 725	59 493	
HKD	17 996	China Conch Venture Holdings Ltd.	93 420	93 834	
CNY	15 758	China Construction Bank Corp.	21 353	20 083	
HKD	2 363 173	China Construction Bank Corp., catégorie H	2 432 984	2 302 361	
CNY	48 000	China Everbright Bank Co. Ltd.	37 539	34 772	
HKD	29 967	China Feihe Ltd.	91 192	80 086	
CNY	13 100	China Fortune Land Development Co. Ltd.	41 830	13 155	
HKD	53 492	China Galaxy Securities Co.	40 648	39 492	
HKD	41 188	China Hongqiao Group Ltd.	50 867	69 091	
HKD	18 011	China Lesso Group Holdings Ltd.	36 450	55 026	
HKD	123 240	China Life Insurance Co. Ltd., catégorie H	352 177	302 628	
HKD	33 542	China Lilang Ltd.	28 981	26 956	
HKD	29 547	China Longyuan Power Group Corp.	43 462	63 039	
HKD	26 860	China Medical System Holdings Ltd.	60 703	87 586	
CNY	17 800	China Merchants Bank Co. Ltd.	125 767	184 857	
HKD	71 386	China Merchants Bank Co. Ltd., catégorie H	622 377	754 112	
CNY	8 500	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	27 193	17 837	
CNY	56 000	China Minsheng Banking Corp. Ltd.	59 264	47 328	
HKD	68 658	China National Building Material Co. Ltd., catégorie H	92 774	99 844	
CNY	3 307	China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd.	21 442	18 360	
HKD	58 817	China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd., catégorie H	256 278	229 308	
HKD	67 585	China Sanjiang Fine Chemicals Co. Ltd.	29 999	33 947	
HKD	67 532	China SCE Group Holdings Ltd.	37 268	34 351	
CNY	9 358	China Shenhua Energy Co. Ltd.	33 582	35 007	
HKD	148 831	China Shipping Container Lines Co. Ltd., catégorie H	29 436	39 395	
CNY	200	China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd.	11 044	11 502	
CNY	6 916	China Vanke Co. Ltd.	37 332	31 558	
HKD	31 839	China Vanke Co. Ltd.	138 981	123 368	
HKD	19 388	China Yuhua Education Corp. Ltd.	22 099	21 733	
HKD	94 682	CIFI Holdings Group Co. Ltd.	90 294	91 491	
CNY	5 756	CITIC Securities Co. Ltd.	26 454	27 511	
HKD	26 105	CITIC Securities Co. Ltd., catégorie H	79 175	81 087	
HKD	58 266	COFCO Meat Holdings Ltd.	27 976	28 894	
HKD	184 299	Country Garden Holdings Co.	300 146	255 670	
HKD	2 880	Country Garden Services Holdings Co. Ltd.	29 498	38 529	
HKD	14 718	CSC Financial Co. Ltd., catégorie H	24 332	22 084	
HKD	89 783	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	153 208	160 915	
HKD	42 495	Dali Foods Group Co. Ltd.	31 864	31 373	
CNY	20 379	Daqin Railway Co. Ltd.	30 452	25 698	
HKD	42 887	Dongyue Group	36 430	44 450	
HKD	9 347	ENN Energy Holdings Ltd.	174 968	220 284	
CNY	520	Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd.	16 140	12 851	
HKD	30 487	Fosun International	54 412	54 349	
HKD	49 929	Fufeng Group Ltd.	24 079	19 824	
CNY	2 388	Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd.	11 082	25 560	
HKD	7 344	Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd.	46 612	64 056	
CNY	6 675	Gemdale Corp.	16 094	13 099	
HKD	32 735	Genertec Universal Medical Group Co. Ltd.	34 369	39 618	
CNY	4 600	GF Securities Co. Ltd.	15 258	13 347	
HKD	28 645	GF Securities Co. Ltd.	48 864	45 950	
HKD	42 402	Great Wall Motor Co. Ltd., catégorie H	104 881	169 706	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
CHINE (suite)					
HKD	54 345	Greatview Aseptic Packaging Co. Ltd.	31 107	30 329	
CNY	3 000	Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai	34 624	29 954	
HKD	69 706	Greenland (Hong Kong) Holdings Ltd.	29 706	27 787	
CNY	4 200	Guotai Junan Securities Co. Ltd.	13 922	13 796	
HKD	18 724	Guotai Junan Securities Co. Ltd., catégorie H	33 800	32 961	
HKD	6 759	Haitian International Holdings Ltd.	23 531	28 075	
HKD	13 669	Hengan International Group Co. Ltd.	130 367	113 338	
CNY	2 300	Hengli Petrochemical Co. Ltd.	16 227	11 566	
HKD	80 628	Huaneng Power International Inc., série H	47 511	39 084	
CNY	5 174	Huatai Securities Co. Ltd.	18 371	15 667	
HKD	16 051	Huatai Securities Co. Ltd., catégorie H	32 935	29 177	
CNY	2 600	Huayu Automotive Systems Co. Ltd.	15 775	13 090	
CNY	76 200	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	79 213	75 499	
HKD	1 829 749	Industrial & Commercial Bank of China, catégorie H	1 509 888	1 330 433	
CNY	20 069	Industrial Bank Co. Ltd.	70 241	79 038	
CNY	4 971	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd.	28 957	35 087	
HKD	35 655	Jiangsu Expressway Co. Ltd., catégorie H	54 199	49 974	
CNY	400	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd.	16 368	15 883	
HKD	13 668	Jiangxi Copper Co. Ltd., série H	33 699	34 653	
CNY	10 500	Jinke Properties Group Co. Ltd.	16 559	11 651	
CNY	230	Kweichow Moutai Co. Ltd.	57 091	90 656	
HKD	65 541	KWG Group Holdings Ltd.	109 550	108 688	
HKD	200 155	Lenovo Group Ltd.	239 655	285 007	
HKD	6 020	Li Ning Co. Ltd.	62 585	91 000	
HKD	4 710	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	27 932	28 727	
HKD	26 987	Logan Property Holdings Co. Ltd.	53 477	50 003	
CNY	2 482	Lomon Billions Group Co. Ltd.	12 710	16 448	
HKD	31 362	Longfor Group Holdings Ltd.	205 370	217 535	
HKD	89 712	Lonking Holdings Ltd.	36 230	35 906	
CNY	396	Luzhou Laojiao Co. Ltd.	6 451	17 906	
HKD	128 885	Metallurgical Corp. of China Ltd.	35 936	37 198	
HKD	11 171	Midea Real Estate Holding Ltd.	32 092	29 284	
HKD	5 151	Minth Group Ltd.	26 155	30 308	
HKD	18 048	New China Life Insurance Co. Ltd.	88 416	76 263	
HKD	169 395	People's Insurance Co. (Group) of China Ltd.	69 590	69 958	
CNY	3 555	Ping An Bank Co. Ltd.	12 547	15 411	
CNY	10 000	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	150 142	123 189	
HKD	83 504	Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd.	1 129 288	1 012 613	
CNY	17 427	Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.	50 161	40 211	
HKD	220 691	Postal Savings Bank of China Co. Ltd.	172 659	184 045	
HKD	42 314	Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	37 461	45 004	
CNY	5 465	SAIC Motor Corp. Ltd.	26 310	23 010	
CNY	4 727	SANY Heavy Industry Co. Ltd.	13 677	26 335	
HKD	45 994	Seazen Group Ltd.	53 386	53 978	
CNY	2 200	Seazen Holdings Co. Ltd.	14 821	17 539	
CNY	10 100	Shaanxi Coal Industry Co. Ltd.	21 366	22 937	
HKD	9 830	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd.	23 669	28 402	
HKD	4 526	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co. Ltd.	34 548	45 250	
HKD	17 813	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd.	47 189	48 173	
CNY	28 300	Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd.	60 518	54 235	
HKD	27 564	Shenzhen Expressway Co. Ltd., catégorie H	36 908	32 964	
HKD	4 329	Shenzhen International Group	104 490	135 364	
HKD	71 723	Sinotrans Ltd.	32 808	36 940	
HKD	8 096	Sinotruk (Hong Kong) Ltd.	21 650	21 481	
HKD	46 988	Sunac China Holdings Ltd.	231 722	199 674	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
CHINE (suite)					
HKD	2 915	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	80 283	114 064	
CNY	9 000	TCL Technology Group Corp.	16 542	13 195	
HKD	7 210	Tencent Holdings Ltd.	569 718	671 405	
HKD	10 905	Tianneng Power International Ltd.	16 108	23 614	
HKD	31 183	Times China Holdings Ltd.	54 875	44 154	
HKD	28 992	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	63 364	71 655	
HKD	1 195	Tsingtao Brewery Co. Ltd.	13 575	15 930	
HKD	28 878	Uni-President China Holdings Ltd.	39 299	39 463	
CNY	1 263	Wanhua Chemical Group Co. Ltd.	12 120	26 340	
HKD	157 732	Want Want China Holdings Ltd.	149 507	138 331	
HKD	16 091	Weichai Power Co. Ltd., catégorie H	39 888	44 285	
CNY	8 093	Wens Foodstuffs Group Co. Ltd.	38 572	22 288	
CNY	728	Wuliangye Yibin Co. Ltd.	14 555	41 561	
HKD	8 610	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd., catégorie H	22 094	16 667	
HKD	36 892	Xinyi Energy Holdings Ltd.	25 017	27 236	
HKD	31 233	Xinyi Solar Holdings Ltd.	55 549	83 469	
HKD	40 238	Xtep International Holdings Ltd.	55 248	93 932	
CNY	538	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd.	10 829	11 931	
CNY	5 010	Yutong Bus Co. Ltd., catégorie A	16 790	11 992	
HKD	76 643	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	36 128	24 320	
HKD	42 208	Zhenro Properties Group Ltd.	31 979	29 209	
HKD	32 747	Zhongliang Holdings Group Co. Ltd.	27 207	25 012	
HKD	2 814	Zhongsheng Group Holdings Ltd.	26 756	28 986	
CNY	8 243	Zijin Mining Group Co. Ltd.	11 707	15 308	
HKD	51 073	Zijin Mining Group Co. Ltd.	53 810	85 022	
HKD	27 149	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	35 632	35 195	
			14 729 815	14 773 764	17,49
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE					
CZK	5 971	CEZ AS	182 343	219 323	
CZK	1 880	O2 Czech Republic AS	28 715	28 574	
			211 058	247 897	0,29
HONG KONG					
HKD	9 321	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	47 062	40 947	
HKD	87 445	China Everbright Environment Group Ltd.	77 960	61 351	
HKD	18 287	China Gas Holdings Ltd.	76 592	69 108	
HKD	9 387	Chine Mengniu Dairy Co. Ltd.	59 849	70 275	
HKD	172 142	China Power International Development Ltd.	49 349	46 663	
HKD	1 605	China Resources Beer (Holdings) Co. Ltd.	11 738	17 851	
HKD	89 113	China Resources Cement Holding Ltd.	120 034	104 866	
HKD	8 907	China Resources Gas Group Ltd.	64 602	66 184	
HKD	59 138	China Resources Land Ltd.	323 053	296 569	
HKD	45 563	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	83 622	77 011	
HKD	28 933	China Water Affairs Group Ltd.	28 811	27 589	
HKD	31 660	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd.	61 720	89 557	
HKD	37 054	CIMC Enric Holdings Ltd.	38 521	47 740	
HKD	84 388	Citic 1616 Holdings Ltd.	37 493	34 582	
HKD	31 883	Geely Automobile Holdings Ltd.	101 588	124 301	
HKD	53 703	Guangdong Investment Ltd.	116 602	95 565	
HKD	160 000	Guotai Junan International Holdings Ltd.	32 236	31 636	
HKD	13 218	Hopson Development Holdings Ltd.	58 883	75 033	
HKD	85 845	Kingboard Holdings Ltd.	515 877	589 970	
HKD	19 308	Kingboard Laminates Holding Ltd.	39 375	53 632	
HKD	95 547	Kunlun Energy Co. Ltd.	109 990	109 085	
HKD	22 573	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd.	21 006	21 272	
HKD	23 286	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	32 641	36 982	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
HONG KONG (suite)					
HKD	40 000	Perfect Medical Health Management Ltd.	36 819	59 827	
HKD	15 706	Shanghai Industrial Holdings Ltd.	28 684	28 700	
HKD	59 233	Shenzhen International Holdings Ltd.	120 022	101 439	
HKD	95 105	Shenzhen Investment Ltd.	40 600	36 244	
HKD	23 673	Shimao Group Holdings Ltd.	89 218	71 872	
HKD	209 268	Shougang Fushan Resources Group Ltd.	67 712	76 414	
HKD	31 566	Sino Biopharmaceutical Ltd.	36 992	38 354	
HKD	34 443	SITC International Holdings Co. Ltd.	101 241	178 218	
HKD	205 344	WH Group Ltd.	235 687	228 547	
HKD	29 024	Xinyi Glass Holdings Co. Ltd.	91 222	146 476	
HKD	32 294	Yuexiu Property Co. Ltd.	43 550	42 122	
			3 000 351	3 195 982	3,78
HONGRIE					
HUF	15 713	Magyar Telekom Telecommunications PLC, actions nominatives	27 440	28 068	
HUF	1 236	Richter Gedeon Nyrt.	36 224	40 797	
			63 664	68 865	0,08
INDE					
INR	4 311	Adani Ports and Special Economic Zone Ltd.	43 227	50 539	
INR	855	AIA Engineering Ltd.	30 911	30 484	
INR	462	Alkem Laboratories Ltd.	24 129	24 624	
INR	1 732	Amara Raja Batteries Ltd.	25 291	21 498	
INR	9 337	Apollo Tyres Ltd.	32 163	34 999	
INR	1 336	Asian Paints Ltd.	52 906	66 609	
INR	1 792	Aurobindo Pharma Ltd.	29 341	28 815	
INR	1 245	Bajaj Auto Ltd.	76 828	85 740	
INR	484	Bajaj Finance Ltd.	46 670	48 507	
INR	1 250	Balkrishna Industries Ltd.	40 475	46 630	
INR	20 887	Bharat Electronics Ltd.	50 553	61 938	
INR	18 867	Bharat Petroleum Corp. Ltd.	140 500	147 131	
INR	2 697	Britannia Industries Ltd.	166 996	163 981	
INR	12 036	Castrol (India) Ltd.	27 316	28 694	
INR	6 931	Chambal Fertilizers and Chemicals Ltd.	31 605	35 402	
INR	2 178	Cipla Ltd.	33 237	35 265	
INR	2 078	Colgate-Palmolive (India) Ltd.	57 488	58 360	
INR	2 016	Coromandel International Ltd.	29 192	30 257	
INR	2 943	Cummins India Ltd.	35 049	44 101	
INR	3 332	Cyient Ltd.	37 311	47 716	
INR	604	Divi's Laboratories Ltd.	41 723	44 357	
INR	490	Dr. Reddy's Laboratories Ltd.	44 284	44 269	
INR	568	Eicher Motors Ltd.	27 179	25 276	
INR	22 101	Engineers India Ltd.	30 061	29 308	
INR	7 978	Exide Industries Ltd.	25 618	24 236	
INR	68 546	Gail (India) Ltd.	167 580	170 892	
INR	1 978	Grasim Industries Ltd.	37 801	49 388	
INR	19 020	Gujarat Pipavav Port Ltd.	34 555	35 726	
INR	6 062	HCL Technologies Ltd.	81 590	99 324	
INR	546	HDFC Asset Management Co. Ltd.	27 326	26 537	
INR	6 995	Heidelbergcement India Ltd.	28 582	29 442	
INR	1 678	Hero MotoCorp Ltd.	83 098	81 141	
INR	6 698	Hindalco Industries Ltd.	34 122	41 515	
INR	1 903	Hindustan Aeronautics Ltd.	30 114	32 394	
INR	22 223	Hindustan Petroleum Corp. Ltd.	104 909	108 550	
INR	6 868	Hindustan Unilever Ltd.	271 571	282 760	
INR	9 683	Hindustan Zinc Ltd.	47 184	54 734	
INR	7 401	Housing Development Finance Corp. Ltd.	301 104	305 191	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		INDE (suite)			
INR	12 076	Indiabulls Housing Finance Ltd.	51 029	52 518	
INR	20 559	Indus Towers Ltd.	94 639	81 738	
INR	40 187	Infosys Technologies Ltd.	845 106	1 058 338	
INR	82 604	ITC Ltd.	318 659	278 944	
INR	4 502	JSW Steel Ltd.	34 499	51 293	
INR	431	Larsen & Toubro Infotech Ltd.	28 588	29 233	
INR	6 466	Larsen & Toubro Ltd.	158 355	161 640	
INR	5 092	LIC Housing Finance Ltd.	35 875	39 870	
INR	1 663	Mahanagar Gas Ltd.	31 879	31 486	
INR	5 579	Marico Ltd.	43 303	49 334	
INR	551	Maruti Suzuki India Ltd.	69 699	68 991	
INR	11 816	Motherson Sumi Systems Ltd.	39 163	47 657	
INR	1 847	Mphasis Ltd.	46 946	65 670	
INR	1 241	Muthoot Finance Ltd.	28 111	30 632	
INR	105 345	National Hydroelectric Power Corp. Ltd.	46 141	45 981	
INR	218	Nestlé India Ltd.	57 480	64 039	
INR	29 764	NMDC Ltd.	73 381	91 287	
INR	89 002	NTPC Ltd.	163 053	172 590	
INR	131 811	Oil and Natural Gas Corp. Ltd.	236 669	258 458	
INR	24 710	Oil India Ltd.	62 621	64 712	
INR	1 004	Oracle Financial Services Software Ltd.	58 062	61 075	
INR	19 280	Petronet LNG Ltd.	81 832	72 526	
INR	946	Piramal Enterprises Ltd.	31 856	37 796	
INR	115 414	Power Grid Corp. of India Ltd.	421 328	446 844	
INR	46 793	REC Ltd.	110 288	115 802	
INR	4 295	Reliance Industries Ltd.	129 095	151 022	
INR	182	Sanofi India Ltd.	24 944	23 262	
INR	57 373	SJVN Ltd.	25 733	26 667	
INR	4 660	Sonata Software Ltd.	43 961	57 977	
INR	4 866	Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	46 374	54 755	
INR	3 017	Sun TV Network Ltd.	26 086	26 626	
INR	890	Sundaram Finance Ltd.	33 375	39 657	
INR	879	Supreme Industries Ltd.	28 898	31 694	
INR	4 114	Tata Chemicals Ltd.	41 290	49 607	
INR	7 350	Tata Consultancy Services Ltd.	354 396	409 678	
INR	31 935	Tata Power Co. Ltd.	52 774	64 960	
INR	2 413	Tata Tea Ltd.	27 481	30 326	
INR	5 476	Tech Mahindra Ltd.	86 850	99 935	
INR	1 383	Timken India Ltd.	32 736	33 854	
INR	1 017	Titan Industries Ltd.	28 352	29 353	
INR	5 348	Torrent Power Ltd.	34 670	40 993	
INR	262	Ultra Tech Cement Ltd.	27 182	29 576	
INR	3 760	UPL Ltd.	44 702	49 664	
INR	1 920	Voltas Ltd.	31 402	32 704	
INR	11 277	Welspun Gujarat Stahl Rohren Ltd.	26 723	26 884	
INR	3 243	Wipro Ltd.	25 282	29 480	
INR	30 319	YES BANK Ltd.	19 826	6 844	
			6 790 283	7 400 302	8,76
		INDONÉSIE			
IDR	272 611	Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat dan Banten, TBKPT	35 560	28 170	
IDR	440 243	PT Astra International TBK	228 947	185 728	
IDR	86 221	PT Bank Central Asia TBK	227 515	221 819	
IDR	474 498	PT Bank Mandiri (Persero) TBK	255 890	239 081	
IDR	148 737	PT Bank Negara Indonesia (Persero) TBK	76 653	58 811	
IDR	1 096 883	PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) TBK	369 483	369 074	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
INDONÉSIE (suite)					
IDR	64 405	PT Charoen Pokphand Indonesia TBK	35 712	34 376	
IDR	39 854	PT Indocement Tungal Prakarsa TBK	50 477	35 056	
IDR	40 705	PT Indofood CBP Sukses Makmur TBK	32 156	28 331	
IDR	83 321	PT Indofood Sukses Makmur TBK	50 310	43 939	
IDR	245 314	PT Perusahaan Gas Negara TBK	31 190	21 055	
IDR	288 402	PT Sarana Menara Nusantara TBK	24 477	30 541	
IDR	1 234 265	PT Telkom Indonesia (Persero) TBK	367 193	332 029	
IDR	127 241	PT Unilever Indonesia TBK	78 260	53 789	
IDR	38 256	PT United Tractors TBK	75 603	66 158	
			1 939 426	1 747 957	2,07
MALAISIE					
MYR	34 055	Alliance Bank Malaysia Berhad	29 160	24 480	
MYR	43 793	AMMB Holdings BHD	46 422	38 534	
MYR	121 481	Astro Malaysia Holdings BHD	42 988	41 670	
MYR	49 835	Axiata Group BHD	49 843	55 594	
MYR	6 904	British American Tobacco Malaysia BHD	36 192	29 407	
MYR	13 644	Bursa Malaysia BHD	35 890	32 273	
MYR	5 582	Carlsberg Brewery Malaysia BHD	37 018	36 963	
MYR	40 523	Dialog Group BHD	41 469	34 932	
MYR	91 246	DiGi.Com BHD	123 010	112 405	
MYR	27 621	Gamuda BHD	27 612	25 787	
MYR	13 809	Hap Seng Consolidated BHD	36 251	32 128	
MYR	17 841	Hong Leong Bank BHD	96 759	99 620	
MYR	52 224	IJM Corp. BHD	27 329	27 883	
MYR	31 374	Inari Amertron BHD	22 719	29 665	
MYR	43 817	IOI Corp. BHD	56 179	49 142	
MYR	7 188	Kuala Lumpur Kepong BHD	47 964	43 652	
MYR	120 855	Malakoff Corp. BHD	32 258	29 379	
MYR	136 853	Malaysia Building Society BHD	23 740	24 696	
MYR	30 923	Maxis BHD	48 175	40 492	
MYR	24 062	Petronas Chemicals Group BHD	58 562	57 848	
MYR	25 548	Petronas Gas BHD	129 264	118 116	
MYR	30 298	Press Metal Aluminium Holdings BHD	41 521	43 198	
MYR	11 868	Scientex BHD	15 214	14 797	
MYR	656	Scientex BHD, bons de souscription, 14 janvier 2026	-	247	
MYR	88 633	Sime Darby BHD	61 780	57 633	
MYR	58 502	Telekom Malaysia BHD	93 200	105 921	
MYR	54 887	Tenaga Nasional BHD	190 194	160 278	
MYR	10 681	TIME dotCom BHD	41 083	44 794	
MYR	44 463	Top Glove Corp. BHD	93 521	55 304	
MYR	10 950	United Plantations BHD	47 733	44 746	
MYR	22 739	Westports Holdings BHD	30 185	28 554	
			1 663 235	1 540 138	1,82
MEXIQUE					
MXN	46 210	Alfa SAB de CV, série A	52 550	42 879	
MXN	11 820	Alpek SA de CV	13 946	18 025	
MXN	156 692	America Movil SAB de CV, série L	156 263	146 178	
MXN	3 624	Arca Continental SAB de CV	24 719	26 001	
MXN	7 039	Bolsa Mexicana de Valores SA	20 413	19 262	
MXN	6 452	Coca-Cola FEMSA SAB de CV	41 881	42 334	
MXN	8 405	Corporacion Inmobiliaria Vesta SAB de CV	19 275	20 303	
MXN	1 237	GRUMA SAB de CV, catégorie B	16 973	17 238	
MXN	38 957	Grupo México SAB de CV, série B	137 173	227 652	
MXN	26 390	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, série A	59 666	58 118	
MXN	19 767	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV	30 464	30 316	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MEXIQUE (suite)					
MXN	3 317	Megacable Holdings SAB de CV	15 737	14 608	
MXN	12 329	Orbia Advance Corp. SAB de CV	35 428	39 957	
MXN	1 891	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	22 010	18 720	
MXN	22 733	Wal-Mart de Mexico SAB de CV, série V	84 370	92 055	
			730 868	813 646	0,96
PHILIPPINES					
PHP	33 321	Aboitiz Equity Ventures Inc.	42 087	35 628	
PHP	38 274	Aboitiz Power Corp.	28 772	23 739	
PHP	1 517	Ayala Corp.	31 360	30 786	
PHP	24 133	Bank of the Philippine Islands	52 243	54 301	
PHP	1 103	Globe Telecom Inc.	56 235	51 483	
PHP	19 168	International Container Terminal Services Inc.	69 129	79 597	
PHP	73 367	LT Group Inc.	25 178	24 008	
PHP	7 728	Manila Electric Co.	61 858	54 342	
PHP	209 066	Metro Pacific Investments Corp.	22 655	20 630	
PHP	24 531	Metropolitan Bank & Trust Co.	29 128	30 305	
PHP	3 842	PLDT Inc.	127 765	126 017	
PHP	44 960	Robinsons Land Corp.	23 347	19 708	
PHP	1 388	SM Investments Corp.	35 261	35 192	
PHP	37 342	SM Prime Holdings Inc.	36 194	34 575	
PHP	10 616	Universal Robina Corp.	40 653	38 914	
			681 865	659 225	0,78
POLOGNE					
PLN	1 785	Asseco Poland SA	38 637	44 794	
PLN	4 975	Cyfrowy Polsat SA	47 609	48 449	
PLN	3 112	Polski Koncern Naftowy Orlen SA	89 612	77 720	
PLN	15 304	Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	28 563	33 213	
			204 421	204 176	0,24
RUSSIE					
USD	5 257	Magnit PJSC, CIAE	98 018	94 424	
USD	4 013	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC, CIAE, actions nominatives	44 674	53 370	
USD	29 265	MMC Norilsk Nickel PJSC, CAAE	1 068 971	1 234 658	
USD	13 271	Mobile TeleSystems PJSC, CAAE	150 224	152 174	
USD	823	NovaTek PJSC, CIAE	210 616	223 493	
USD	2 767	Novolipetsk Steel PJSC, CIAE	89 906	107 931	
USD	3 407	Phosagro OAO, CIAE	58 083	85 390	
USD	1 063	PJSC Polyus, CIAE	101 945	127 353	
USD	50 411	Rosneft Oil Co., CIAE	368 100	483 161	
USD	151 301	Sberbank of Russia PJSC, CAAE	2 748 376	3 111 047	
USD	7 219	Tatneft PAO, CAAE	519 441	389 932	
USD	15 517	VTB Bank, CIAE	22 727	25 556	
			5 481 081	6 088 489	7,21
AFRIQUE DU SUD					
ZAR	4 378	AECI Ltd.	36 212	37 326	
ZAR	4 855	African Rainbow Minerals Ltd.	93 270	107 513	
ZAR	721	Anglo Platine Américain Ltd.	88 894	103 133	
ZAR	13 244	AVI Ltd.	91 205	81 605	
ZAR	9 521	Coronation Fund Managers Ltd.	37 971	40 046	
ZAR	24 436	Equites Property Fund Ltd.	37 477	40 010	
ZAR	11 457	Exxaro Resources Ltd.	154 857	167 340	
ZAR	7 490	Gold Fields Ltd.	84 166	83 403	
ZAR	18 301	Impala Platinum Holdings Ltd.	314 803	373 752	
ZAR	3 414	JSE Ltd.	31 847	31 473	
ZAR	2 628	Kumba Iron Ore Ltd.	122 352	145 996	
ZAR	10 074	MultiChoice Group	105 430	102 514	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
AFRIQUE DU SUD (suite)					
ZAR	490	Naspers Ltd., catégorie N	131 300	127 406	
ZAR	13 282	Remgro Ltd.	136 289	132 003	
ZAR	51 397	Sanlam Ltd.	270 590	273 546	
ZAR	6 924	Shoprite Holdings Ltd.	92 963	93 337	
ZAR	10 151	Sibanye Stillwater Ltd.	47 642	52 520	
ZAR	3 474	Spar Group Ltd. (The)	58 219	54 498	
ZAR	22 905	Vodacom Group Ltd.	251 228	255 788	
			2 186 715	2 303 209	2,73
CORÉE DU SUD					
KRW	116	Amorepacific Corp.	31 051	32 143	
KRW	153	BGF Retail Co. Ltd.	27 308	30 199	
KRW	8 555	BNK Financial Group Inc.	67 445	72 716	
KRW	1 418	Cheil Worldwide Inc.	38 030	39 214	
KRW	64	CJ CheilJedang Corp.	32 434	32 442	
KRW	764	Daesang Corp.	23 057	23 312	
KRW	1 685	Daishin Securities Co. Ltd.	31 009	36 593	
KRW	437	DB HiTek Co. Ltd.	23 015	29 984	
KRW	737	DB Insurance Co. Ltd.	45 196	44 410	
KRW	5 956	DGB Financial Group Inc.	54 270	60 907	
KRW	156	DL E&C Co. Ltd.	24 051	24 358	
KRW	107	DL Holdings Co. Ltd.	17 789	9 412	
KRW	983	Dongsuh Cos. Inc.	27 225	32 967	
KRW	713	Doosan Bobcat Inc.	31 589	37 632	
KRW	127	E-MART Inc.	21 120	22 344	
KRW	473	Green Cross Holdings Corp.	22 205	17 736	
KRW	1 776	GS Engineering & Construction Corp.	71 431	83 778	
KRW	617	Halla Holdings Corp.	31 669	33 312	
KRW	8 611	Hana Financial Group Inc.	386 431	436 027	
KRW	688	Hankook Tire & Technology Co. Ltd.	32 685	39 112	
KRW	2 029	Hanon Systems	32 387	36 924	
KRW	160	Hansol Chemical Co. Ltd.	34 751	43 192	
KRW	1 088	Hanwha Corp.	34 586	37 984	
KRW	908	Huchems Fine Chemical Corp.	24 476	23 263	
KRW	399	Hyosung Corp.	40 005	45 190	
KRW	353	Hyundai Department Store Co. Ltd.	30 880	33 925	
KRW	910	Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd.	45 032	58 336	
KRW	224	Hyundai Glovis Co. Ltd.	44 782	51 478	
KRW	2 852	Hyundai Greenfood Co. Ltd.	29 442	33 712	
KRW	1 021	Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd.	30 309	28 628	
KRW	2 302	HYUNDAI MOTOR SECURITIES Co. Ltd.	36 746	35 184	
KRW	5 539	Industrial Bank of Korea	71 155	63 951	
KRW	4 981	JB Financial Group Co. Ltd.	34 427	41 242	
KRW	970	KEPCO Plant Service & Engineering Co. Ltd.	40 839	45 704	
KRW	2 950	Kia Corp.	210 265	290 643	
KRW	499	Kolon Industries Inc.	31 369	44 334	
KRW	755	Korea Investment Holdings Co. Ltd.	72 206	85 509	
KRW	12 753	Korea REIT Co. Ltd.	30 335	33 094	
KRW	211	Korea Zinc Co. Ltd.	102 555	100 114	
KRW	3 285	Korean Reinsurance Co.	32 065	35 580	
KRW	2 431	KT Corp.	73 966	85 004	
KRW	3 296	KT&G Corp.	330 998	305 886	
KRW	78	LG Chem Ltd.	52 168	72 903	
KRW	1 641	LG Corp.	168 132	184 953	
KRW	469	LG Electronics Inc.	59 930	84 318	
KRW	33	LG Household & Health Care Ltd.	56 286	63 937	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
CORÉE DU SUD (suite)					
KRW	3 781	LG Uplus Corp.	60 901	63 818	
KRW	369	LOTTE Fine Chemical Co. Ltd.	23 551	26 779	
KRW	342	LS Industrial Systems Co. Ltd.	23 745	21 022	
KRW	795	LX Holdings Co. Ltd.	10 375	9 834	
KRW	14 964	Macquarie Korea Infrastructure Fund	196 671	206 500	
KRW	1 603	Meritz Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	31 405	35 958	
KRW	8 547	Meritz Securities Co. Ltd.	42 130	44 500	
KRW	4 537	Mirae Asset Securities Co. Ltd.	43 316	47 045	
KRW	104	Naver Corp.	32 770	47 744	
KRW	84	NCsoft Corp.	65 204	75 740	
KRW	3 858	NH Investment & Securities Co. Ltd.	53 302	54 724	
KRW	2 306	PARTRON Co. Ltd.	28 320	26 371	
KRW	1 470	POSCO	480 036	562 506	
KRW	1 605	POSCO DAEWOO Corp.	34 022	41 121	
KRW	320	S-1 Corp.	32 195	28 818	
KRW	884	Samjin Pharmaceutical Co. Ltd.	26 988	26 877	
KRW	247	Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd.	39 579	48 073	
KRW	55 384	Samsung Electronics Co. Ltd.	3 998 299	4 914 593	
KRW	611	Samsung Fire & Marine Insurance	158 469	148 142	
KRW	1 587	Samsung Life Insurance Co. Ltd.	134 965	139 255	
KRW	67	Samsung SDI Co. Ltd.	41 850	51 423	
KRW	278	Samsung SDS Co. Ltd.	60 659	56 552	
KRW	1 618	Samsung Securities Co. Ltd.	71 511	79 972	
KRW	413	Silicon Works Co. Ltd.	42 050	55 222	
KRW	2 895	SK Hynix Inc.	325 002	405 871	
KRW	830	SK Telecom Co. Ltd.	263 620	292 050	
KRW	206	SKC Co. Ltd.	30 001	35 903	
KRW	4 695	SsangYong C&E Co. Ltd.	36 594	43 107	
KRW	282	Yuhan Corp.	19 317	19 566	
			9 195 949	10 712 672	12,68
TAÏWAN					
TWD	11 136	AcBel Polytech Inc.	13 677	12 868	
TWD	4 780	Accton Technology Corp.	42 298	70 211	
TWD	23 145	Acer Inc.	20 508	30 139	
TWD	3 556	Advantech Co. Ltd.	44 583	54 524	
TWD	4 144	Arcadyan Technology Corp.	17 700	19 614	
TWD	24 412	ASE Industrial Holding Co. Ltd.	71 008	121 514	
TWD	58 746	Asia Cement Corp.	110 406	132 371	
TWD	12 939	Asustek Computer Inc.	130 379	213 632	
TWD	5 582	Aten International Co. Ltd.	21 654	21 037	
TWD	38 145	Capital Securities Corp.	16 017	28 735	
TWD	9 570	Catcher Technology Co. Ltd.	93 234	77 409	
TWD	79 834	Cathay Financial Holding Co. Ltd.	143 735	191 242	
TWD	24 794	Chang Hwa Commercial Bank	20 623	17 796	
TWD	4 703	Charoen Pokphand Enterprise (Taiwan) Co. Ltd.	14 880	16 847	
TWD	13 111	Cheng Loong Corp.	11 696	28 261	
TWD	14 798	Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd.	27 275	30 746	
TWD	7 461	Cheng Uei Precision Industry Co. Ltd.	14 450	14 010	
TWD	15 190	Chicony Electronics Co. Ltd.	54 313	54 277	
TWD	4 663	Chicony Power Technology Co. Ltd.	14 860	15 004	
TWD	4 067	Chilisin Electronics Corp.	20 665	18 256	
TWD	206 279	China Development Financial Holding Corp.	82 098	120 555	
TWD	22 494	China Life Insurance Co. Ltd.	19 595	26 342	
TWD	4 134	China Steel Chemical Corp.	20 098	21 037	
TWD	11 004	ChipMOS TECHNOLOGIES INC.	18 210	23 279	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TAÏWAN (suite)					
TWD	6 693	Chong Hong Construction Co. Ltd.	24 109	23 559	
TWD	1 810	Chroma Ate Inc.	12 009	15 405	
TWD	28 489	Chunghwa Telecom Co. Ltd.	135 695	144 340	
TWD	2 155	Cleanaway Co. Ltd.	14 168	15 899	
TWD	42 591	Compal Electronics Inc.	35 286	42 306	
TWD	10 433	Compeq Manufacturing Co. Ltd.	22 358	19 474	
TWD	301 160	CTBC Financial Holding Co. Ltd.	261 582	303 829	
TWD	10 083	CTCI Corp.	16 911	17 566	
TWD	12 527	Da Cin Construction Co. Ltd.	14 927	19 291	
TWD	16 509	Delta Electronics Inc.	122 648	222 315	
TWD	70 532	E.Sun Financial Holding Co. Ltd.	74 113	82 442	
TWD	1 421	Eclat Textile Co. Ltd.	23 363	41 429	
TWD	4 477	Elan Microelectronics Corp.	18 710	38 700	
TWD	3 951	Elite Material Co. Ltd.	23 373	38 280	
TWD	15 165	Eternal Chemical Co. Ltd.	18 260	27 296	
TWD	23 467	EVA Airways Corp.	11 483	21 015	
TWD	8 422	EVERLIGHT Electronics Co. Ltd.	17 241	19 726	
TWD	15 957	Far Eastern Department Stores Ltd.	14 269	16 134	
TWD	34 565	Far Eastern International Bank	16 437	16 284	
TWD	45 816	Far Eastern New Century Corp.	59 660	65 159	
TWD	26 678	Far EastOne Telecommunications Co. Ltd.	80 681	76 593	
TWD	8 073	Farglory Land Development Co. Ltd.	17 250	19 124	
TWD	8 336	Feng Hsin Iron & Steel Co. Ltd.	18 828	30 120	
TWD	2 371	Feng Tay Enterprise Co. Ltd.	18 796	25 764	
TWD	91 530	First Financial Holding Co. Ltd.	84 927	92 341	
TWD	48 480	Formosa Chemicals & Fibre Corp.	211 228	182 495	
TWD	13 602	Formosa Petrochemical Corp.	62 728	64 381	
TWD	51 186	Formosa Plastics Corp.	229 480	234 312	
TWD	1 787	Foxsemicon Integrated Technology Inc.	18 626	18 942	
TWD	96 111	Fubon Financial Holding Co. Ltd.	185 856	315 663	
TWD	1 833	Fusheng Precision Co. Ltd.	14 221	17 067	
TWD	9 567	Getac Technology Corp.	19 587	23 385	
TWD	1 285	Giant Manufacturing Co. Ltd.	12 313	18 189	
TWD	4 538	Gigabyte Technology Co. Ltd.	10 343	21 681	
TWD	2 690	Grape King BIO Ltd.	20 977	20 623	
TWD	13 492	Great Wall Enterprise Co. Ltd.	22 742	36 038	
TWD	6 466	Greatek Electronics Inc.	15 099	22 645	
TWD	764	Hiwin Technologies Corp.	15 563	13 412	
TWD	4 863	Holtek Semiconductor Inc.	15 076	21 613	
TWD	143 701	Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	497 973	715 292	
TWD	1 703	Hotai Motor Co. Ltd.	36 268	46 472	
TWD	56 945	Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	46 280	46 694	
TWD	8 239	Huaku Development Co. Ltd.	31 483	31 124	
TWD	42 964	IBF Financial Holdings Co. Ltd.	20 749	31 506	
TWD	42 356	Inventec Co. Ltd.	44 395	49 414	
TWD	4 277	ITE Technology Inc.	14 203	23 095	
TWD	19 928	King Yuan Electronics Co. Ltd.	26 667	39 766	
TWD	13 162	King's Town Bank	23 441	23 311	
TWD	2 461	Kung Long Batteries Industrial Co. Ltd.	15 984	16 461	
TWD	619	Largan Precision Co. Ltd.	88 297	85 282	
TWD	8 734	Lien Hwa Industrial Corp.	11 951	19 408	
TWD	49 262	Lite-On Technology Corp.	101 626	126 107	
TWD	618	LOTES Co. Ltd.	14 654	16 040	
TWD	16 503	Macronix International Co. Ltd.	23 728	33 519	
TWD	2 054	Makalot Industrial Co. Ltd.	14 413	25 012	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TAÏWAN (suite)					
TWD	3 783	MediaTek Inc.	61 849	161 740	
TWD	119 954	Mega Financial Holding Co. Ltd.	153 152	175 128	
TWD	1 376	Merida Industry Co. Ltd.	16 574	19 141	
TWD	3 813	Merry Electronics Co. Ltd.	24 800	17 878	
TWD	7 942	Micro-Star International Co. Inc.	31 217	55 593	
TWD	43 934	Nan Ya Plastics Corp.	142 253	162 454	
TWD	5 325	Nantex Industry Co. Ltd.	14 592	33 961	
TWD	7 212	Nanya Technology Corp.	21 234	25 546	
TWD	7 624	Nichidenbo Corp.	15 710	20 500	
TWD	1 451	Nien Made Enterprise Co. Ltd.	19 641	26 665	
TWD	6 045	Novatek Microelectronics Corp. Ltd.	52 284	134 061	
TWD	12 718	Pan-International Industrial Corp.	19 380	22 496	
TWD	49 404	Pegatron Corp.	128 423	151 062	
TWD	30 026	Pou Chen Corp.	44 036	52 444	
TWD	13 645	Powertech Technology Inc.	48 594	65 191	
TWD	6 146	President Chain Store Corp.	78 276	71 838	
TWD	15 949	President Securities Corp.	11 489	18 961	
TWD	8 524	Primax Electronics Ltd.	17 665	21 594	
TWD	27 405	Prince Housing & Development Corp.	13 058	14 494	
TWD	9 361	Promate Electronic Co. Ltd.	15 672	17 286	
TWD	19 550	Qisda Corp.	17 286	26 761	
TWD	45 253	Quanta Computer Inc.	122 317	175 979	
TWD	3 836	Realtek Semiconductor Corp.	46 840	86 095	
TWD	7 969	Ruentex Development Co. Ltd.	14 732	20 046	
TWD	6 965	Ruentex Industries Ltd.	22 740	27 209	
TWD	13 261	Sanyang Motor Co. Ltd.	14 448	17 799	
TWD	4 212	Sercomm Corp.	14 694	12 879	
TWD	47 259	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. (The)	93 879	95 041	
TWD	116 402	Shin Kong Financial Holding Co. Ltd.	43 893	49 301	
TWD	2 213	Sinbon Electronics Co. Ltd.	12 818	26 949	
TWD	15 844	Sinon Corp.	12 913	15 844	
TWD	209 910	SinoPac Financial Holdings Co.	104 474	128 275	
TWD	1 911	Sitronix Technology Corp.	11 657	26 583	
TWD	10 340	Standard Foods Corp.	27 870	24 861	
TWD	1 651	Sunny Friend Environmental Technology Co. Ltd.	17 351	15 409	
TWD	8 540	Supreme Electronics Co. Ltd.	11 317	15 277	
TWD	3 774	Syncmold Enterprise Corp.	13 258	13 989	
TWD	26 845	Synnex Technology International Corp.	46 770	60 728	
TWD	5 650	System Corp.	18 647	22 700	
TWD	90 848	Taishin Financial Holdings Co. Ltd.	53 487	61 573	
TWD	45 304	Taiwan Business Bank	22 667	19 027	
TWD	94 930	Taiwan Cement Corp.	163 530	215 169	
TWD	8 277	Taiwan Cogeneration Corp.	10 446	14 236	
TWD	71 218	Taiwan Cooperative Financial Holding	61 101	67 260	
TWD	11 959	Taiwan Fertilizer Co. Ltd.	27 527	31 305	
TWD	23 259	Taiwan High Speed Rail Corp.	35 706	30 908	
TWD	7 145	Taiwan Hon Chuan Enterprise Co. Ltd.	17 177	24 419	
TWD	21 351	Taiwan Mobile Co. Ltd.	102 028	96 789	
TWD	4 745	Taiwan Paiho Ltd.	16 527	21 510	
TWD	6 537	Taiwan Secom	26 811	27 338	
TWD	133 465	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1 666 907	3 529 313	
TWD	21 081	Taiwan Styrene Monomer Corp.	18 710	20 237	
TWD	2 548	Taiwan Surface Mounting Technology Corp.	14 396	13 702	
TWD	18 063	Teco Electric & Machinery Co. Ltd.	18 528	26 652	
TWD	5 470	Test Research Inc.	14 399	14 489	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TAÏWAN (suite)					
TWD	2 203	Thinking Electronic Industrial Co. Ltd.	19 259	19 484	
TWD	4 210	Topco Scientific Co. Ltd.	18 343	23 388	
TWD	9 612	Tripod Technology Corp.	45 526	57 670	
TWD	12 993	Tung Ho Steel Enterprise Corp.	17 508	30 316	
TWD	9 990	U-Ming Marine Transport Corp.	13 656	39 559	
TWD	5 707	Unimicon Technology Corp.	9 530	32 719	
TWD	66 268	Uni-President Enterprises Corp.	205 319	215 586	
TWD	3 399	United Integrated Services Co. Ltd.	31 658	32 101	
TWD	92 943	United Microelectronics Corp.	66 847	219 340	
TWD	16 431	USI Corp.	12 978	27 092	
TWD	514	Voltronic Power Technology Corp.	14 834	30 725	
TWD	6 005	Wah Lee Industrial Corp.	16 437	21 964	
TWD	20 292	Walsin Lihwa Corp.	14 533	26 424	
TWD	2 922	Walsin Technology Corp.	23 464	29 544	
TWD	12 752	Wan Hai Lines Ltd.	14 850	181 924	
TWD	69 017	Wistron Corp.	80 761	95 088	
TWD	750	WiWynn Corp.	17 713	33 232	
TWD	22 441	WPG Holdings Co. Ltd.	39 850	50 965	
TWD	2 794	Yageo Corp.	43 082	68 917	
TWD	19 552	YFY Inc.	16 768	39 711	
TWD	79 584	Yuanta Financial Holding Co. Ltd.	62 571	94 968	
TWD	2 997	Yulon Finance Corp.	13 287	18 980	
TWD	1 617	Yulon Nissan Motor Co. Ltd.	18 449	19 511	
TWD	9 274	YungShin Global Holding Corp.	18 243	18 135	
TWD	2 259	Zeng Hsing Industrial Co. Ltd.	13 824	16 716	
			8 784 037	12 920 790	15,30
THAÏLANDE					
THB	18 145	Advanced Info Service Public Co. Ltd.	126 004	119 881	
THB	37 631	Airports of Thailand PCL	88 395	90 144	
THB	96 969	AP (Thailand) PCL	30 955	31 284	
THB	35 305	Bangkok Commercial Asset Management PCL	27 694	25 372	
THB	134 568	BTS Group Holdings PCL	50 979	48 613	
THB	6 189	Bumrungrad Hospital Public Co. Ltd.	27 786	30 727	
THB	40 724	C.P. All Public Co. Ltd.	96 094	94 406	
THB	5 366	Carabao Group PCL	27 565	29 336	
THB	13 439	Central Pattana Public Co. Ltd.	24 597	27 260	
THB	53 723	Charoen Pokphand Foods Public Co. Ltd.	56 999	55 005	
THB	3 308	Delta Electronics (Thailand) PCL	49 476	73 874	
THB	4 449	Electricity Generating Public Co. Ltd.	30 861	30 081	
THB	10 691	Global Power Synergy Co. Ltd.	27 031	30 154	
THB	30 246	Gulf Energy Development PCL	43 982	40 025	
THB	55 193	Home Product Center PCL	31 207	30 707	
THB	33 909	Intouch Holdings PCL	79 486	85 158	
THB	13 459	Krungthai Card PCL	40 494	34 841	
THB	79 228	Noble Development PCL	25 011	22 499	
THB	22 417	Osotspa PCL	31 168	32 696	
THB	53 832	Pruksa Holding PCL	25 595	28 702	
THB	43 521	PTT Exploration and Production Public Co. Ltd.	173 835	196 736	
THB	263 406	Quality Houses PCL	23 456	23 204	
THB	11 988	Ratchaburi Group PCL	23 352	21 190	
THB	231 388	SC Asset Corp. PCL	25 137	27 714	
THB	5 168	Siam Cement Public Co. Ltd. (The)	79 027	86 259	
THB	38 788	Siam Commercial Bank PCL, NVDR	126 500	146 866	
THB	32 208	SPCG PCL	25 347	23 395	
THB	13 017	Srisawad Corp. PCL	30 522	34 577	

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
THAÏLANDE (suite)					
THB	32 411	Supalai Public Co. Ltd.	24 094	25 796	
THB	55 990	Thai Union Frozen Products Public Co. Ltd.	39 390	42 833	
THB	18 105	Thai Vegetable Oil Public Co. Ltd.	24 629	22 909	
THB	25 758	Thanachart Capital PCL	32 085	34 334	
THB	36 939	Tipco Asphalt PCL	28 877	27 402	
THB	20 621	Tisco Financial Group Public Co. Ltd.	65 975	70 510	
THB	211 818	TPI Polene Power PCL	37 184	36 173	
THB	268 372	True Corp. PCL	32 209	32 973	
THB	55 036	TTW PCL	26 668	24 879	
THB	20 152	Vinythai PCL	28 937	29 198	
THB	223 157	WHA Corp. PCL	25 634	27 590	
			1 814 237	1 895 303	2,24
TURQUIE					
TRY	13 313	Aksa Akriklik Kimya Sanayii AS	31 473	28 426	
TRY	15 419	Enerjisa Enerji Anonim Sirketi	23 870	22 747	
TRY	35 516	Enka Insaat ve Sanayi A.S.	43 967	47 232	
TRY	18 052	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	39 062	46 316	
TRY	2 946	Ford Otomotiv Sanayi AS	56 658	71 470	
TRY	24 945	Haci Omer Sabanci Holding AS	39 559	31 609	
TRY	357	Otokar Otomotiv ve Savunma Sanayi AS	20 931	14 146	
TRY	7 872	TAV Havalimanlari Holding AS	28 645	26 615	
TRY	6 951	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	32 129	29 268	
TRY	21 551	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	59 709	49 457	
			376 003	367 286	0,43
Total des actions			60 317 507	67 925 835	80,43
OBLIGATIONS					
INDE					
INR	42,978	Britannia Industries Ltd., 5.5%, June 03, 2024	207	208	0,00
Total des obligations			207	208	0,00
		Ajustement au titre des coûts de transaction	(52 090)		
Total des placements			60 265 624	67 926 043	80,43
		Autres actifs (passifs) nets		16 531 056	19,57
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				84 457 099	100,00

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Participation dans des entités structurées non consolidées (note 2)

Les tableaux suivants présentent la participation du Fonds dans des entités structurées non consolidées.

au 30 juin 2021

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
	-	-	-

au 31 décembre 2020

Entités structurées non consolidées	Juste valeur du (des) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Juste valeur du placement du Fonds dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (en milliers de dollars)	Participation dans le(s) fonds / FNB sous-jacent(s) (%)
Fonds d'infrastructure Macquarie Korea	4 349 263	88	-

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	28	s.o.
Paiements indirects [†]	8	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts non couvertes	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 500 000	1 300 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	1 400 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	2 900 000	1 400 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†] Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts non couvertes	0,380

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	39	-
Garanties (hors trésorerie)	41	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Taiwan	25,0
Chine	21,0
Corée du Sud	12,8
Inde	8,0
Russie	7,6
Hong Kong	5,7
Brésil	5,4
Afrique du Sud	2,7
Indonésie	2,6
Thaïlande	2,5
Malaisie	2,1
Mexique	1,8
Philippines	0,8
Chili	0,7
Turquie	0,5
République tchèque	0,3
Pologne	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Hongrie	0,1
Singapour	0,0
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de crédit puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions mondiales et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique à l'échelle mondiale.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de dividendes de marchés émergents WisdomTree	4 938 375

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de dividendes de marchés émergents WisdomTree	4 092 732

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar taïwanais	12 969	-	12 969	15,4
Dollar de Hong Kong	9 133	-	9 133	10,8
Roupie indienne	7 413	-	7 413	8,8
Won coréen	5 932	-	5 932	7,0
Dollar américain	3 839	-	3 839	4,5
Réal brésilien	2 692	-	2 692	3,2
Renminbi chinois	1 846	-	1 846	2,2
Rand sud-africain	1 262	-	1 262	1,5
Baht thaïlandais	1 044	-	1 044	1,2
Roupie indonésienne	974	-	974	1,2
Ringgit malaisien	847	-	847	1,0
Peso mexicain	815	-	815	1,0
Peso philippin	363	-	363	0,4
Peso chilien	305	-	305	0,4
Lire turque	202	-	202	0,2
Couronne tchèque	160	-	160	0,2
Zloty polonais	113	-	113	0,1
Forint hongrois	38	-	38	0,0
Total	49 947	-	49 947	59,1

au 31 décembre 2020~

Devise	Exposition aux instruments financiers (en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	Exposition nette (en milliers de dollars)	Actif net (%)
Dollar taïwanais	10 405	-	10 405	25,2
Dollar de Hong Kong	9 243	-	9 243	22,4
Won coréen	5 309	-	5 309	12,9
Dollar américain	3 146	-	3 146	7,6
Roupie indienne	2 376	-	2 376	5,8
Réal brésilien	2 235	-	2 235	5,4
Renminbi chinois	1 838	-	1 838	4,5
Rand sud-africain	1 118	-	1 118	2,7
Roupie indonésienne	1 059	-	1 059	2,6
Baht thaïlandais	1 038	-	1 038	2,5
Ringgit malaisien	875	-	875	2,1
Peso mexicain	728	-	728	1,8
Peso philippin	333	-	333	0,8
Peso chilien	304	-	304	0,7
Lire turque	196	-	196	0,5
Couronne tchèque	131	-	131	0,3
Zloty polonais	102	-	102	0,2
Forint hongrois	25	-	25	0,1
Total	40 461	-	40 461	98,1

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 4 995 000 \$ (4 046 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions.

Hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous résumant les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds qui sont comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	67 926	-	-	67 926
Total	67 926	-	-	67 926

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1 et 2 et les niveaux 1 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021.

Niveau 3 - Rapprochement

Les tableaux ci-dessous résumant le mouvement des instruments financiers classés au niveau 3.

pour la période close le 30 juin 2021

	Solde au 31 déc. 2020 (en milliers de dollars)	Achats (en milliers de dollars)	Ventes (en milliers de dollars)	Transferts entrants (en milliers de dollars)	Transferts (sortants) (en milliers de dollars)	Profit (perte) réalisé(e) (en milliers de dollars)	Profit (perte) latent(e) (en milliers de dollars)	Solde au 30 juin 2021 (en milliers de dollars)
Positions acheteur/Actifs :								
Actions	15	4	(1)	-	(9)	(2)	(7)	-
Total	15	4	(1)	-	(9)	(2)	(7)	-

Au cours de la période close le 31 juin 2021, des placements ayant une juste valeur de 9 000 \$ ont été transférés du niveau 3 au niveau 2 puisque des données observables sur le marché sont devenues disponibles pour ces placements.

pour l'exercice clos le 31 décembre 2020

	Solde au 31 déc. 2019 (en milliers de dollars)	Achats (en milliers de dollars)	Ventes (en milliers de dollars)	Transferts entrants (en milliers de dollars)	Transferts (sortants) (en milliers de dollars)	Profit (perte) réalisé(e) (en milliers de dollars)	Profit (perte) latent(e)** (en milliers de dollars)	Solde au 31 déc. 2020 (en milliers de dollars)
Positions acheteur/Actifs :								
Actions	-	23	(6)	-	-	(1)	(1)	15
Total	-	23	(6)	-	-	(1)	(1)	15

*La variation des profits (pertes) latent(e)s sur les placements détenus au 31 décembre 2020 s'est établie à (1 000 \$).

Les placements classés au niveau 3 sont évalués à la juste valeur selon des hypothèses et des données non observables, qui peuvent comprendre des écarts de taux, des multiples sectoriels et des taux d'escompte. Selon la direction, le fait de remplacer ces données par d'autres raisonnablement possibles n'aurait pas une incidence importante sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020.

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

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	192 226	79 860
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	191	204
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	128	105
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	10	3
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	114	72
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	85 903	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	86 975	-
	365 547	80 244
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	223	346
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	172 127	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	282
Frais de gestion à payer	45	24
Comptes créditeurs et charges à payer	22	8
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	172 417	660
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	193 130	79 584

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts couvertes	54 444	42 952	32,03	28,63	1 700 000
Parts non couvertes	138 686	36 632	29,70	28,18	4 670 000	1 300 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	1 879	832
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	2 106	(2 285)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	4 556	105
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	8 541	(1 348)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(33)	(16)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	4	-
Rabais sur frais	50	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	36	-
Total des autres revenus	57	(16)
Total des revenus	8 598	(1 364)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	258	163
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	224	15
Frais du comité d'examen indépendant	1	2
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	1	-
Retenues d'impôts	192	85
Taxe de vente harmonisée	24	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	700	265
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(2)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 898	(1 627)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts couvertes	5 814	(1 493)	3,67	(1,14)	1 585 083	1 304 396
Parts non couvertes	2 084	(134)	1,19	(0,14)	1 751 436	973 077

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	42 952	37 515	36 632	20 131	79 584	57 647
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 814	(1 493)	2 084	(134)	7 898	(1 627)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(469)	(280)	(531)	(220)	(1 000)	(500)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(2)	-	-	-	(2)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(471)	(280)	(531)	(220)	(1 002)	(500)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	6 149	4	103 401	5 122	109 550	5 126
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(2 685)	(2 900)	-	(2 900)	(2 685)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	6 149	(2 681)	100 501	5 122	106 650	2 441
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	11 492	(4 454)	102 054	4 768	113 546	314
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	54 444	33 061	138 686	24 899	193 130	57 961

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 898	(1 627)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(2 106)	2 285
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	(3)	(3)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	224	15
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(4 556)	(105)
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	(80 556)	7 661
Achat de placements et de dérivés	60 708	(9 989)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(42)	(42)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	21	(2)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	7	(4)
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(18 405)	(1 811)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(1 284)	(567)
Produit de l'émission de parts rachetables	22 573	5 127
Montant versé au rachat de parts rachetables	(2 900)	(2 685)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	18 389	1 875
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	3	3
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(16)	64
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	204	52
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	191	119
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 646	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	706
Intérêts payés*	(1)	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
AUSTRALIE					
AUD	582	Appen Ltd.	11 430	7 358	
AUD	1 741	ARB Corp. Ltd.	56 129	69 904	
AUD	63 454	Beach Energy Ltd.	89 495	73 148	
AUD	249 672	BHP Group Ltd.	9 869 249	11 273 510	
AUD	8 230	Bluescope Steel Ltd.	130 652	168 017	
AUD	70 836	Brambles Ltd.	720 370	753 358	
AUD	3 662	Breville Group Ltd.	98 163	101 825	
AUD	23 293	Charter Hall Group	318 575	336 077	
AUD	5 081	Codan Ltd.	70 616	85 166	
AUD	5 713	CSL Ltd.	1 379 139	1 514 676	
AUD	2 049	Domino's Pizza Enterprises Ltd.	171 195	229 555	
AUD	4 139	Elders Ltd.	44 796	44 443	
AUD	82 273	Evolution Mining Ltd.	396 410	344 184	
AUD	51 790	Goodman Group	985 877	1 019 267	
AUD	7 470	JB Hi-Fi Ltd.	349 033	351 253	
AUD	1 658	Kogan.com Ltd.	26 394	17 849	
AUD	13 095	Mineral Resources Ltd.	478 360	654 099	
AUD	3 433	Netwealth Group Ltd.	55 209	54 734	
AUD	26 050	NIB Holdings Ltd.	154 944	157 656	
AUD	13 909	Northern Star Resources Ltd.	137 937	126 461	
AUD	485	Pro Medicus Ltd.	21 040	26 476	
AUD	13 530	Ramelius Resources Ltd.	23 793	21 320	
AUD	33 467	Regis Resources Ltd.	107 077	73 426	
AUD	40 258	Rio Tinto Ltd.	4 180 424	4 739 629	
AUD	35 657	St. Barbara Ltd.	75 935	56 518	
AUD	7 504	Technology One Ltd.	58 026	64 948	
AUD	621	Wisetech Global Ltd.	18 407	18 434	
			20 028 675	22 383 291	11,59
BELGIQUE					
EUR	393	Fagron NV	11 413	10 867	
EUR	1 434	Melexis NV	173 257	184 366	
			184 670	195 233	0,10
CHINE					
HKD	261 587	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	376 272	468 834	0,24
DANEMARK					
DKK	548	Ambu AS, catégorie B	24 639	26 091	
DKK	4 649	Coloplast AS, catégorie B	830 956	944 703	
DKK	1 014	DSV Panalpina AS	217 490	292 856	
DKK	590	GN Store Nord AS	54 066	63 826	
DKK	5 787	H. Lundbeck AS	225 643	227 990	
DKK	48 734	Novo Nordisk AS, série B	4 338 969	5 056 411	
DKK	5 521	Novozymes AS, catégorie B	440 748	515 375	
DKK	8 051	Orsted AS	1 328 248	1 399 113	
DKK	1 677	Royal Unibrew A/S	215 830	264 540	
DKK	686	SimCorp AS	94 471	106 642	
DKK	13 424	Vestas Wind Systems AS	542 786	648 954	
			8 313 846	9 546 501	4,95
FINLANDE					
EUR	19 302	Kone OYJ, catégorie B	1 830 795	1 950 135	
EUR	25 332	Neste OYJ	1 648 528	1 921 010	
EUR	5 452	Orion OYJ, catégorie B	313 919	290 227	
EUR	302	Revenio Group OYJ	23 618	28 339	
EUR	1 718	Tokmanni Group Corp.	49 113	58 834	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
FINLANDE (suite)					
EUR	4 265	Uponor OYJ	128 898	153 071	
EUR	10 357	Valmet Corp.	455 641	559 396	
			4 450 512	4 961 012	2,57
FRANCE					
EUR	224	bioMérieux	38 781	32 237	
EUR	2 621	Gaztransport & Technigaz SA	300 805	262 113	
EUR	1 043	Hermes International	1 445 020	1 881 626	
EUR	10 509	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA	8 836 363	10 205 490	
EUR	125	Sartorius Stedim Biotech	56 923	73 223	
EUR	613	Trigano SA	130 269	156 813	
EUR	7 801	Verallia	326 862	358 107	
			11 135 023	12 969 609	6,72
ALLEMAGNE					
EUR	605	Bechtle AG	122 423	139 175	
EUR	980	CANCOM AG	71 896	73 396	
EUR	669	Carl Zeiss Meditec AG	141 092	160 086	
EUR	472	CompuGroup Medical SE & Co. KGaA	53 779	45 781	
EUR	1 352	Dermapharm Holding SE	107 999	133 519	
EUR	289	Eckert & Ziegler AG	30 274	40 891	
EUR	3 557	FUCHS PETROLUB SE	189 048	171 068	
EUR	24 685	Infineon Technologies AG	995 179	1 225 972	
EUR	5 067	Knorr-Bremse AG	786 654	721 766	
EUR	977	Nemetschek AG	81 177	92 568	
EUR	36 457	SAP SE	6 350 689	6 362 349	
EUR	28 067	Siemens Healthineers AG	1 913 522	2 130 063	
EUR	103	STRATEC Biomedical AG	19 271	17 818	
EUR	2 012	Symrise AG	344 844	347 168	
EUR	1 217	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	62 128	76 348	
			11 269 975	11 737 968	6,08
HONG KONG					
HKD	352 000	China Overseas Grand Oceans Group Ltd.	254 389	253 699	
HKD	1 016 500	China Overseas Land & Investment Ltd.	2 938 353	2 859 189	
HKD	12 163	China Tobacco International (HK) Co. Ltd.	30 590	32 777	
HKD	38 910	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	2 804 273	2 871 385	
HKD	33 920	Techtronic Industries Co. Ltd.	514 778	733 419	
HKD	17 179	Vitasoy International Holdings Ltd.	90 729	79 028	
			6 633 112	6 829 497	3,54
ISRAËL					
ILS	2 839	Matrix IT Ltd.	90 763	95 071	
ILS	2 832	Maytronics Ltd.	66 533	73 086	
ILS	3 168	Strauss Group Ltd.	115 956	109 857	
			273 252	278 014	0,14
ITALIE					
EUR	1 322	Carel Industries SPA	39 234	39 312	
EUR	12 339	Davide Campari-Milano NV	189 854	204 663	
EUR	364	DiaSorin	75 376	85 258	
EUR	2 500	Ferrari NV	573 959	638 798	
EUR	1 485	Interpump Group SPA	87 415	108 905	
EUR	5 759	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	372 630	407 632	
EUR	368	Reply SPA	58 269	74 901	
EUR	5 239	Zignago Vetro SPA	118 499	129 250	
			1 515 236	1 688 719	0,87

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
JAPON					
JPY	3 429	ABC-Mart Inc.	246 431	243 696	
JPY	3 906	Advantest Corp.	326 033	436 223	
JPY	428	Ariake Japan Co. Ltd.	35 357	32 901	
JPY	4 488	Asahi Holdings Inc.	108 739	113 463	
JPY	727	ASAHI INTECC CO. LTD.	22 274	21 543	
JPY	54 733	Astellas Pharma Inc.	1 181 799	1 181 299	
JPY	4 981	Bandai Namco Holdings Inc.	412 515	428 351	
JPY	58	BayCurrent Consulting Inc.	11 553	25 819	
JPY	1 994	Benefit One Inc.	64 339	77 753	
JPY	38 361	Bridgestone Corp.	1 917 512	2 163 481	
JPY	2 758	Capcom Co. Ltd.	101 606	100 005	
JPY	23 155	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	1 037 808	1 137 200	
JPY	77	COSMOS Pharmaceutical Corp.	17 247	14 003	
JPY	984	CREATE SD HOLDINGS Co. Ltd.	40 495	36 229	
JPY	3 352	CyberAgent Inc.	78 265	89 194	
JPY	1 129	Daifuku Co. Ltd.	121 222	127 095	
JPY	3 250	Daikin Industries Ltd.	823 361	750 215	
JPY	3 035	Daiwabo Holdings Co. Ltd.	57 675	64 573	
JPY	59	Digital Arts Inc.	7 157	5 569	
JPY	1 971	DIP Corp.	63 291	75 536	
JPY	712	Disco Corp.	235 179	269 688	
JPY	1 882	DTS Corp.	53 726	55 538	
JPY	5 713	Eisai Co. Ltd.	723 459	696 350	
JPY	1 496	ELECOM Co. Ltd.	33 711	34 750	
JPY	2 058	en Japan Inc.	92 196	90 695	
JPY	1 741	FANCL Corp.	76 175	69 927	
JPY	908	Fast Retailing Co. Ltd.	819 500	847 208	
JPY	771	Food & Life Cos. Ltd.	35 156	41 246	
JPY	1 311	Funai Soken Holdings Inc.	37 063	35 221	
JPY	578	Fuso Chemical Co. Ltd.	25 395	26 440	
JPY	28	GMO Cloud K.K.	4 084	1 470	
JPY	279	GMO Payment Gateway Inc.	39 927	45 042	
JPY	419	GOLDWIN Inc.	36 498	30 526	
JPY	1 479	GungHo Online Entertainment	41 568	36 484	
JPY	1 068	Hikari Tsushin Inc.	246 908	232 472	
JPY	1 139	Horiba Ltd.	84 926	91 495	
JPY	2 667	Hoya Corp.	359 882	438 296	
JPY	575	INFOCOM CORP.	19 058	19 663	
JPY	1 473	Infomart Corp.	16 476	14 971	
JPY	67	IR Japan Holdings Ltd.	10 748	10 458	
JPY	422	Japan Elevator Service Holding Co. Ltd.	11 830	12 157	
JPY	1 874	Japan Lifeline Co. Ltd.	36 675	28 247	
JPY	1 476	Japan Material Co. Ltd.	25 950	22 248	
JPY	48	JINS HOLDINGS Inc.	3 721	4 557	
JPY	57	Justsystems Corp.	5 190	4 159	
JPY	4 063	Kakaku.com Inc.	132 348	152 083	
JPY	1 688	Kaken Pharmaceutical Co. Ltd.	102 459	89 644	
JPY	1 149	Kanematsu Electronics Ltd.	55 698	46 021	
JPY	11 713	Kao Corp.	1 053 641	893 200	
JPY	944	KATITAS Co. Ltd.	35 132	32 860	
JPY	1 328	Keyence Corp.	738 012	830 751	
JPY	1 292	KOBE BUSSAN CO. LTD.	44 490	50 451	
JPY	1 934	Koito Manufacturing Co. Ltd.	141 509	149 100	
JPY	1 060	KOSE Corp.	209 644	206 723	
JPY	253	Kotobuki Spirits Co. Ltd.	18 259	20 267	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
JAPON (suite)					
JPY	45	Kusuri no Aoki Holdings Co. Ltd.	4 934	4 067	
JPY	3 398	KYUDENKO CORP.	132 845	135 153	
JPY	520	Lasertec Corp.	74 814	125 256	
JPY	738	M3 Inc.	49 566	66 801	
JPY	805	MANI INC.	23 731	22 866	
JPY	795	Maruwa Unyu Kikan Co. Ltd.	14 276	14 005	
JPY	1 143	McDonald's Holdings Co. (Japan) Ltd.	69 021	62 486	
JPY	1 324	Meitec Corp.	86 838	88 778	
JPY	407	Milbon Co. Ltd.	28 739	28 516	
JPY	8 294	MinebeaMitsumi Inc.	238 432	271 960	
JPY	1 556	MISUMI Group Inc.	64 918	65 274	
JPY	1 828	Monotaro Co. Ltd.	45 831	53 638	
JPY	13 023	Murata Manufacturing Co. Ltd.	1 138 381	1 232 399	
JPY	1 995	Nexon Co. Ltd.	65 821	55 111	
JPY	8 865	NGK Spark Plug Co. Ltd.	185 463	162 799	
JPY	2 334	NIFCO Inc.	102 983	109 238	
JPY	2 044	Nihon M&A Center Inc.	58 317	65 700	
JPY	3 582	Nihon Unisys Ltd.	141 454	133 479	
JPY	866	Nippon Shinyaku Co. Ltd.	86 624	85 121	
JPY	3 251	Nissan Chemical Corp.	205 451	197 314	
JPY	722	Nitori Holdings Co. Ltd.	182 551	158 366	
JPY	925	Nojima Corp.	31 786	28 339	
JPY	9 992	Nomura Research Institute Ltd.	414 262	409 687	
JPY	2 233	NSD CO. LTD.	49 669	46 239	
JPY	1 127	OBIC Co. Ltd.	235 924	260 403	
JPY	731	Okuma Corp.	46 556	44 285	
JPY	7 141	Olympus Corp.	184 335	175 914	
JPY	2 423	Oracle Corp. Japan	272 167	229 781	
JPY	5 859	OTSUKA Corp.	380 128	381 096	
JPY	3 779	Outsourcing Inc.	63 026	85 125	
JPY	5 554	Pan Pacific International Holdings Corp.	153 057	142 892	
JPY	2 383	Pigeon Corp.	111 783	83 217	
JPY	951	PILOT CORP.	43 926	39 894	
JPY	1 322	Prestige International Inc.	12 728	10 369	
JPY	13 498	Recruit Holdings Co. Ltd.	724 597	823 756	
JPY	3 876	Ryohin Keikaku Co. Ltd.	103 331	100 759	
JPY	262	Sakai Moving Service Co. Ltd.	16 428	16 837	
JPY	9 111	Sanwa Shutter Corp.	139 904	138 651	
JPY	259	SCREEN Holdings Co. Ltd.	23 839	31 728	
JPY	3 593	SCSK Corp.	253 257	265 373	
JPY	1 388	Seria Co. Ltd.	62 381	63 414	
JPY	7 354	SG Holdings Co. Ltd.	241 026	239 005	
JPY	3 666	Shimadzu Corp.	163 813	175 670	
JPY	6 971	Shionogi & Co.	486 763	450 392	
JPY	251	SMS Co. Ltd.	7 920	9 311	
JPY	463 886	SoftBank Corp.	7 423 450	7 522 606	
JPY	1 470	Solasto Corp.	24 206	23 059	
JPY	10 482	Sony Group Corp.	1 262 047	1 264 773	
JPY	1 643	STARTS CORP. INC.	52 426	52 114	
JPY	4 433	Sumitomo Forestry Co.	99 892	100 648	
JPY	2 778	Sundrug Co. Ltd.	128 912	109 408	
JPY	1 494	Sysmex Corp.	194 144	220 022	
JPY	1 655	Systema Corp.	34 181	39 311	
JPY	1 313	Taiyo Yuden Co. Ltd.	74 351	80 423	
JPY	2 216	TechnoPro Holdings Inc.	56 575	64 974	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
JAPON (suite)					
JPY	5 491	Terumo Corp.	275 174	275 803	
JPY	2 888	T-GAIA Corp.	67 121	62 928	
JPY	502	TOEI ANIMATION Co. Ltd.	49 442	73 762	
JPY	2 562	Tokuyama Corp.	74 392	64 657	
JPY	4 990	Tokyo Electron Ltd.	2 096 948	2 676 745	
JPY	1 172	TOKYO SEIMITSU CO. LTD.	61 798	65 771	
JPY	5 196	Trend Micro Inc.	354 456	337 392	
JPY	5 073	Uni-Charm Corp.	290 478	252 996	
JPY	12 633	USS Co. Ltd.	299 603	273 151	
JPY	407	ValueCommerce Co. Ltd.	15 891	14 712	
JPY	2 248	Wacom Co. Ltd.	20 026	17 707	
JPY	526	WORKMAN CO. LTD.	48 649	45 657	
JPY	3 416	Yamaha Corp.	227 317	229 814	
JPY	3 361	YASKAWA Electric Corp.	195 254	203 615	
JPY	5 109	ZOZO Inc.	193 558	215 177	
			33 124 759	34 432 245	17,83
MEXIQUE					
GBP	12 046	Fresnillo PLC	177 454	159 000	0,08
PAYS-BAS					
EUR	2 273	ASM International NV	650 858	924 598	
EUR	5 727	ASML Holding NV	3 550 378	4 872 812	
EUR	4 044	BE Semiconductor Industries NV	339 376	424 848	
EUR	2 392	Euronext NV	302 913	322 110	
EUR	816	IMCD Group NV	148 172	160 691	
EUR	8 565	Wolters Kluwer NV	965 090	1 065 583	
			5 956 787	7 770 642	4,02
NORVÈGE					
NOK	3 211	Borregaard ASA	67 063	86 869	
NOK	7 200	Fjordkraft Holding ASA	68 890	52 996	
			135 953	139 865	0,07
PORTUGAL					
EUR	6 348	Corticeira Amorim SGPS SA	97 563	98 814	
EUR	16 074	Jeronimo Martins SGPS SA	356 946	363 039	
			454 509	461 853	0,24
SINGAPOUR					
SGD	16 983	Riverstone Holdings Ltd.	24 253	19 243	
SGD	83 728	Sheng Siong Group Ltd.	111 665	121 868	
SGD	62 879	Singapore Exchange Ltd.	595 445	647 604	
			731 363	788 715	0,41
ESPAGNE					
EUR	18 989	Faes Farma SA	100 249	93 862	
EUR	8 389	Grifols SA	303 502	281 372	
EUR	234 447	Prosegur Cash SA	354 793	295 052	
EUR	70 086	Prosegur Compania de Seguridad SA, actions nominatives	249 256	284 063	
			1 007 800	954 349	0,49
SUÈDE					
SEK	4 459	AddTech AB, actions B	69 438	91 680	
SEK	24 431	Atlas Copco AB, catégorie A	1 722 832	1 853 630	
SEK	13 086	Atlas Copco AB, catégorie B	749 776	852 648	
SEK	12 888	Axfood AB	423 675	441 707	
SEK	8 112	Beijer Ref AB	136 735	179 122	
SEK	184	BioGaia AB, série B	12 959	12 682	
SEK	8 224	Elektro AB, catégorie B	140 782	147 657	
SEK	11 850	Epiroc AB, catégorie B	247 591	288 170	
SEK	10 763	EQT AB	408 719	484 045	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SUÈDE (suite)					
SEK	25 354	Essity AB, catégorie B	1 028 544	1 041 860	
SEK	2 066	Evolution AB	257 314	404 563	
SEK	1 009	Instalco AB	44 017	51 864	
SEK	4 080	Lagercrantz Group AB, catégorie B	48 096	55 000	
SEK	6 159	Lifco AB, catégorie B	132 681	178 357	
SEK	868	Lindab International AB	23 177	25 099	
SEK	1 798	Mycronic AB	53 820	67 220	
SEK	660	Paradox Interactive AB	17 878	17 202	
SEK	4 041	SWECO AB, catégorie B	76 826	91 102	
SEK	713	Trox Group AB	23 483	28 855	
			5 618 343	6 312 463	3,27
SUISSE					
CHF	348	ALSO Holding AG	120 034	124 241	
CHF	414	Bucher Industries AG, actions nominatives	247 663	268 322	
GBP	123 740	Ferrexpo PLC	693 531	905 549	
CHF	1 372	Geberit AG, actions nominatives	1 199 318	1 275 566	
CHF	260	Givaudan SA, actions nominatives	1 323 916	1 498 767	
CHF	385	Kardex AG	106 016	110 373	
CHF	4 521	Kuehne + Nagel International AG, actions nominatives	1 452 998	1 917 498	
CHF	3 053	Logitech International SA, actions nominatives	342 288	458 482	
CHF	1 407	Partners Group Holding AG	2 121 822	2 641 658	
CHF	15 953	Roche Holding AG Genussscheine	7 395 717	7 448 981	
CHF	6 265	Roche Holding AG-BR	2 867 550	3 154 041	
CHF	1 190	Schindler Holding AG	411 650	451 152	
CHF	1 371	SFS Group AG	206 682	244 458	
CHF	2 506	Sika AG, actions nominatives	953 213	1 015 537	
CHF	2 759	SoftwareONE Holding AG	89 744	80 759	
EUR	10 577	STMicroelectronics NV	485 020	475 367	
CHF	76	Tecan Group AG	47 978	46 671	
CHF	1 056	Temenos Group AG, actions nominatives	194 523	210 219	
			20 259 663	22 327 641	11,56
R.-U.					
GBP	8 226	AJ Bell PLC	61 370	61 043	
GBP	58 521	Ashmore Group PLC	413 372	385 419	
GBP	11 714	Ashtead Group PLC	789 625	1 074 868	
GBP	309	Avon Rubber PLC	18 084	13 828	
GBP	12 191	Berkeley Group Holdings PLC	943 859	958 266	
GBP	9 844	Bodycote PLC	129 268	142 548	
GBP	12 402	Bunzl PLC	529 306	506 838	
GBP	23 283	CMC Markets PLC	162 507	183 214	
GBP	1 693	Cranswick PLC	108 110	114 976	
GBP	3 325	Croda International PLC	364 854	419 085	
GBP	3 504	FDM Group Holdings PLC	62 159	61 140	
GBP	1 403	Fevertree Drinks PLC	60 645	61 753	
GBP	842	Games Workshop Group PLC	123 580	164 202	
GBP	1 053	Gamma Communications PLC	29 743	35 846	
GBP	300 239	GlaxoSmithKline PLC	7 300 151	7 290 091	
GBP	4 555	Halma PLC	191 729	209 761	
GBP	32 755	Hargreaves Lansdown PLC	908 503	890 354	
GBP	2 583	Hilton Food Group PLC	50 176	48 340	
GBP	12 110	HomeServe PLC	216 499	197 941	
GBP	16 018	IMI PLC	389 179	471 300	
GBP	5 196	Intertek Group PLC	501 873	491 536	
GBP	10 681	James Halstead PLC	88 710	95 012	
EUR	16 240	Linde PLC	5 563 873	5 803 518	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		R.-U. (suite)			
GBP	44 776	Moneysupermarket.com Group PLC	209 104	196 545	
GBP	100 998	RELX PLC	3 159 521	3 315 496	
GBP	124 632	Rio Tinto PLC	11 539 949	12 683 367	
GBP	20 391	Rotork PLC	117 828	118 738	
GBP	7 364	RWS Holdings PLC	73 632	70 985	
GBP	24 096	Smith & Nephew PLC	621 256	644 060	
GBP	1 255	Spirax-Sarco Engineering PLC	239 177	292 296	
GBP	16 201	Spirent Communications PLC	74 948	68 288	
GBP	148 537	Unilever PLC	11 196 529	10 749 478	
			46 239 119	47 820 132	24,76
Total des actions			177 886 323	192 225 583	99,53
Ajustement au titre des coûts de transaction			(289 364)		
Total des placements			177 596 960	192 225 583	99,53
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(95 081)	(0,05)
Autres actifs (passifs) nets				999 091	0,52
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				193 129 593	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque de Montréal	A-1	07 juillet 2021	CAD	5 802 356	AUD	6 210 000	0,93	29 138
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	07 juillet 2021	CAD	12 123 940	EUR	8 225 000	1,47	45 000
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	07 juillet 2021	CAD	13 760	SGD	15 000	0,92	(58)
Citibank N.A., New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	344 239	CHF	255 000	1,35	2 611
Citibank N.A., New York	A-1	07 juillet 2021	HKD	920 000	CAD	143 326	6,42	3 373
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	2 398 688	DKK	12 105 000	0,20	8 114
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	2 104 780	HKD	13 570 000	0,16	(59 029)
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	37 657	NOK	260 000	0,14	242
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	1 663 176	SEK	11 420 000	0,15	9 595
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	147 947	HKD	935 000	0,16	(1 143)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	68 689	ILS	185 000	0,37	(1 617)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	8 789 047	JPY	798 550 000	0,01	(120 425)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	191 340	SGD	210 000	0,91	(2 115)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	439 283	AUD	470 000	0,93	2 340
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	443 154	CHF	330 000	1,34	1 047
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	246 404	DKK	1 245 000	0,20	533
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	1 251 024	EUR	850 000	1,47	2 744
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	797 217	GBP	465 000	1,71	1 760
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	11 408 216	GBP	6 690 000	1,71	(36 108)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	9 508	ILS	25 000	0,38	7
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	907 674	JPY	81 540 000	0,01	(2 073)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	121 643	SEK	835 000	0,15	737
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	13 772	SGD	15 000	0,92	(47)
La Banque Toronto-Dominion	A-1+	07 juillet 2021	CAD	5 131 317	CHF	3 815 000	1,35	20 293
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(95 081)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	128	(27)	-	101
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	128	(27)	-	101
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(223)	27	-	(196)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(223)	27	-	(196)

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	105	(20)	-	85
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	105	(20)	-	85
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(346)	20	-	(326)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(346)	20	-	(326)

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	184	s.o.
Paiements indirects [†]	52	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2021	2020	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 500 000	1 400 000	1 300 000	800 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	200 000	-	3 470 000	200 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(100 000)	(100 000)	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 700 000	1 300 000	4 670 000	1 000 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,480*
Parts non couvertes	0,480

*Le 23 juin 2021, le taux des frais de gestion annuels des parts couvertes est passé de 0,58 % à 0,48 %.

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	1 832	-
Garanties (hors trésorerie)	1 958	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	6	-
Charges	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres	4	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	40,0	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
R.-U.	25,4
Japon	19,9
Australie	11,6
Suisse	10,8
Allemagne	6,2
France	5,9
Danemark	5,2
Hong Kong	3,6
Pays-Bas	3,2
Suède	3,0
Finlande	2,9
Italie	0,9
Espagne	0,5
Singapour	0,4
Portugal	0,3
Chine	0,2
Belgique	0,1
Israël	0,1
Mexique	0,1
Norvège	0,1
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,1
Emirats Arabes Unis	0,0
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
Total de la perte latente sur le(s) contrat(s) de change à terme	(0,4)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Autre risque de prix (suite)

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree	13 717 887

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree	7 940 598

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Euro	47 060	(13 327)	33 733	17,5
Livre sterling	43 070	(12 240)	30 830	16,0
Yen japonais	34 486	(9 819)	24 667	12,8
Dollar australien	22 392	(6 210)	16 182	8,4
Franc suisse	20 949	(5 895)	15 054	7,8
Couronne danoise	9 565	(2 636)	6 929	3,6
Dollar de Hong Kong	7 301	(2 166)	5 135	2,7
Couronne suédoise	6 309	(1 774)	4 535	2,3
Dollar de Singapour	792	(221)	571	0,3
Shekel israélien	281	(80)	201	0,1
Couronne norvégienne	143	(37)	106	0,1
Dollar américain	17	-	17	0,0
Dollar néo-zélandais	3	-	3	0,0
Total	192 368	(54 405)	137 963	71,6

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

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risque de change (suite)

Parts couvertes

au 31 décembre 2020[~]

Devise	Exposition aux	Dérivés	Exposition	Actif net (%)
	instruments financiers	(en milliers de dollars)	nette (en milliers de dollars)	
Euro	9 969	(9 696)	273	0,6
Yen japonais	8 560	(8 363)	197	0,5
Dollar australien	4 999	(4 886)	113	0,3
Franc suisse	4 357	(4 238)	119	0,3
Couronne danoise	2 241	(2 260)	(19)	0,0
Dollar de Hong Kong	1 619	(1 598)	21	0,0
Shekel israélien	63	(60)	3	0,0
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
Couronne norvégienne	37	(37)	-	0,0
Dollar de Singapour	168	(169)	(1)	0,0
Couronne suédoise	1 298	(1 288)	10	0,0
Dollar américain	5	-	5	0,0
Livre sterling	9 846	(9 979)	(133)	(0,3)
Total	43 164	(42 574)	590	1,4

Parts non couvertes

au 31 décembre 2020[~]

Devise	Exposition aux	Dérivés	Exposition	Actif net (%)
	instruments financiers	(en milliers de dollars)	nette (en milliers de dollars)	
Euro	8 502	-	8 502	23,2
Livre sterling	8 397	-	8 397	22,9
Yen japonais	7 300	-	7 300	19,9
Dollar australien	4 263	-	4 263	11,6
Franc suisse	3 716	-	3 716	10,1
Couronne danoise	1 911	-	1 911	5,2
Dollar de Hong Kong	1 381	-	1 381	3,8
Couronne suédoise	1 107	-	1 107	3,0
Dollar de Singapour	143	-	143	0,4
Shekel israélien	53	-	53	0,1
Couronne norvégienne	32	-	32	0,1
Dollar néo-zélandais	2	-	2	0,0
Dollar américain	5	-	5	0,0
Total	36 812	-	36 812	100,3

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 13 796 000 \$ (3 740 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

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

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous résumant les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds qui sont comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	192 226	-	-	192 226
Dérivés, nets	-	(95)	-	(95)
Total	192 226	(95)	-	192 131

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	79 860	-	-	79 860
Dérivés, nets	-	(241)	-	(241)
Total	79 860	(241)	-	79 619

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	36 215	30 182
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	143	147
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	75	51
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	-	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	39	26
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	36 472	30 406
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	124	135
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	91
Frais de gestion à payer	19	16
Comptes créditeurs et charges à payer	7	15
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	150	257
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	36 322	30 149

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts à couverture variable	36 322	30 149	30,27	27,41	1 200 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	602	284
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 174	(841)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 093	(124)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	3 869	(681)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(10)	(8)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	-	-
Rabais sur frais	-	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	6	-
Total des autres revenus	(4)	(8)
Total des revenus	3 865	(689)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	104	68
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	31	3
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	59	29
Taxe de vente harmonisée	16	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	211	101
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(1)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 654	(789)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts à couverture variable	3 654	(789)	3,17	(0,97)	1 151 934	814 835

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts à couverture variable	
	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	30 149	23 001
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 654	(789)
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu net de placement	(310)	(164)
Profits nets réalisés	-	-
Remboursement de capital	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(311)	(164)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	2 830	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-
Rachat de parts rachetables	-	(2 569)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	2 830	(2 569)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	6 173	(3 522)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	36 322	19 479

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 654	(789)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 174)	841
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	31	3
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 093)	124
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	2 039	4 209
Achat de placements et de dérivés	(4 873)	(1 578)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(12)	(8)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	3	(3)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	(8)	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(2 433)	2 798
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(402)	(210)
Produit de l'émission de parts rachetables	2 831	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	(2 569)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	2 429	(2 779)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	1
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(4)	19
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	147	20
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	143	40
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	531	247
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
AUSTRALIE					
AUD	107	Appen Ltd.	2 533	1 353	
AUD	320	ARB Corp. Ltd.	7 146	12 849	
AUD	11 669	Beach Energy Ltd.	18 319	13 452	
AUD	47 396	BHP Group Ltd.	1 647 154	2 140 085	
AUD	1 562	Bluescope Steel Ltd.	20 031	31 889	
AUD	13 447	Brambles Ltd.	133 672	143 012	
AUD	673	Breville Group Ltd.	17 208	18 713	
AUD	4 422	Charter Hall Group	56 171	63 802	
AUD	934	Codan Ltd.	10 898	15 655	
AUD	1 084	CSL Ltd.	241 380	287 399	
AUD	382	Domino's Pizza Enterprises Ltd.	22 671	42 796	
AUD	762	Elders Ltd.	8 257	8 182	
AUD	15 618	Evolution Mining Ltd.	87 667	65 337	
AUD	9 831	Goodman Group	181 333	193 482	
AUD	1 418	JB Hi-Fi Ltd.	66 014	66 677	
AUD	304	Kogan.com Ltd.	6 126	3 273	
AUD	2 486	Mineral Resources Ltd.	67 147	124 176	
AUD	631	Netwealth Group Ltd.	10 311	10 060	
AUD	4 790	NIB Holdings Ltd.	28 273	28 989	
AUD	2 558	Northern Star Resources Ltd.	26 205	23 257	
AUD	89	Pro Medicus Ltd.	2 942	4 858	
AUD	2 488	Ramelius Resources Ltd.	4 999	3 920	
AUD	6 241	Regis Resources Ltd.	25 050	13 693	
AUD	7 642	Rio Tinto Ltd.	704 295	899 703	
AUD	6 556	St. Barbara Ltd.	16 592	10 392	
AUD	1 380	Technology One Ltd.	9 588	11 944	
AUD	114	Wisetech Global Ltd.	3 360	3 384	
			3 425 342	4 242 332	11,68
BELGIQUE					
EUR	72	Fagron NV	2 166	1 991	
EUR	267	Melexis NV	28 544	34 327	
			30 710	36 318	0,10
CHINE					
HKD	87 319	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	121 041	156 499	0,43
DANEMARK					
DKK	100	Ambu AS, catégorie B	3 833	4 761	
DKK	883	Coloplast AS, catégorie B	142 879	179 431	
DKK	192	DSV Panalpina AS	29 906	55 452	
DKK	108	GN Store Nord AS	7 952	11 683	
DKK	1 079	H. Lundbeck AS	41 016	42 509	
DKK	9 251	Novo Nordisk AS, série B	700 692	959 840	
DKK	1 048	Novozymes AS, catégorie B	71 503	97 829	
DKK	1 528	Orsted AS	226 192	265 538	
DKK	313	Royal Unibrew A/S	34 973	49 375	
DKK	126	SimCorp AS	16 324	19 587	
DKK	2 548	Vestas Wind Systems AS	82 340	123 178	
			1 357 610	1 809 183	4,98
FINLANDE					
EUR	3 664	Kone OYJ, catégorie B	325 839	370 184	
EUR	4 809	Neste OYJ	265 056	364 683	
EUR	1 017	Orion OYJ, catégorie B	60 919	54 138	
EUR	56	Revenio Group OYJ	3 397	5 255	
EUR	316	Tokmanni Group Corp.	7 280	10 822	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
FINLANDE (suite)					
EUR	784	Uponor OYJ	19 126	28 138	
EUR	1 966	Valmet Corp.	67 927	106 186	
			749 544	939 406	2,59
FRANCE					
EUR	41	bioMérieux	8 226	5 900	
EUR	489	Gaztransport & Technigaz SA	62 077	48 902	
EUR	198	Hermes International	202 747	357 202	
EUR	1 995	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SA	1 413 189	1 937 383	
EUR	23	Sartorius Stedim Biotech	7 198	13 473	
EUR	113	Trigano SA	18 474	28 907	
EUR	1 481	Verallia	58 686	67 986	
			1 770 597	2 459 753	6,77
ALLEMAGNE					
EUR	112	Bechtle AG	19 398	25 764	
EUR	181	CANCOM AG	11 625	13 556	
EUR	123	Carl Zeiss Meditec AG	21 996	29 433	
EUR	87	CompuGroup Medical SE & Co. KGaA	10 529	8 438	
EUR	249	Dermapharm Holding SE	15 181	24 590	
EUR	54	Eckert & Ziegler AG	3 677	7 640	
EUR	675	FUCHS PETROLUB SE	36 608	32 463	
EUR	4 686	Infineon Technologies AG	147 024	232 729	
EUR	962	Knorr-Bremse AG	154 539	137 032	
EUR	180	Nemetschek AG	14 763	17 055	
EUR	6 921	SAP SE	1 180 316	1 207 829	
EUR	5 328	Siemens Healthineers AG	316 346	404 353	
EUR	19	STRATEC Biomedical AG	3 499	3 287	
EUR	382	Symrise AG	63 793	65 914	
EUR	224	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	8 323	14 052	
			2 007 617	2 224 135	6,12
HONG KONG					
HKD	4 159	China Tobacco International (HK) Co. Ltd.	10 575	11 208	
HKD	12 996	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	905 146	959 047	
HKD	11 370	Techtronic Industries Co. Ltd.	173 972	245 843	
HKD	5 425	Vitasoy International Holdings Ltd.	28 799	24 956	
			1 118 492	1 241 054	3,42
ISRAËL					
ILS	522	Matrix IT Ltd.	16 503	17 480	
ILS	521	Maytronics Ltd.	11 097	13 446	
ILS	582	Strauss Group Ltd.	22 084	20 182	
			49 684	51 108	0,14
ITALIE					
EUR	243	Carel Industries SPA	6 613	7 226	
EUR	2 342	Davide Campari-Milano NV	33 779	38 846	
EUR	67	DiaSorin	12 262	15 693	
EUR	475	Ferrari NV	98 537	121 372	
EUR	273	Interpump Group SPA	12 930	20 021	
EUR	1 093	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	65 078	77 365	
EUR	68	Reply SPA	7 686	13 840	
EUR	963	Zignago Vetro SPA	20 311	23 758	
			257 196	318 121	0,87
JAPON					
JPY	576	ABC-Mart Inc.	42 225	40 936	
JPY	646	Advantest Corp.	34 255	72 145	
JPY	84	Ariake Japan Co. Ltd.	7 567	6 457	
JPY	852	Asahi Holdings Inc.	20 058	21 540	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
JAPON (suite)					
JPY	120	ASAHI INTECC CO. LTD.	3 916	3 556	
JPY	10 330	Astellas Pharma Inc.	210 772	222 952	
JPY	922	Bandai Namco Holdings Inc.	72 566	79 289	
JPY	21	BayCurrent Consulting Inc.	4 279	9 348	
JPY	335	Benefit One Inc.	8 661	13 063	
JPY	7 294	Bridgestone Corp.	331 839	411 366	
JPY	458	Capcom Co. Ltd.	16 425	16 607	
JPY	4 394	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	168 513	215 800	
JPY	28	COSMOS Pharmaceutical Corp.	6 402	5 092	
JPY	178	CREATE SD HOLDINGS Co. Ltd.	8 121	6 554	
JPY	568	CyberAgent Inc.	11 393	15 114	
JPY	198	Daifuku Co. Ltd.	18 674	22 289	
JPY	537	Daikin Industries Ltd.	151 713	123 959	
JPY	510	Daiwabo Holdings Co. Ltd.	8 447	10 851	
JPY	22	Digital Arts Inc.	2 562	2 076	
JPY	328	DIP Corp.	8 782	12 570	
JPY	130	Disco Corp.	37 787	49 241	
JPY	324	DTS Corp.	9 252	9 561	
JPY	1 055	Eisai Co. Ltd.	129 262	128 593	
JPY	256	ELECOM Co. Ltd.	5 621	5 946	
JPY	355	en Japan Inc.	10 968	15 645	
JPY	296	FANCL Corp.	13 619	11 889	
JPY	156	Fast Retailing Co. Ltd.	132 475	145 555	
JPY	136	Food & Life Cos. Ltd.	5 062	7 276	
JPY	224	Funai Soken Holdings Inc.	6 718	6 018	
JPY	102	Fuso Chemical Co. Ltd.	4 305	4 666	
JPY	10	GMO Cloud K.K.	1 474	525	
JPY	55	GMO Payment Gateway Inc.	5 461	8 879	
JPY	81	GOLDWIN Inc.	7 542	5 901	
JPY	249	GungHo Online Entertainment	8 045	6 142	
JPY	179	Hikari Tsushin Inc.	47 510	38 963	
JPY	202	Horiba Ltd.	13 814	16 227	
JPY	450	Hoya Corp.	47 667	73 953	
JPY	101	INFOCOM CORP.	3 756	3 454	
JPY	247	Infomart Corp.	2 994	2 510	
JPY	25	IR Japan Holdings Ltd.	4 096	3 902	
JPY	82	Japan Elevator Service Holding Co. Ltd.	2 214	2 362	
JPY	321	Japan Lifeline Co. Ltd.	6 665	4 838	
JPY	248	Japan Material Co. Ltd.	5 183	3 738	
JPY	18	JINS HOLDINGS Inc.	1 566	1 709	
JPY	21	Justsystems Corp.	1 957	1 532	
JPY	781	Kakaku.com Inc.	23 948	29 234	
JPY	279	Kaken Pharmaceutical Co. Ltd.	17 590	14 817	
JPY	201	Kanematsu Electronics Ltd.	11 351	8 051	
JPY	2 137	Kao Corp.	214 226	162 961	
JPY	163	KATITAS Co. Ltd.	6 561	5 674	
JPY	223	Keyence Corp.	104 555	139 501	
JPY	217	KOBE BUSSAN CO. LTD.	5 415	8 474	
JPY	326	Koito Manufacturing Co. Ltd.	22 579	25 133	
JPY	176	KOSE Corp.	35 252	34 324	
JPY	56	Kotobuki Spirits Co. Ltd.	3 654	4 486	
JPY	17	Kusuri no Aoki Holdings Co. Ltd.	1 817	1 536	
JPY	566	KYUDENKO CORP.	21 524	22 512	
JPY	101	Lasertec Corp.	8 921	24 329	
JPY	138	M3 Inc.	7 155	12 491	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		JAPON (suite)			
JPY	149	MANI INC.	4 568	4 232	
JPY	146	Maruwa Unyu Kikan Co. Ltd.	2 827	2 572	
JPY	197	McDonald's Holdings Co. (Japan) Ltd.	12 558	10 770	
JPY	228	Meitec Corp.	13 992	15 288	
JPY	76	Milbon Co. Ltd.	5 377	5 325	
JPY	1 584	MinebeaMitsumi Inc.	42 135	51 939	
JPY	263	MISUMI Group Inc.	10 778	11 033	
JPY	316	Monotaro Co. Ltd.	6 827	9 272	
JPY	2 440	Murata Manufacturing Co. Ltd.	191 140	230 903	
JPY	345	Nexon Co. Ltd.	13 030	9 530	
JPY	1 670	NGK Spark Plug Co. Ltd.	38 301	30 668	
JPY	388	NIFCO Inc.	15 912	18 160	
JPY	364	Nihon M&A Center Inc.	9 442	11 700	
JPY	593	Nihon Unisys Ltd.	24 400	22 097	
JPY	143	Nippon Shinyaku Co. Ltd.	13 885	14 056	
JPY	551	Nissan Chemical Corp.	35 508	33 442	
JPY	133	Nitori Holdings Co. Ltd.	37 196	29 173	
JPY	156	Nojima Corp.	5 978	4 779	
JPY	1 854	Nomura Research Institute Ltd.	76 223	76 017	
JPY	379	NSD CO. LTD.	9 406	7 848	
JPY	197	OBIC Co. Ltd.	35 211	45 519	
JPY	121	Okuma Corp.	8 296	7 330	
JPY	1 278	Olympus Corp.	34 423	31 483	
JPY	406	Oracle Corp. Japan	46 384	38 502	
JPY	1 069	OTSUKA Corp.	67 959	69 533	
JPY	638	Outsourcing Inc.	9 826	14 371	
JPY	1 030	Pan Pacific International Holdings Corp.	30 117	26 500	
JPY	404	Pigeon Corp.	22 730	14 108	
JPY	166	PILOT CORP.	8 269	6 964	
JPY	228	Prestige International Inc.	2 637	1 788	
JPY	2 539	Recruit Holdings Co. Ltd.	122 719	154 950	
JPY	654	Ryohin Keikaku Co. Ltd.	17 730	17 001	
JPY	59	Sakai Moving Service Co. Ltd.	3 712	3 792	
JPY	1 715	Sanwa Shutter Corp.	27 323	26 099	
JPY	58	SCREEN Holdings Co. Ltd.	4 252	7 105	
JPY	596	SCSK Corp.	40 266	44 020	
JPY	244	Seria Co. Ltd.	11 778	11 148	
JPY	1 314	SG Holdings Co. Ltd.	43 708	42 705	
JPY	619	Shimadzu Corp.	24 787	29 662	
JPY	1 257	Shionogi & Co.	90 946	81 214	
JPY	56	SMS Co. Ltd.	1 949	2 077	
JPY	87 973	SoftBank Corp.	1 378 810	1 426 614	
JPY	246	Solasto Corp.	4 306	3 859	
JPY	1 931	Sony Group Corp.	224 612	232 997	
JPY	273	STARTS CORP. INC.	8 903	8 659	
JPY	835	Sumitomo Forestry Co.	18 343	18 958	
JPY	465	Sundrug Co. Ltd.	24 388	18 313	
JPY	250	Systemex Corp.	24 718	36 818	
JPY	277	Systema Corp.	5 219	6 580	
JPY	225	Taiyo Yuden Co. Ltd.	11 154	13 781	
JPY	540	TechnoPro Holdings Inc.	12 578	15 833	
JPY	1 011	Terumo Corp.	52 020	50 781	
JPY	487	T-GAIA Corp.	11 654	10 611	
JPY	93	TOEI ANIMATION Co. Ltd.	6 508	13 665	
JPY	429	Tokuyama Corp.	13 414	10 827	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
JAPON (suite)					
JPY	919	Tokyo Electron Ltd.	267 981	492 972	
JPY	206	TOKYO SEIMITSU CO. LTD.	9 816	11 560	
JPY	958	Trend Micro Inc.	66 405	62 206	
JPY	942	Uni-Charm Corp.	59 887	46 979	
JPY	2 389	USS Co. Ltd.	58 916	51 655	
JPY	76	ValueCommerce Co. Ltd.	3 262	2 747	
JPY	385	Wacom Co. Ltd.	3 686	3 033	
JPY	100	WORKMAN CO. LTD.	10 596	8 680	
JPY	572	Yamaha Corp.	38 174	38 482	
JPY	554	YASKAWA Electric Corp.	29 809	33 562	
JPY	953	ZOZO Inc.	29 411	40 138	
			5 735 806	6 299 097	17,34
MEXIQUE					
GBP	2 287	Fresnillo PLC	36 823	30 187	0,08
PAYS-BAS					
EUR	431	ASM International NV	71 660	175 320	
EUR	1 087	ASML Holding NV	427 360	924 873	
EUR	768	BE Semiconductor Industries NV	49 626	80 683	
EUR	454	Euronext NV	53 085	61 136	
EUR	151	IMCD Group NV	25 284	29 736	
EUR	1 626	Wolters Kluwer NV	168 117	202 293	
			795 132	1 474 041	4,06
NORVÈGE					
NOK	591	Borregaard ASA	9 519	15 989	
NOK	1 324	Fjordkraft Holding ASA	15 010	9 745	
			24 529	25 734	0,07
PORTUGAL					
EUR	1 167	Corticeira Amorim SGPS SA	18 046	18 166	
EUR	3 051	Jeronimo Martins SGPS SA	65 785	68 908	
			83 831	87 074	0,24
SINGAPOUR					
SGD	3 100	Riverstone Holdings Ltd.	5 273	3 513	
SGD	15 300	Sheng Siong Group Ltd.	19 534	22 269	
SGD	11 900	Singapore Exchange Ltd.	105 727	122 561	
			130 534	148 343	0,41
ESPAGNE					
EUR	3 492	Faes Farma SA	18 237	17 261	
EUR	1 565	Grifols SA	59 701	52 491	
EUR	43 723	Prosegur Cash SA	71 063	55 026	
EUR	13 071	Prosegur Compania de Seguridad SA, actions nominatives	42 450	52 977	
			191 451	177 755	0,49
SUÈDE					
SEK	820	AddTech AB, actions B	9 505	16 860	
SEK	4 638	Atlas Copco AB, catégorie A	301 765	351 895	
SEK	2 484	Atlas Copco AB, catégorie B	109 654	161 851	
SEK	2 447	Axfood AB	76 675	83 865	
SEK	1 540	Beijer Ref AB	17 516	34 005	
SEK	33	BioGaia AB, série B	2 412	2 274	
SEK	1 512	Elekta AB, catégorie B	24 581	27 147	
SEK	2 210	Epiroc AB, catégorie B	38 723	53 743	
SEK	2 043	EQT AB	60 287	91 880	
SEK	4 813	Essity AB, catégorie B	192 310	197 778	
SEK	392	Evolution AB	25 811	76 761	
SEK	185	Instalco AB	6 543	9 509	
SEK	750	Lagercrantz Group AB, catégorie B	7 874	10 110	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SUÈDE (suite)					
SEK	1 169	Lifco AB, catégorie B	17 714	33 853	
SEK	159	Lindab International AB	3 799	4 598	
SEK	331	Mycronic AB	7 470	12 375	
SEK	122	Paradox Interactive AB	3 432	3 180	
SEK	743	SWECO AB, catégorie B	11 448	16 750	
SEK	132	Trox Group AB	3 368	5 342	
			920 887	1 193 776	3,29
SUISSE					
CHF	64	ALSO Holding AG	21 260	22 849	
CHF	79	Bucher Industries AG, actions nominatives	44 913	51 201	
GBP	23 490	Ferrexpo PLC	93 503	171 904	
CHF	260	Geberit AG, actions nominatives	211 601	241 725	
CHF	49	Givaudan SA, actions nominatives	216 626	282 460	
CHF	70	Kardex AG	17 758	20 068	
CHF	858	Kuehne + Nagel International AG, actions nominatives	204 467	363 905	
CHF	580	Logitech International SA, actions nominatives	45 586	87 101	
CHF	267	Partners Group Holding AG	297 985	501 295	
CHF	3 028	Roche Holding AG Genusscheine	1 376 202	1 413 873	
CHF	1 189	Roche Holding AG-BR	481 894	598 588	
CHF	226	Schindler Holding AG	72 230	85 681	
CHF	256	SFS Group AG	31 939	45 647	
CHF	476	Sika AG, actions nominatives	167 856	192 895	
CHF	507	#N/A	16 886	14 841	
EUR	2 008	STMicroelectronics NV	91 270	90 246	
CHF	14	Tecan Group AG	8 735	8 597	
CHF	197	Temenos Group AG, actions nominatives	32 459	39 217	
			3 433 170	4 232 093	11,65
R.-U.					
GBP	1 513	AJ Bell PLC	10 907	11 228	
GBP	11 109	Ashmore Group PLC	78 735	73 164	
GBP	2 224	Ashtead Group PLC	98 721	204 073	
GBP	57	Avon Rubber PLC	4 088	2 551	
GBP	2 314	Berkeley Group Holdings PLC	175 929	181 890	
GBP	1 810	Bodycote PLC	21 948	26 210	
GBP	2 354	Bunzl PLC	101 548	96 202	
GBP	4 420	CMC Markets PLC	27 718	34 781	
GBP	311	Cranswick PLC	18 056	21 121	
GBP	631	Croda International PLC	59 796	79 532	
GBP	644	FDM Group Holdings PLC	11 519	11 237	
GBP	258	Fevertree Drinks PLC	8 288	11 356	
GBP	155	Games Workshop Group PLC	16 181	30 227	
GBP	194	Gamma Communications PLC	4 610	6 604	
GBP	56 995	GlaxoSmithKline PLC	1 363 436	1 383 893	
GBP	850	Halma PLC	32 141	39 143	
GBP	6 218	Hargreaves Lansdown PLC	165 078	169 019	
GBP	475	Hilton Food Group PLC	9 373	8 889	
GBP	2 258	HomeServe PLC	43 706	36 908	
GBP	3 041	IMI PLC	59 537	89 476	
GBP	986	Intertek Group PLC	95 402	93 274	
GBP	1 964	James Halstead PLC	15 805	17 470	
EUR	3 083	Linde PLC	1 017 869	1 101 739	
GBP	8 350	Moneysupermarket.com Group PLC	38 944	36 653	
GBP	19 173	RELX PLC	562 149	629 399	
GBP	23 659	Rio Tinto PLC	1 941 389	2 407 695	
GBP	3 750	Rotork PLC	19 569	21 836	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		R.-U. (suite)			
GBP	1 354	RWS Holdings PLC	13 627	13 052	
GBP	4 574	Smith & Nephew PLC	110 395	122 258	
GBP	234	Spirax-Sarco Engineering PLC	35 904	54 500	
GBP	2 979	Spirent Communications PLC	14 436	12 557	
GBP	28 197	Unilever PLC	2 164 405	2 040 589	
			8 341 209	9 068 526	24,97
Total des actions			30 581 205	36 214 535	99,70
Ajustement au titre des coûts de transaction			(58 552)		
Total des placements			30 522 653	36 214 535	99,70
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(49 572)	(0,13)
Autres actifs (passifs) nets				157 515	0,43
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				36 322 478	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque de Montréal	A-1	07 juillet 2021	CAD	4 111 170	AUD	4 400 000	0,93	20 646
Banque Canadienne Impériale de Commerce	A-1	07 juillet 2021	CAD	7 163 812	EUR	4 860 000	1,47	26 589
Citibank N.A., New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	269 991	CHF	200 000	1,35	2 047
Citibank N.A., New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	101 097	DKK	510 000	0,20	379
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	1 416 821	DKK	7 150 000	0,20	4 793
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	1 200 516	HKD	7 740 000	0,16	(33 669)
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	26 070	NOK	180 000	0,14	167
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	CAD	980 866	SEK	6 735 000	0,15	5 659
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	22 277	ILS	60 000	0,37	(524)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	4 962 557	JPY	450 885 000	0,01	(67 996)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	68 336	SGD	75 000	0,91	(756)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	6 735 793	GBP	3 950 000	1,71	(21 319)
Morgan Stanley & Co. International PLC	A-1	07 juillet 2021	CAD	3 803	ILS	10 000	0,38	3
La Banque Toronto-Dominion	A-1+	07 juillet 2021	CAD	3 631 601	CHF	2 700 000	1,35	14 362
La Banque Toronto-Dominion	A-1+	07 juillet 2021	HKD	495 000	CAD	78 884	6,28	47
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(49 572)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	75	(11)	-	64
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	75	(11)	-	64
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(125)	11	-	(114)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(125)	11	-	(114)

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	51	(14)	-	37
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	51	(14)	-	37
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(135)	14	-	(121)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(135)	14	-	(121)

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	10	s.o.
Paiements indirects [†]	3	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts à couverture variable	
	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	1 100 000	900 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	100 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-
Parts rachetables rachetées	-	(100 000)
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	1 200 000	800 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts à couverture variable	0,630

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	596	-
Garanties (hors trésorerie)	637	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	-	-
Charges	-	-
Revenu tiré des prêts de titres	-	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	-	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
R.-U.	25,4
Japon	19,9
Australie	11,6
Suisse	10,8
Allemagne	6,2
France	5,9
Danemark	5,2
Hong Kong	3,6
Pays-Bas	3,2
Suède	3,0
Finlande	2,9
Italie	0,9
Espagne	0,5
Singapour	0,4
Portugal	0,3
Chine	0,2
Israël	0,1
Mexique	0,1
Belgique	0,1
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,1
Norvège	0,1
Emirats Arabes Unis	0,0
Autres actifs (passifs) nets	(0,1)
Total de la perte latente sur le(s) contrat(s) de change à terme	(0,4)
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions étrangères et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale à l'échelle mondiale.

Autre risque de prix (suite)

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree (Couvert en dollars canadiens)	3 497 144

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree (Couvert en dollars canadiens)	3 009 786

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devises	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Euro	8 913	(7 137)	1 776	4,9
Livre sterling	8 194	(6 757)	1 437	4,0
Yen japonais	6 318	(5 031)	1 287	3,5
Couronne danoise	1 812	(1 513)	299	0,8
Dollar de Hong Kong	1 403	(1 155)	248	0,7
Couronne suédoise	1 197	(975)	222	0,6
Dollar australien	4 247	(4 091)	156	0,4
Dollar de Singapour	149	(69)	80	0,2
Franc suisse	3 974	(3 885)	89	0,2
Shekel israélien	55	(27)	28	0,1
Dollar américain	12	-	12	0,0
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
Couronne norvégienne	26	(26)	-	0,0
Total	36 301	(30 666)	5 635	15,4

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

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risque de change (suite)

au 31 décembre 2020[~]

Devise	Exposition aux	Dérivés	Exposition	Actif net
	instruments financiers		nette	
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(%)
Euro	6 983	(3 398)	3 585	11,9
Livre sterling	6 897	(3 448)	3 449	11,4
Dollar australien	3 502	(2 335)	1 167	3,9
Yen japonais	5 997	(4 891)	1 106	3,7
Franc suisse	3 055	(1 982)	1 073	3,6
Couronne danoise	1 571	(752)	819	2,7
Dollar de Hong Kong	1 136	(569)	567	1,9
Couronne suédoise	911	(452)	459	1,5
Dollar de Singapour	120	(53)	67	0,2
Shekel israélien	46	(20)	26	0,1
Couronne norvégienne	29	(8)	21	0,1
Dollar américain	4	-	4	0,0
Dollar néo-zélandais	1	-	1	0,0
Total	30 252	(17 908)	12 344	41,0

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 564 000 \$ (1 234 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

Hiérarchie des justes valeurs

Les tableaux ci-dessous résumés les données utilisées par le Fonds pour l'évaluation des placements et des dérivés du Fonds qui sont comptabilisés à la juste valeur.

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	36 214	-	-	36 214
Dérivés, nets	-	(49)	-	(49)
Total	36 214	(49)	-	36 165

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

Hiérarchie des justes valeurs (suite)

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)
Actions	30 182	-	-	30 182
Dérivés, nets	-	(84)	-	(84)
Total	30 182	(84)	-	30 098

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	353 009	19 882
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	2 067	276
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	-	17
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	130	2
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	784	52
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	68	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	356 058	20 229
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	109	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	68	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	92
Frais de gestion à payer	135	8
Comptes créditeurs et charges à payer	162	21
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	474	121
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	355 584	20 108

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts couvertes	8 068	2 393	26,89	23,93	300 000
Parts non couvertes	347 516	17 715	25,74	25,31	13 500 000	700 000

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	3 197	267
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	460	(690)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	(3 043)	(1 187)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	614	(1 610)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(84)	(31)
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	9	-
Rabais sur frais	358	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	111	-
Total des autres revenus	394	(31)
Total des revenus	1 008	(1 641)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	394	43
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	215	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	5	-
Retenues d'impôts	480	40
Taxe de vente harmonisée	8	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	1 103	85
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	(1)
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(95)	(1 725)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts couvertes	473	(668)	2,79	(3,34)	169 613	200 000
Parts non couvertes	(568)	(1 057)	(0,09)	(2,07)	6 230 387	510 989

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	2 393	4 827	17 715	12 259	20 108	17 086
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	473	(668)	(568)	(1 057)	(95)	(1 725)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(26)	(38)	(2 047)	(104)	(2 073)	(142)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(16)	-	(11)	-	(27)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(42)	(38)	(2 058)	(104)	(2 100)	(142)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	5 244	-	332 427	2 348	337 671	2 348
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	5 244	-	332 427	2 348	337 671	2 348
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 675	(706)	329 801	1 187	335 476	481
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	8 068	4 121	347 516	13 446	355 584	17 567

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	(95)	(1 726)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(460)	690
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	4	-
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	215	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	3 043	1 187
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	725	1 262
Achat de placements et de dérivés	(336 524)	(3 287)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(732)	(2)
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	127	-
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	13	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(333 684)	(1 875)
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(2 193)	(208)
Produit de l'émission de parts rachetables	337 672	2 348
Montant versé au rachat de parts rachetables	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	335 479	2 140
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	(4)	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	1 795	265
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	276	5
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	2 067	270
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	1 985	-
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	(5)	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
JPY	8 912	Capcom Co. Ltd.	329 673	323 147	
JPY	26 724	Dentsu Group Inc.	1 140 471	1 185 170	
JPY	3 186	GungHo Online Entertainment	78 242	78 592	
JPY	8 764	KOEI TECMO HOLDINGS Co. Ltd.	479 681	529 961	
JPY	3 077	Konami Holdings Corp.	233 493	228 979	
JPY	6 685	Nexon Co. Ltd.	262 507	184 669	
JPY	12 621	Nintendo Co. Ltd.	8 855 608	9 099 190	
JPY	38 921	SoftBank Group Corp.	4 275 778	3 376 186	
JPY	4 669	Square Enix Holdings Co. Ltd.	321 316	287 024	
JPY	1 804	TOEI ANIMATION Co. Ltd.	233 946	265 072	
			16 210 715	15 557 990	4,37
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
JPY	7 429	ABC-Mart Inc.	526 004	527 973	
JPY	23 121	ALISIN Corp.	1 094 616	1 225 299	
JPY	7 110	Asics Corp.	154 711	223 063	
JPY	10 713	Bandai Namco Holdings Inc.	962 566	921 287	
JPY	82 723	Bridgestone Corp.	4 214 665	4 665 406	
JPY	15 377	Casio Computer Co. Ltd.	351 315	318 585	
JPY	8 168	DAIDO METAL CO. LTD.	55 306	54 495	
JPY	10 396	Daikyonishikawa Corp.	95 992	80 031	
JPY	67 023	DENSO Corp.	5 522 825	5 667 321	
JPY	8 594	Eagle Industry Co. Ltd.	117 141	107 676	
JPY	6 899	Exedy Corp.	136 837	125 386	
JPY	3 819	F.C.C. Co. Ltd.	80 321	68 940	
JPY	2 016	Fast Retailing Co. Ltd.	2 067 887	1 881 025	
JPY	4 670	Fujitsu General Ltd.	154 881	153 546	
JPY	4 774	Futaba Industrial Co. Ltd.	30 218	27 856	
JPY	637	GLOBERIDE Inc.	31 337	31 875	
JPY	5 305	G-TEKT Corp.	89 434	91 681	
JPY	1 487	Hagihara Industries Inc.	24 500	23 591	
JPY	168 934	Honda Motor Co. Ltd.	6 351 079	6 690 945	
JPY	3 606	H-ONE Co. Ltd.	33 200	30 455	
JPY	3 076	IDOM Inc.	21 836	22 444	
JPY	79 541	Isuzu Motors Ltd.	1 058 912	1 301 857	
JPY	4 243	Koito Manufacturing Co. Ltd.	355 456	327 109	
JPY	2 230	KOMATSU MATERE Co. Ltd.	24 494	22 442	
JPY	2 124	KURABO INDUSTRIES Ltd.	47 206	45 072	
JPY	2 124	Mizuno Corp.	55 439	55 973	
JPY	2 550	Musashi Seimitsu Industry Co. Ltd.	56 182	70 385	
JPY	19 195	NGK Spark Plug Co. Ltd.	413 902	352 501	
JPY	11 137	NHK Spring Co. Ltd.	105 835	113 320	
JPY	7 534	NIFCO Inc.	331 232	352 614	
JPY	2 441	Nihon Flush Co. Ltd.	36 162	34 097	
JPY	425	Nittoku Co. Ltd.	16 612	18 730	
JPY	10 609	Nok Corp.	183 933	163 104	
JPY	51 754	Onward Kashiyama Co. Ltd.	182 829	194 010	
JPY	4 351	Pacific Industrial Co. Ltd.	65 452	58 107	
JPY	202 234	Panasonic Corp.	3 021 773	2 900 469	
JPY	18 029	Rakuten Group Inc.	286 788	252 238	
JPY	1 273	Riken Corp.	35 675	36 288	
JPY	2 123	Rinnai Corp.	272 415	250 361	
JPY	8 487	Ryohin Keikaku Co. Ltd.	239 890	220 624	
JPY	1 384	Saizeriya Co. Ltd.	37 208	41 150	
JPY	3 186	Sanyo Trading Co. Ltd.	41 586	46 281	
JPY	23 653	Sega Sammy Holdings Inc.	442 464	384 756	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE (suite)					
JPY	6 792	Seiko Corp.	158 331	167 998	
JPY	4 036	Seiren Co. Ltd.	90 375	98 794	
JPY	37 440	Sekisui Chemical Co. Ltd.	860 994	793 237	
JPY	22 695	Sharp Corp.	466 240	464 125	
JPY	2 654	Shimano Inc.	747 228	780 232	
JPY	2 019	SHOEI CO. LTD.	100 635	94 495	
JPY	22 699	Sony Group Corp.	2 853 673	2 738 894	
JPY	6 474	Stanley Electric Co. Ltd.	241 933	232 218	
JPY	64 053	Subaru Corp.	1 583 667	1 566 113	
JPY	65 116	Sumitomo Electric Industries Ltd.	1 246 899	1 190 717	
JPY	9 548	Sumitomo Forestry Co.	253 029	216 780	
JPY	24 923	Sumitomo Rubber Industries Ltd.	370 613	426 270	
JPY	27 896	Suzuki Motor Corp.	1 459 459	1 463 101	
JPY	9 652	TOKAI RIKKA CO. LTD.	206 875	191 789	
JPY	7 744	Tokai Rubber Industries Ltd.	62 339	62 380	
JPY	6 684	Tomy Co. Ltd.	77 127	70 993	
JPY	4 352	Topre Corp.	78 752	77 250	
JPY	1 167	Toridoll.corp	22 554	24 530	
JPY	12 833	Toyo Tire & Rubber Co. Ltd.	294 304	336 177	
JPY	7 217	Toyoda Gosei Co. Ltd.	232 828	220 220	
JPY	14 636	Toyota Boshoku Corp.	321 825	375 081	
JPY	181 665	Toyota Motor Corp.	17 321 133	19 680 336	
JPY	4 242	TPR Co. Ltd.	78 416	69 903	
JPY	11 772	TS TECH Co. Ltd.	220 174	225 246	
JPY	18 560	VT HOLDINGS CO. LTD.	90 537	95 460	
JPY	4 033	Wacoal Corp.	114 595	113 164	
JPY	7 426	Yamaha Corp.	520 654	499 591	
JPY	30 863	Yamaha Motor Co. Ltd.	954 628	1 039 889	
JPY	21 639	Yokohama Rubber Co. Ltd. (The)	492 461	574 346	
JPY	741	YOKOWO CO. LTD.	23 387	20 982	
JPY	2 868	Zojirushi Corp.	58 405	52 988	
			61 032 186	64 143 667	18,04
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
JPY	24 502	Ajinomoto Co. Inc.	639 109	788 386	
JPY	1 062	Ariake Japan Co. Ltd.	79 822	81 637	
JPY	43 268	Asahi Group Holdings Ltd.	2 345 600	2 505 878	
JPY	6 580	Fuji Oil Holdings Inc.	223 022	194 028	
JPY	458 872	Japan Tobacco Inc.	11 033 702	10 743 420	
JPY	2 653	KAGOME CO. LTD.	99 441	86 755	
JPY	37 865	Kao Corp.	3 070 960	2 887 477	
JPY	4 454	Kikkoman Corp.	349 793	364 247	
JPY	90 673	Kirin Holdings Co. Ltd.	2 208 550	2 191 182	
JPY	2 231	KOSE Corp.	425 565	435 094	
JPY	9 015	Lion Corp.	220 144	189 290	
JPY	3 823	Mandom Corp.	88 988	88 291	
JPY	1 278	Ministop Co. Ltd.	21 351	20 190	
JPY	18 882	Nippon Suisan Kaisha Ltd.	116 589	111 441	
JPY	18 032	Nisshin Seifun Group Inc.	372 783	326 918	
JPY	5 519	Nissin Foods Holdings Co. Ltd.	499 447	492 598	
JPY	5 201	Pigeon Corp.	232 274	181 624	
JPY	3 609	Riken Vitamin Co. Ltd.	58 750	62 652	
JPY	4 137	ROHTO Pharmaceutical Co. Ltd.	137 657	137 775	
JPY	1 169	SAKATA SEED CORP.	52 143	47 605	
JPY	79 114	Seven & I Holdings Co. Ltd.	4 067 290	4 675 471	
JPY	8 909	Shiseido Co. Ltd.	800 080	812 169	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE (suite)					
JPY	18 666	Suntory Beverage & Food Ltd.	841 504	870 502	
JPY	10 817	Takara Holdings Inc.	178 374	167 147	
JPY	7 107	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	368 484	338 972	
JPY	10 927	Uni-Charm Corp.	542 969	544 942	
JPY	6 792	Yakult Honsha Co. Ltd.	433 638	476 640	
			29 508 029	29 822 331	8,39
ÉNERGIE					
JPY	587 082	ENEOS Holdings Inc.	3 222 094	3 045 091	
JPY	58 011	Idemitsu Kosan Co. Ltd.	1 842 544	1 736 493	
JPY	256 004	Inpex Corp.	2 312 003	2 367 791	
			7 376 641	7 149 375	2,01
SERVICES FINANCIERS					
JPY	59 496	Acom Co. Ltd.	336 270	321 274	
JPY	29 165	AEON Financial Services Co. Ltd.	469 099	425 935	
JPY	138 502	Dai-ichi Life Holdings Inc.	3 098 080	3 143 033	
JPY	2 974	Ehime Bank Ltd. (The)	33 535	25 914	
JPY	6 472	GCA Corp.	61 289	70 258	
JPY	226 036	Mitsubishi HC Capital Inc.	1 644 796	1 500 502	
JPY	2 452 771	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	16 919 721	16 421 872	
JPY	444 343	Mizuho Financial Group Inc.	8 204 824	7 869 988	
JPY	16 968	Monex Group Inc.	166 120	141 604	
JPY	430 234	Nomura Holdings Inc.	3 053 419	2 725 475	
JPY	27 681	SBI Holdings Inc.	967 601	811 613	
JPY	43 271	Sompo Holdings Inc.	2 093 522	1 982 248	
JPY	23 546	SPARX Group Co. Ltd.	80 848	67 251	
JPY	274 984	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	12 511 499	11 750 280	
JPY	59 391	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc.	2 573 452	2 337 713	
JPY	86 430	Tokio Marine Holdings Inc.	5 339 127	4 925 580	
			57 553 202	54 520 540	15,33
SOINS DE SANTÉ					
JPY	2 020	ASAHI INTECC CO. LTD.	69 147	59 858	
JPY	157 698	Astellas Pharma Inc.	3 131 511	3 403 588	
JPY	100 111	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	4 907 080	4 916 702	
JPY	89 401	Daiichi Sankyo Co. Ltd.	3 035 263	2 388 357	
JPY	25 027	Eisai Co. Ltd.	2 183 896	3 050 509	
JPY	2 863	EPS Co. Ltd.	40 759	57 432	
JPY	4 137	Hisamitsu Pharmaceutical Co. Inc.	312 769	252 473	
JPY	7 849	Hoya Corp.	1 126 374	1 289 909	
JPY	1 487	JEOL Ltd.	82 431	107 837	
JPY	26 305	Kyowa Kirin Co. Ltd.	960 464	1 156 316	
JPY	3 606	M3 Inc.	302 670	326 399	
JPY	2 548	MANI INC.	74 564	72 377	
JPY	4 565	NAKANISHI Inc.	114 898	123 763	
JPY	5 412	Nichi-iko Pharmaceutical Co. Ltd.	61 142	53 739	
JPY	4 137	Nihon Kohden Corp.	151 623	146 314	
JPY	4 773	Nipro Corp.	73 665	69 919	
JPY	20 574	Olympus Corp.	524 518	506 827	
JPY	32 981	Ono Pharmaceutical Co. Ltd.	1 045 659	912 184	
JPY	61 826	Otsuka Holdings Co. Ltd.	3 175 238	3 177 835	
JPY	17 078	Santen Pharmaceutical Co. Ltd.	291 408	291 521	
JPY	4 986	Sawai Group Holdings Co. Ltd.	298 914	275 359	
JPY	3 928	SEIKAGAKU CORP.	47 978	47 374	
JPY	20 153	Shionogi & Co.	1 344 859	1 302 073	
JPY	27 789	Sumitomo Dainippon Pharma Co. Ltd.	634 124	721 768	
JPY	6 473	Sysmex Corp.	816 366	953 282	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
SOINS DE SANTÉ (suite)					
JPY	956	TAKARA BIO INC.	30 693	31 625	
JPY	245 288	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	10 990 231	10 177 579	
JPY	15 907	Terumo Corp.	734 816	798 980	
JPY	4 348	Zeria Pharmaceutical Co. Ltd.	103 321	101 629	
			36,666,381	36,773,528	10.34
PRODUITS INDUSTRIELS					
JPY	8 806	Aica Kogyo Co. Ltd.	400 053	383 656	
JPY	7 532	Aida Engineering Ltd.	80 793	83 109	
JPY	3 077	ALCONIX CORP.	56 426	50 293	
JPY	45 498	Amada Co. Ltd.	645 763	570 051	
JPY	3 183	ANEST IWATA Corp.	37 540	35 938	
JPY	5 198	Bando Chemical Industries Ltd.	46 271	51 730	
JPY	4 773	BeNext-Yumeshin Group Co.	78 575	67 896	
JPY	4 142	Central Glass Co. Ltd.	109 321	98 339	
JPY	2 126	CKD Corp.	52 954	55 504	
JPY	2 017	COSEL CO. LTD.	25 118	23 651	
JPY	3 821	Daifuku Co. Ltd.	443 554	430 140	
JPY	2 439	DAIHEN Corp.	131 466	125 854	
JPY	10 500	Daikin Industries Ltd.	2 630 727	2 423 772	
JPY	1 915	Denyo Co. Ltd.	44 774	41 620	
JPY	10 080	DMG Mori Seiki Co. Ltd.	209 409	224 248	
JPY	5 727	Ebara Corp.	296 918	349 508	
JPY	6 368	FANUC Corp.	1 892 836	1 903 701	
JPY	11 032	Fuji Electric Co. Ltd.	607 382	638 798	
JPY	8 590	Fujitec Co. Ltd.	237 450	236 143	
JPY	5 411	Furukawa Co. Ltd.	82 936	75 462	
JPY	6 788	Furukawa Electric Co. Ltd.	228 370	209 553	
JPY	5 410	GLORY LTD.	148 806	139 006	
JPY	6 475	GS Yuasa Corp.	216 136	204 802	
JPY	3 292	HANWA Co. Ltd.	125 141	117 898	
JPY	849	Harmonic Drive Systems Inc.	69 693	57 970	
JPY	7 535	Hitachi Construction Machinery Co. Ltd.	291 405	285 407	
JPY	6 366	Hitachi Transport System Ltd.	257 082	327 068	
JPY	21 319	Hitachi Zosen Corp.	200 485	170 541	
JPY	2 228	Hokuetsu Industries Co. Ltd.	28 145	28 039	
JPY	2 758	HOSHIZAKI ELECTRIC CO. LTD.	311 530	290 475	
JPY	530	HOSOKAWA MICRON CORP.	37 742	35 183	
JPY	2 653	IDEC CORP.	54 528	62 188	
JPY	17 290	Iino Kaiun Kaisha Ltd.	104 990	84 491	
JPY	7 853	Inabata & Co. Ltd.	151 163	149 909	
JPY	1 383	ISEKI & CO. LTD.	25 258	22 836	
JPY	240 945	ITOCHU Corp.	9 255 621	8 602 208	
JPY	2 016	Iwaki Co. Ltd.	21 685	20 738	
JPY	3 397	Japan Steel Works Ltd. (The)	99 064	108 166	
JPY	10 288	JGC Holdings Corp.	158 055	118 799	
JPY	46 449	JTEKT Corp.	598 927	590 258	
JPY	4 987	JUKI CORP.	50 252	44 122	
JPY	69 781	Kajima Corp.	1 223 387	1 095 401	
JPY	4 139	Kintetsu World Express Inc.	123 117	107 965	
JPY	2 231	KITO CORP.	44 096	41 618	
JPY	7 321	Kitz Corp.	57 090	61 668	
JPY	69 037	Komatsu Ltd.	2 586 503	2 126 237	
JPY	69 889	Kubota Corp.	1 971 522	1 752 080	
JPY	6 791	Kurita Water Industries Ltd.	363 395	403 834	
JPY	29 381	Lixil Group Corp.	1 004 238	941 769	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		PRODUITS INDUSTRIELS (suite)			
JPY	6 050	Mabuchi Motor Co. Ltd.	327 670	283 496	
JPY	9 016	Makita Corp.	491 805	526 087	
JPY	228 007	Marubeni Corp.	2 375 419	2 457 606	
JPY	3 927	Meidensha Corp.	106 674	96 783	
JPY	18 031	MinebeaMitsumi Inc.	561 840	591 237	
JPY	3 396	MISUMI Group Inc.	125 592	142 461	
JPY	257 063	Mitsubishi Corp.	9 039 579	8 684 353	
JPY	167 133	Mitsubishi Electric Corp.	3 205 188	3 006 796	
JPY	33 618	Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	1 311 483	1 226 108	
JPY	4 561	Mitsubishi Nichiyu Forklift Co. Ltd.	63 916	51 751	
JPY	3 930	MITSUBISHI PENCIL Co. Ltd.	69 655	63 051	
JPY	2 974	Mitsuboshi Belting Ltd.	59 295	58 066	
JPY	2 868	MITSUI-SOKO Co. Ltd.	73 330	80 827	
JPY	3 822	Miura Co. Ltd.	241 966	205 319	
JPY	7 424	Nabtesco Corp.	407 420	347 880	
JPY	1 702	Nachi-Fujikoshi Corp.	89 127	74 247	
JPY	18 032	Nagase & Co. Ltd.	355 438	333 557	
JPY	22 168	NGK Insulators Ltd.	512 978	461 014	
JPY	6 157	Nichicon Corp.	77 255	82 088	
JPY	9 545	Nidec Corp.	1 379 202	1 371 088	
JPY	4 244	Nikkiso Co. Ltd.	57 415	52 890	
JPY	11 241	Nippon Express Co. Ltd.	1 055 797	1 061 005	
JPY	1 274	Nippon Koei Co. Ltd.	43 923	43 850	
JPY	2 972	Nippon Pillar Packing Co. Ltd.	61 508	73 578	
JPY	3 716	Nippon Steel Trading Corp.	177 543	181 175	
JPY	5 413	Nippon Thompson Co. Ltd.	39 867	36 598	
JPY	15 381	Nippon Yusen Kabushiki Kaisha	687 623	966 129	
JPY	638	Nissei ASB Machine Co. Ltd.	37 830	35 128	
JPY	22 168	Nisshinbo Holdings Inc.	216 623	237 185	
JPY	2 227	Nissin Corp.	37 384	36 375	
JPY	9 440	Nissin Electric Co. Ltd.	132 680	147 765	
JPY	2 443	Nitta Corp.	74 423	70 784	
JPY	1 382	Nitto Boseki Co. Ltd.	61 509	52 886	
JPY	1 380	Noritake Co. Ltd.	59 702	64 973	
JPY	3 079	Noritz Corp.	60 456	63 826	
JPY	3 080	NS United Kaiun Kaisha Ltd.	74 730	83 227	
JPY	28 634	NSK Ltd.	354 847	299 978	
JPY	1 804	Obara Group Inc.	77 816	76 684	
JPY	78 799	Obayashi Corp.	903 213	776 289	
JPY	3 395	Oiles Corp.	64 982	58 634	
JPY	4 141	OKABE CO. LTD.	36 387	29 753	
JPY	1 277	Okamoto Industries Inc.	61 601	58 271	
JPY	1 490	Okuma Corp.	106 106	90 267	
JPY	957	Organo Corp.	72 122	66 518	
JPY	4 775	Osaki Electric Co. Ltd.	32 992	32 391	
JPY	6 156	OSG Corp.	136 758	132 281	
JPY	8 275	Outsourcing Inc.	163 697	186 400	
JPY	45 923	Penta-Ocean Construction Co. Ltd.	437 372	396 052	
JPY	10 503	Persol Holdings Co. Ltd.	256 585	257 211	
JPY	2 123	PILOT CORP.	86 570	89 059	
JPY	29 168	Recruit Holdings Co. Ltd.	1 678 326	1 780 066	
JPY	3 500	Sansei Technologies Inc.	31 536	32 723	
JPY	29 693	Sanwa Shutter Corp.	477 213	451 867	
JPY	639	Sanyo Denki Co. Ltd.	49 109	54 752	
JPY	3 398	SATO HOLDINGS CO.	106 293	103 270	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
JPY	4 776	Shibaura Machine Co.	150 770	130 708	
JPY	1 487	SHIBUYA Corp.	59 489	51 513	
JPY	9 970	ShinMaywa Industries Ltd.	116 664	106 673	
JPY	2 231	Sinfonia Technology Co. Ltd.	35 097	31 089	
JPY	1 381	SMC Corp.	978 103	1 011 511	
JPY	4 884	Sodick Co. Ltd.	56 939	55 634	
JPY	215 065	Sojitz Corp.	789 743	803 816	
JPY	5 200	STAR MICRONICS Co. Ltd.	98 568	98 104	
JPY	219 522	Sumitomo Corp.	3 902 161	3 644 375	
JPY	6 999	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	252 421	238 946	
JPY	5 626	Taikisha Ltd.	193 243	208 078	
JPY	3 077	Takeuchi Mfg. Co. Ltd.	102 854	94 990	
JPY	9 439	TATSUTA ELECTRIC WIRE AND CABLE CO. LTD.	66 357	58 026	
JPY	3 291	Teikoku Electric Manufacturing Co. Ltd.	49 960	46 668	
JPY	2 126	THK Co. Ltd.	89 719	78 630	
JPY	1 913	Torishima Pump Mfg. Co. Ltd.	18 792	18 376	
JPY	9 868	Toshiba Corp.	464 118	529 011	
JPY	9 971	Toto Ltd.	696 562	639 659	
JPY	1 698	Toyo Tanso Co. Ltd.	42 026	53 120	
JPY	36 591	Toyota Tsusho Corp.	1 986 280	2 143 264	
JPY	4 246	Tsubakimoto Chain Co.	151 675	150 169	
JPY	2 652	TSUGAMI Corp.	50 918	50 566	
JPY	1 167	Union Tool Co.	46 460	51 885	
JPY	954	Weathernews Inc.	58 492	61 840	
JPY	3 291	YAMABIKO CORP.	44 881	44 611	
JPY	2 229	Yushin Precision Equipment Co. Ltd.	23 457	20 069	
			67 330 811	64 814 628	18,23
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
JPY	8 381	Advantest Corp.	882 225	935 992	
JPY	3 928	Ai Holdings Corp.	95 037	95 975	
JPY	8 379	Alps Alpine Co. Ltd.	136 153	109 656	
JPY	6 895	Amano Corp.	219 974	215 471	
JPY	8 910	Anritsu Corp.	234 522	205 873	
JPY	22 696	Brother Industries Ltd.	609 504	561 380	
JPY	5 196	Canon Electronics Inc.	103 850	99 478	
JPY	256 637	Canon Inc.	7 293 631	7 195 381	
JPY	3 504	Cybernet Systems Co. Ltd.	34 281	28 147	
JPY	1 167	Daitron Co. Ltd.	23 651	26 079	
JPY	8 168	Dexerials Corp.	178 042	213 607	
JPY	1 597	Disco Corp.	614 624	604 904	
JPY	1 806	EIZO Corp.	86 609	100 041	
JPY	3 500	Elematec Corp.	44 929	51 115	
JPY	2 230	ESPEC Corp.	48 218	55 706	
JPY	2 445	Ferrotec Corp.	63 273	93 156	
JPY	1 486	Foster Electric Co. Ltd.	21 540	16 181	
JPY	26 728	Fujifilm Holdings Corp.	2 046 893	2 456 875	
JPY	14 318	Fujitsu Ltd.	2 635 120	3 322 674	
JPY	1 489	Furuno Electric Co. Ltd.	18 546	16 679	
JPY	211	GMO Cloud K.K.	13 884	11 076	
JPY	2 763	Hakuto Co. Ltd.	42 301	46 394	
JPY	3 714	Hamamatsu Photonics K.K.	264 814	277 625	
JPY	1 805	Hirose Electric Co. Ltd.	340 933	327 245	
JPY	76 783	Hitachi Ltd.	4 602 086	5 449 197	
JPY	2 550	Horiba Ltd.	205 021	204 840	
JPY	3 292	Ibiden Co. Ltd.	180 106	220 003	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
JPY	2 655	INNOTECH CORP.	39 318	40 463	
JPY	849	IRISO ELECTRONICS CO. LTD.	51 277	50 771	
JPY	5 197	Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	109 523	113 819	
JPY	4 140	KAGA ELECTRONICS CO. LTD.	119 914	137 552	
JPY	2 866	Keyence Corp.	1 654 244	1 792 870	
JPY	7 427	Kyosan Electric Manufacturing Co. Ltd.	36 226	34 968	
JPY	1 913	Lasertec Corp.	333 638	460 797	
JPY	7 426	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc.	190 898	221 295	
JPY	4 666	MARUBUN Corp.	28 876	32 796	
JPY	211	Maruwa Co. Ltd.	26 893	26 342	
JPY	10 818	MCJ Co. Ltd.	122 692	149 541	
JPY	1 274	Meiko Electronics Co. Ltd.	37 657	46 337	
JPY	42 208	Murata Manufacturing Co. Ltd.	4 204 794	3 994 248	
JPY	17 184	NEC Corp.	1 223 826	1 096 636	
JPY	2 125	Nippon Ceramic Co. Ltd.	65 003	69 252	
JPY	15 062	Nippon Electric Glass Co. Ltd.	449 780	438 597	
JPY	4 034	Nissha Printing Co. Ltd.	63 031	75 206	
JPY	60 980	NTT Data Corp.	1 177 426	1 179 039	
JPY	12 409	Oki Electric Industry Co. Ltd.	163 632	140 938	
JPY	9 549	Omron Corp.	925 921	938 590	
JPY	2 017	OPTEX GROUP Co. Ltd.	39 341	41 766	
JPY	3 821	OPTORUN Co. Ltd.	120 157	105 297	
JPY	4 670	Restar Holdings Corp.	107 548	98 265	
JPY	1 592	Riken Keiki Co. Ltd.	51 247	47 157	
JPY	5 413	Rohm Co. Ltd.	646 207	620 227	
JPY	529	RORZE CORP.	50 638	57 721	
JPY	3 714	Ryoden Trading Co. Ltd.	71 050	67 334	
JPY	2 549	Ryosan Co. Ltd.	68 278	57 418	
JPY	3 293	Sanshin Electronics Co. Ltd.	77 596	79 394	
JPY	743	SCREEN Holdings Co. Ltd.	79 621	91 019	
JPY	64 267	Seiko Epson Corp.	1 386 299	1 401 053	
JPY	531	Shibaura Mechatronics Corp.	33 098	48 461	
JPY	8 061	Shimadzu Corp.	350 526	386 273	
JPY	5 093	Shinko Electric Industries Co. Ltd.	182 812	230 981	
JPY	3 186	SILX Corp.	58 287	50 511	
JPY	14 640	SUMCO Corp.	431 506	445 092	
JPY	1 808	Sun-Wa Technos Corp.	23 008	24 428	
JPY	4 351	Taiyo Yuden Co. Ltd.	253 692	266 504	
JPY	3 396	Tamron Co. Ltd.	84 312	92 259	
JPY	3 820	TAMURA CORP.	23 847	35 502	
JPY	5 201	TDK Corp.	878 014	782 782	
JPY	3 183	TOA Corp.	33 875	31 677	
JPY	1 275	Tokyo Electron Device Ltd.	68 705	77 811	
JPY	16 122	Tokyo Electron Ltd.	8 039 798	8 648 193	
JPY	2 654	TOKYO SEIMITSU CO. LTD.	154 389	148 940	
JPY	16 759	Trend Micro Inc.	1 038 794	1 088 211	
JPY	2 974	ULVAC Inc.	157 148	186 806	
JPY	637	V Technology Co. Ltd.	39 270	37 951	
JPY	7 530	Wacom Co. Ltd.	62 018	59 312	
JPY	2 867	YAMAICHI ELECTRONICS Co. Ltd.	49 510	53 162	
JPY	7 213	YASKAWA Electric Corp.	427 194	436 976	
JPY	17 182	Yokogawa Electric Corp.	399 646	318 217	
			47 551 767	50 097 507	14,09

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX					
JPY	15 700	ADEKA Corp.	372 758	365 214	
JPY	25 349	AGC Inc.	1 326 762	1 317 919	
JPY	2 230	Arakawa Chemical Industries Ltd.	32 790	29 657	
JPY	14 640	Asahi Holdings Inc.	360 372	370 120	
JPY	146 562	Asahi Kasei Corp.	2 064 497	1 995 727	
JPY	3 185	ASAHI YUKIZAI Corp.	53 311	47 545	
JPY	2 016	CHORI CO. LTD.	38 106	38 687	
JPY	10 396	Chugoku Marine Paints Ltd.	116 035	99 517	
JPY	43 591	Daicel Corp.	433 932	444 514	
JPY	2 549	Daido Steel Co. Ltd.	148 666	156 129	
JPY	7 426	DAIKI Aluminium Industry Co. Ltd.	86 852	93 041	
JPY	1 171	Dainichiseika Color & Chemicals Mfg. Co. Ltd.	32 889	29 944	
JPY	9 970	Denka Co. Ltd.	484 263	411 009	
JPY	9 654	DIC Corp.	319 363	302 122	
JPY	5 410	DOWA HOLDINGS CO. LTD.	283 720	264 069	
JPY	2 865	Fuji Seal International Inc.	79 879	74 445	
JPY	3 187	Fujimi Inc.	152 646	179 918	
JPY	1 380	Fujimori Kogyo Co. Ltd.	67 597	62 510	
JPY	1 914	Fuso Chemical Co. Ltd.	87 216	87 552	
JPY	2 550	Harima Chemicals Group Inc.	28 190	25 577	
JPY	20 468	Hokuetsu Corp.	129 267	131 763	
JPY	1 172	JCU Corp.	51 064	46 812	
JPY	2 864	JSP Corp.	59 775	50 965	
JPY	16 546	JSR Corp.	630 233	620 261	
JPY	6 684	Kaneka Corp.	335 759	333 712	
JPY	13 048	Kansai Paint Co. Ltd.	417 577	412 122	
JPY	3 292	Kanto Denka Kogyo Co. Ltd.	33 612	36 398	
JPY	2 547	KH Neochem Co. Ltd.	80 599	73 343	
JPY	1 384	KROSAKI HARIMA Corp.	72 439	66 474	
JPY	4 667	KUMIAI CHEMICAL INDUSTRY Co. Ltd.	51 102	44 259	
JPY	45 391	Kuraray Co. Ltd.	645 595	540 351	
JPY	2 232	KUREHA Corp.	194 614	160 121	
JPY	7 851	KYOEI STEEL LTD.	141 046	126 834	
JPY	11 247	Lintec Corp.	322 511	302 410	
JPY	8 378	Maruichi Steel Tube Ltd.	254 978	243 869	
JPY	179 752	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	1 712 036	1 872 104	
JPY	23 863	Mitsubishi Gas Chemical Co. Inc.	703 484	627 252	
JPY	8 063	Mitsubishi Materials Corp.	232 608	199 256	
JPY	21 954	Mitsui Chemicals Inc.	885 250	939 336	
JPY	4 350	Mitsui Mining & Smelting Co. Ltd.	178 228	149 480	
JPY	1 699	Moriroku Holdings Co. Ltd.	42 889	41 494	
JPY	8 381	Nihon Nohyaku Co. Ltd.	52 604	47 127	
JPY	9 336	Nihon Parkerizing Co. Ltd.	122 079	115 514	
JPY	1 809	Nippon Carbon Co. Ltd.	93 556	84 566	
JPY	16 758	Nippon Kayaku Co. Ltd.	206 092	196 315	
JPY	22 480	Nippon Paint Holdings Co. Ltd.	424 164	378 216	
JPY	22 274	Nippon Sanso Holdings Corp.	523 572	565 853	
JPY	3 396	Nippon Shokubai Co. Ltd.	235 758	202 326	
JPY	3 399	Nippon Soda Co. Ltd.	134 255	121 920	
JPY	2 975	Nippon Valqua Industries Ltd.	72 795	72 125	
JPY	1 278	Nippon Yakin Kogyo Co. Ltd.	31 459	32 367	
JPY	10 716	Nissan Chemical Corp.	724 436	650 390	
JPY	18 668	Nitto Denko Corp.	1 921 176	1 726 610	
JPY	7 320	NOF Corp.	475 457	472 859	
JPY	92 368	Oji Holdings Corp.	745 141	657 483	

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
MATÉRIAUX (suite)					
JPY	2 973	Osaka Soda Co. Ltd.	88 327	80 568	
JPY	4 672	Riken Technos Corp.	28 572	32 057	
JPY	851	SAKAI CHEMICAL INDUSTRY CO. LTD.	19 764	17 565	
JPY	4 884	Sakata Inx Corp.	59 707	55 089	
JPY	3 182	Sanyo Chemical Industries Ltd.	198 003	192 061	
JPY	5 091	Sekisui Plastics Co. Ltd.	35 028	34 364	
JPY	3 503	Shikoku Chemicals Corp.	50 313	51 198	
JPY	18 666	Shin-Etsu Chemicals Co. Ltd.	3 809 811	3 869 359	
JPY	7 321	Shin-Etsu Polymer Co. Ltd.	84 828	83 803	
JPY	634	STELLA CHEMIFA Corp.	22 961	20 386	
JPY	2 865	Sumitomo Bakelite Co. Ltd.	147 720	156 945	
JPY	171 267	Sumitomo Chemical Co. Ltd.	1 119 290	1 125 462	
JPY	12 514	Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	680 099	603 843	
JPY	1 804	Sumitomo Seiko Chemicals Co.	81 248	72 457	
JPY	3 397	T. HASEGAWA CO. LTD.	81 391	93 234	
JPY	9 019	Taiheiyo Cement Corp.	290 676	245 220	
JPY	2 972	Taiyo Ink Manufacturing Co.	192 503	174 080	
JPY	1 381	Takasago International Corp.	42 314	41 601	
JPY	2 127	TAYCA CORP.	35 484	30 446	
JPY	21 742	Teijin Ltd.	469 455	410 675	
JPY	3 925	Toho Titanium Co. Ltd.	44 451	45 236	
JPY	20 788	Tokai Carbon Co. Ltd.	407 701	355 315	
JPY	5 520	Tokuyama Corp.	166 378	139 307	
JPY	2 443	TOKYO OHKA KOGYO CO. Ltd.	186 420	191 066	
JPY	125 774	Toray Industries Inc.	1 028 732	1 037 137	
JPY	31 816	Tosoh Corp.	741 296	680 116	
JPY	8 064	Toyo Ink Mfg. Co. Ltd.	190 396	177 059	
JPY	8 383	Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	131 366	141 882	
JPY	7 111	Toyobo Co. Ltd.	117 333	105 755	
JPY	1 596	UACJ Corp.	46 360	49 555	
JPY	15 801	Ube Industries Ltd.	423 544	396 475	
JPY	11 350	Zeon Corp.	217 782	194 631	
			30 746 307	29 641 450	8,34
SERVICES PUBLICS					
JPY	27 573	Electric Power Development Co. Ltd.	571 746	487 590	0,14
Total des actions			354 547 785	353 008 606	99,28
Ajustement au titre des coûts de transaction			(193 663)		
Total des placements			354 354 122	353 008 606	99,28
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(109 268)	(0,03)
Autres actifs (passifs) nets				2 684 968	0,75
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				355 584 306	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	7 974 749	JPY	724 565 000	0,01	(109 268)
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(109 268)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(109)	-	-	(109)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(109)	-	-	(109)

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	17	-	-	17
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	17	-	-	17
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	184	s.o.
Paiements indirects [†]	52	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2021	2020	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	100 000	200 000	700 000	500 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	200 000	-	12 800 000	100 000
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	-	-	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	300 000	200 000	13 500 000	600 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds. Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,480*
Parts non couvertes	0,480

*Le 23 juin 2021, le taux des frais de gestion annuels des parts couvertes est passé de 0,51 % à 0,48 %.

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	40 467	-
Garanties (hors trésorerie)	45 271	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	15	-
Charges	(6)	-
Revenu tiré des prêts de titres	9	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	40,1	-

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

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Produits industriels	18,6
Biens de consommation discrétionnaire	17,0
Services financiers	14,4
Technologies de l'information	13,2
Soins de santé	11,7
Biens de consommation de base	9,0
Matériaux	8,3
Services de communication	4,9
Énergie	1,7
Autres actifs (passifs) nets	1,0
Services publics	0,1
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	0,1
Total	100,0

Risque de crédit

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, l'exposition du Fonds au risque de crédit lié aux dérivés était peu importante.

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions japonaises et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale au Japon.

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

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total d'actions japonaises WisdomTree	27 673 518

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total d'actions japonaises WisdomTree	1 875 923

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

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Yen japonais	354 388	(8 084)	346 304	97,4
Total	354 388	(8 084)	346 304	97,4

Parts couvertes

au 31 décembre 2020~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Yen japonais	2 373	(2 379)	(6)	(0,3)
Total	2 373	(2 379)	(6)	(0,3)

Parts non couvertes

au 31 décembre 2020~

Devise	Exposition aux instruments financiers	Dérivés	Exposition nette	Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Yen japonais	17 566	-	17 566	99,2
Total	17 566	-	17 566	99,2

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 34 630 000 \$ (1 756 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	353 008	-	-	353 008
Dérivés, nets	-	(109)	-	(109)
Total	353 008	(109)	-	352 899

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	19 881	-	-	19 881
Dérivés, nets	-	17	-	17
Total	19 881	17	-	19 898

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

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

États financiers (non audité)

États de la situation financière

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

	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
Actif		
Actifs courants		
Placements	36 260	19 456
Placements donnés en garantie	-	-
Trésorerie	15	234
Profit latent sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	1	240
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Rabais sur frais à recevoir	1	-
Dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
Dividendes à recevoir	37	33
Intérêts à recevoir	-	-
Exonération des frais de conseil	-	-
Montant à recevoir pour la vente de placements	-	-
Montant à recevoir pour la souscription de parts	-	-
	36 314	19 963
Passif		
Passifs courants		
Placements vendus à découvert	-	-
Découvert bancaire	-	-
Perte latente sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme	482	-
Swaps, options sur swaps et options	-	-
Dividendes à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Intérêts à payer sur les placements vendus à découvert	-	-
Marge de variation quotidienne sur les dérivés	-	-
Montant à payer pour l'achat de placements	-	-
Montant à payer pour le rachat de parts	-	-
Distributions à payer aux porteurs de parts rachetables	-	176
Frais de gestion à payer	7	5
Comptes créditeurs et charges à payer	5	2
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
	494	183
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	35 820	19 780

États de la situation financière (suite)

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

	Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie (note 4) :		Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre de parts rachetables en circulation :	
	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020	au 30 juin 2021	au 31 déc. 2020
	Parts couvertes	15 778	14 482	29,16	24,50	541 082
Parts non couvertes	20 042	5 298	30,83	26,49	650 000	200 000

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

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

États financiers (non audité)

États du résultat global

pour les périodes closes les 30 juin

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

	2021	2020
Revenu		
Profit (perte) net(te) sur les placements et les dérivés		
Dividendes	338	265
Intérêts aux fins des distributions	-	-
Distributions de revenu provenant des placements	-	-
Distributions de gains en capital provenant des placements	-	-
Revenu (perte) sur les dérivés	-	-
Charge au titre des dividendes sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Charge d'intérêts sur les actifs (passifs) financiers vendus à découvert	-	-
Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	1 327	(2 375)
Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés	2 374	(2 537)
Profit (perte) net(te) total(e) sur les placements et les dérivés	4 039	(4 647)
Autres revenus		
Profit (perte) de change sur la trésorerie	(56)	5
Revenu tiré des prêts de titres (note 6)	2	-
Rabais sur frais	4	-
Revenus divers de source étrangère	-	-
Autres revenus	-	-
Total des autres revenus	(50)	5
Total des revenus	3 989	(4 642)
Charges		
Frais de gestion (note 5)	40	27
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	12	1
Frais du comité d'examen indépendant	1	-
Frais d'emprunt de titres (note 2)	-	-
Droits de garde	-	-
Coûts de communication de l'information aux porteurs de parts	-	-
Frais d'audit	-	-
Frais juridiques	-	-
Charge d'intérêts	-	-
Retenues d'impôts	39	41
Taxe de vente harmonisée	4	-
Honoraires professionnels	-	-
Frais de transaction	-	-
Impôt sur les gains en capital étrangers	-	-
Frais d'inscription	-	-
Autres frais	-	-
Total des charges	96	69
Coûts pris en charge par le gestionnaire (note 5)	-	-
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 893	(4 711)

États du résultat global (suite)

pour les périodes closes les 30 juin

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

	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par catégorie :		Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :		Nombre moyen pondéré de parts :	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Parts couvertes	2 898	(4 402)	5,11	(7,60)	567 049	579 544
Parts non couvertes	995	(310)	4,85	(6,20)	204 972	50 000

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

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

États financiers (non audité)

États de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	Parts couvertes		Parts non couvertes		Total du Fonds	
	2021	2020	2021	2020	2021	2020
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	14 482	16 349	5 298	1 487	19 780	17 836
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 898	(4 402)	995	(310)	3 893	(4 712)
Distributions aux porteurs de parts rachetables						
Revenu net de placement	(170)	(171)	(60)	(15)	(230)	(186)
Profits nets réalisés	-	-	-	-	-	-
Remboursement de capital	(1)	-	-	-	(1)	-
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(171)	(171)	(60)	(15)	(231)	(186)
Transactions sur parts rachetables						
Produit de l'émission de parts rachetables	1	-	13 809	-	13 810	-
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	-	-	-	-	-	-
Rachat de parts rachetables	(1 432)	(931)	-	-	(1 432)	(931)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	(1 431)	(931)	13 809	-	12 378	(931)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 296	(5 504)	14 744	(325)	16 040	(5 829)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	15 778	10 845	20 042	1 162	35 820	12 007

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

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

États financiers (non audité)

Tableaux des flux de trésorerie

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités d'exploitation		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 893	(4 712)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Profit) perte net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés	(1 327)	2 375
(Profit) perte de change latent(e) sur la trésorerie	-	(1)
Commissions et autres coûts de transaction de portefeuille	12	1
Variation de la (plus-value) moins-value latente des placements et des dérivés	(2 374)	2 537
Produit de la vente et de l'échéance de placements et de dérivés	1 395	1 989
Achat de placements et de dérivés	(15 175)	(1 949)
Distributions hors trésorerie provenant des placements	-	-
Fluctuation de la marge de variation quotidienne	-	-
(Augmentation) diminution du dépôt de garantie pour les placements vendus à découvert	-	-
(Augmentation) diminution des dividendes à recevoir	(5)	12
(Augmentation) diminution des intérêts à recevoir	-	-
Augmentation (diminution) des frais de gestion à payer	2	(3)
Variation des autres comptes débiteurs et créditeurs	3	-
Amortissement des produits d'intérêts	-	-
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités d'exploitation	(13 576)	249
Flux de trésorerie provenant des (affectés aux) activités de financement		
Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(406)	(245)
Produit de l'émission de parts rachetables	13 808	-
Montant versé au rachat de parts rachetables	(45)	(1)
Flux de trésorerie nets provenant des (affectés aux) activités de financement	13 357	(246)
Profit (perte) de change latent(e) sur la trésorerie	-	-
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(219)	3
Trésorerie (découvert bancaire) à l'ouverture de la période	234	24
Trésorerie (découvert bancaire) à la clôture de la période	15	27
Informations supplémentaires :		
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	295	236
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	-	-
Dividendes payés*	-	-
Intérêts payés*	-	-
Impôts à recouvrer (payés)	-	-

*Les dividendes et intérêts reçus ainsi que les dividendes et intérêts payés sont liés aux activités d'exploitation du Fonds.

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS					
SERVICES DE COMMUNICATION					
USD	1 659	Cogent Communications Holdings Inc.	141 035	158 124	
USD	11 734	Interpublic Group of Cos. Inc. (The)	378 606	472 582	
USD	813	New York Times Co. (The), catégorie A	41 889	43 889	
USD	4 634	News Corp., catégorie A	113 355	148 031	
USD	633	Nexstar Media Group Inc., catégorie A	90 512	116 037	
USD	3 009	TEGNA Inc.	61 892	69 974	
			827 289	1 008 637	2,82
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE					
USD	841	Acushnet Holdings Corp.	46 965	51 500	
USD	300	Advance Auto Parts Inc.	67 211	76 287	
USD	3 216	BorgWarner Inc.	178 046	193 507	
USD	1 203	Brunswick Corp.	121 322	148 557	
USD	89	Churchill Downs Inc.	16 617	21 873	
USD	1 591	Dick's Sporting Goods Inc.	141 883	197 595	
USD	1 020	Foot Locker Inc.	61 245	77 924	
USD	3 731	Gentex Corp.	141 262	153 040	
USD	9 010	H&R Block Inc.	236 320	262 243	
USD	10 485	Hanesbrands Inc.	224 462	242 658	
USD	227	Harley-Davidson Inc.	11 649	12 893	
USD	1 141	KB Home	54 422	57 594	
USD	625	LCI Industries	104 080	101 818	
USD	275	Lear Corp.	57 753	59 751	
USD	3 586	Leggett & Platt Inc.	206 353	230 306	
USD	123	Lithia Motors Inc., catégorie A	39 799	52 395	
USD	1 694	M.D.C. Holdings Inc.	104 086	106 254	
USD	242	Murphy USA Inc.	40 649	40 009	
USD	13 484	Newell Brands Inc.	376 075	459 155	
USD	1 631	Penske Automotive Group Inc.	132 385	152 625	
USD	1 142	Polaris Inc.	164 500	193 884	
USD	3 064	Service Corp. International	186 231	203 542	
USD	661	Thor Industries Inc.	83 790	92 589	
USD	874	Toll Brothers Inc.	52 147	62 632	
USD	1 681	Travel + Leisure Co.	100 616	123 880	
USD	53	UniFirst Corp.	14 639	15 416	
USD	2 028	Wendy's Co. (The)	53 419	58 876	
USD	1 637	Williams-Sonoma Inc.	233 497	323 966	
USD	136	Wingstop Inc.	25 652	26 574	
USD	372	Wyndham Hotels & Resorts Inc.	27 350	33 335	
			3 304 425	3 832 678	10,70
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE					
USD	8 592	Albertsons Cos. Inc., catégorie A	189 063	209 392	
USD	284	Casey's General Stores Inc.	62 566	68 522	
USD	1 385	Energizer Holdings Inc.	80 380	73 790	
USD	7 866	Flowers Foods Inc.	228 783	235 967	
USD	1 500	Ingredion Inc.	178 367	168 276	
USD	203	J&J Snack Foods Corp.	42 622	43 888	
USD	1 225	Lamb Weston Holdings Inc.	114 281	122 483	
USD	333	Lancaster Colony Corp.	72 144	79 878	
USD	4 347	Reynolds Consumer Products Inc.	166 411	163 542	
USD	192	Sanderson Farms Inc.	39 292	44 738	
USD	2	Seaboard Corp.	10 306	9 591	
USD	718	Spectrum Brands Holdings Inc.	70 870	75 688	
USD	147	WD-40 Co.	48 450	46 702	
			1 303 535	1 342 457	3,74

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
ÉNERGIE					
USD	47 813	Antero Midstream Corp.	543 374	615 805	
USD	1 667	APA Corp.	41 956	44 696	
USD	6 550	Cabot Oil & Gas Corp.	153 850	141 764	
USD	1 554	Cimarex Energy Co.	111 200	139 563	
USD	3 281	Diamondback Energy Inc.	280 752	381 863	
USD	247	EnerSys	27 659	29 923	
USD	9 364	Marathon Oil Corp.	111 038	158 096	
USD	2 313	Targa Resources Corp.	113 435	127 447	
			1 383 264	1 639 157	4,58
SERVICES FINANCIERS					
USD	11	Affiliated Managers Group Inc.	1 593	2 103	
USD	1 158	American Financial Group Inc.	151 995	179 030	
USD	4 068	Ares Management Corp., catégorie A	260 173	320 665	
USD	3 674	Artisan Partners Asset Management Inc.	232 854	231 449	
USD	683	Assurant Inc.	113 333	132 229	
USD	795	Bank of Hawaii Corp.	80 979	82 997	
USD	2 627	Bank OZK	113 538	137 291	
USD	1 214	BOK Financial Corp.	121 456	130 322	
USD	1 246	CBOE Global Markets, Inc.	170 111	183 878	
USD	6 267	CNA Financial Corp.	335 134	353 392	
USD	2 563	CNO Financial Group Inc.	74 774	75 043	
USD	585	Cohen & Steers Inc.	56 799	59 529	
USD	1 111	Commerce Bancshares Inc.	92 003	102 684	
USD	828	Community Bank Systems Inc.	72 212	77 646	
USD	1 211	Cullen/Frost Bankers Inc.	151 037	168 129	
USD	1 902	East West Bancorp Inc.	136 392	169 025	
USD	675	Erie Indemnity Co., catégorie A	163 905	161 782	
USD	855	Evercore Inc., catégorie A	128 025	149 196	
USD	2 335	First American Financial Corp.	168 672	180 470	
USD	16	First Citizens Bancshares Inc.	11 803	16 516	
USD	1 229	First Financial Bankshares Inc.	60 871	74 848	
USD	3 438	First Hawaiian Inc.	110 644	120 778	
USD	15 103	First Horizon National Corp.	284 580	323 511	
USD	13 029	Franklin Resources Inc.	457 775	516 663	
USD	571	GATX Corp.	61 597	62 620	
USD	1 535	Glacier Bancorp Inc.	92 394	104 805	
USD	488	Globe Life Inc.	57 414	57 619	
USD	728	Hanover Insurance Group Inc.	114 434	122 405	
USD	2 832	Home Bancshares Inc.	77 052	86 640	
USD	848	Houlihan Lokey Inc.	78 242	85 976	
USD	385	Interactive Brokers Group Inc., catégorie A	27 865	31 369	
USD	3 786	Jefferies Financial Group Inc.	118 855	160 505	
USD	882	Kemper Corp.	84 030	80 797	
USD	31	Kinsale Capital Group Inc.	8 233	6 332	
USD	471	LPL Financial Holdings Inc.	59 088	78 808	
USD	3 909	MGIC Investment Corp.	64 128	65 900	
USD	147	Morningstar Inc.	34 837	46 851	
USD	18 176	New York Community Bancorp Inc.	254 883	248 291	
USD	7 946	Old Republic International Corp.	218 968	245 360	
USD	3 263	OneMain Holdings Inc.	201 360	242 325	
USD	2 150	Pacific Premier Bancorp Inc.	95 837	112 709	
USD	644	PennyMac Financial Services Inc.	51 852	49 271	
USD	13 596	People's United Financial Inc.	270 615	288 871	
USD	470	Pinnacle Financial Partners Inc.	41 266	51 439	
USD	1 481	Popular Inc.	113 778	137 780	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		SERVICES FINANCIERS (suite)			
USD	401	Primerica Inc.	69 758	76 123	
USD	1 595	Prosperity Bancshares Inc.	139 719	141 960	
USD	2 837	Radian Group Inc.	75 566	78 248	
USD	929	Reinsurance Group of America Inc.	143 198	131 281	
USD	381	RLI Corp.	46 709	49 397	
USD	1 046	SEI Investments Co.	80 604	80 352	
USD	534	Selective Insurance Group Inc.	46 724	53 717	
USD	548	Signature Bank	117 108	166 870	
USD	3 199	SLM Corp.	54 307	83 037	
USD	1 854	Sterling Bancorp	49 276	56 973	
USD	827	Stifel Financial Corp.	53 209	66 491	
USD	3 517	Synovus Financial Corp.	164 806	191 303	
USD	10 505	TFS Financial Corp.	244 971	264 347	
USD	262	Tradeweb Markets Inc., catégorie A	24 743	27 463	
USD	535	UMB Financial Corp.	51 525	61 716	
USD	7 310	Umpqua Holdings Corp.	155 753	167 184	
USD	3 549	United Bankshares Inc.	154 999	160 576	
USD	5 738	Unum Group	196 384	202 004	
USD	10 827	Valley National Bancorp	153 418	180 246	
USD	3 005	Virtu Financial Inc.	98 732	102 922	
USD	766	Voya Financial Inc.	56 955	58 396	
USD	2 034	Webster Financial Corp.	123 757	134 489	
USD	1 023	Western Alliance Bancorp	87 845	117 744	
USD	618	Wintrust Financial Corp.	52 995	57 938	
			8 120 447	9 026 626	25,20
		SOINS DE SANTÉ			
USD	474	Bruker Corp.	34 474	44 644	
USD	47	Chemed Corp.	27 517	27 645	
USD	157	CONMED Corp.	23 453	26 746	
USD	1 163	Dentsply Sirona Inc.	77 529	91 199	
USD	922	Encompass Health Corp.	82 037	89 182	
USD	159	Ensign Group Inc. (The)	16 326	17 082	
USD	428	Hill-Rom Holdings Inc.	56 170	60 265	
USD	1 783	Premier Inc., catégorie A	78 474	76 893	
			395 980	433 656	1,21
		PRODUITS INDUSTRIELS			
USD	2 600	A. O. Smith Corp.	196 544	232 246	
USD	336	AAON Inc.	26 737	26 069	
USD	116	Acuity Brands Inc.	22 380	26 894	
USD	551	AGCO Corp.	69 903	89 052	
USD	1 210	Air Lease Corp.	61 172	62 606	
USD	1 259	Allison Transmission Holdings Inc.	65 106	62 020	
USD	207	Altra Industrial Motion Corp.	15 022	16 684	
USD	680	Applied Industrial Technologies Inc.	71 226	76 757	
USD	360	Armstrong World Industries Inc.	39 632	47 865	
USD	298	Brink's Co. (The)	27 308	28 385	
USD	1 219	BWX Technologies Inc.	89 445	87 824	
USD	507	Carlisle Cos. Inc.	98 565	120 278	
USD	915	Crane Co.	95 078	104 769	
USD	171	Curtiss-Wright Corp.	24 995	25 174	
USD	2 000	Donaldson Co. Inc.	143 823	157 503	
USD	141	EMCOR Group Inc.	17 311	21 532	
USD	475	Exponent Inc.	50 488	52 528	
USD	1 972	Flowserve Corp.	96 859	98 562	
USD	427	Franklin Electric Co. Inc.	39 613	42 673	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
PRODUITS INDUSTRIELS (suite)					
USD	1 181	Hillenbrand Inc.	59 420	64 532	
USD	1 399	Hubbell Inc.	280 810	324 018	
USD	729	Huntington Ingalls Industries Inc.	183 048	190 448	
USD	763	Insperty Inc.	85 364	85 473	
USD	789	ITT Inc.	76 965	89 579	
USD	74	John Bean Technologies Corp.	11 375	13 083	
USD	1 235	Kennametal Inc.	57 156	54 990	
USD	937	Knight-Swift Transportation Holdings Inc.	50 784	52 802	
USD	244	Landstar System Inc.	42 094	47 795	
USD	447	Lennox International Inc.	162 182	194 379	
USD	1 067	Lincoln Electric Holdings Inc.	152 128	174 207	
USD	1 036	ManpowerGroup Inc.	131 998	152 707	
USD	462	MSA Safety Inc.	81 003	94 827	
USD	1 129	MSC Industrial Direct Co. Inc., catégorie A	119 298	125 578	
USD	738	Oshkosh Corp.	91 452	114 024	
USD	996	Owens Corning	97 742	120 871	
USD	409	Quanta Services Inc.	34 630	45 919	
USD	292	Regal-Beloit Corp.	38 528	48 326	
USD	1 069	Rexnord Corp.	57 339	66 310	
USD	1 705	Robert Half International Inc.	152 967	188 040	
USD	2 014	Ryder System Inc.	172 136	185 569	
USD	475	Simpson Manufacturing Co. Inc.	58 099	65 028	
USD	1 044	Snap-On Inc.	243 574	289 150	
USD	334	Tetra Tech Inc.	42 386	50 528	
USD	1 229	Timken Co. (The)	104 114	122 776	
USD	1 231	Toro Co. (The)	141 856	167 671	
USD	235	Valmont Industries Inc.	58 415	68 763	
USD	123	Vertiv Holdings Co.	3 471	4 162	
USD	1 142	Watsco Inc.	339 382	405 774	
USD	229	Watts Water Technologies Inc., catégorie A	36 870	41 419	
USD	657	Werner Enterprises Inc.	34 726	36 258	
USD	121	Woodward Governor Co.	14 911	18 431	
			4 467 430	5 082 858	14,19
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION					
USD	389	Alliance Data Systems Corp.	52 101	50 241	
USD	1 869	Amkor Technology Inc.	44 302	54 839	
USD	1 840	Avnet Inc.	87 015	91 417	
USD	298	Brooks Automation Inc.	25 350	35 196	
USD	1 017	CDK Global Inc.	66 768	62 643	
USD	651	Dolby Laboratories Inc., catégorie A	69 579	79 318	
USD	858	Jabil Inc.	47 156	61 815	
USD	8 421	Juniper Networks Inc.	276 707	285 498	
USD	1 397	KBR Inc.	57 287	66 065	
USD	133	Littelfuse Inc.	35 841	42 006	
USD	666	Maximus Inc.	65 394	72 626	
USD	318	MKS Instruments Inc.	56 490	70 147	
USD	2 403	National Instruments Corp.	129 227	125 942	
USD	10 861	NortonLifeLock Inc.	322 623	366 471	
USD	55	Pegasystems Inc.	7 114	9 490	
USD	388	Power Integration Inc.	38 625	39 468	
USD	609	Science Applications International Corp.	67 921	66 229	
USD	550	TTEC Holdings Inc.	60 830	70 285	
USD	86	Universal Display Corp.	21 384	23 702	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION (suite)					
USD	11 728	Western Union Co. (The)	330 867	333 939	
USD	6 053	Xerox Holdings Corp.	182 894	176 251	
			2 045 475	2 183 588	6,10
MATÉRIAUX					
USD	358	Advanced Drainage Systems Inc.	42 290	51 731	
USD	756	AptarGroup Inc.	121 590	131 987	
USD	620	Ashland Global Holdings Inc.	63 059	67 248	
USD	1 416	Avient Corp.	77 492	86 289	
USD	160	Balchem Corp.	23 734	26 034	
USD	4 576	CF Industries Holdings Inc.	243 601	291 846	
USD	4 448	Chemours Co. (The)	168 193	191 878	
USD	256	CMC Materials Inc.	43 839	47 835	
USD	3 235	Element Solutions Inc.	81 752	93 756	
USD	3 487	Graphic Packaging Holding Co.	71 437	78 410	
USD	3 946	Huntsman Corp.	122 995	129 722	
USD	1 727	Louisiana Pacific Corp.	90 311	129 068	
USD	2 420	Mosaic Co. (The)	74 070	95 725	
USD	215	NewMarket Corp.	101 225	85 812	
USD	3 781	Olin Corp.	163 526	216 817	
USD	79	Quaker Chemical Corp.	24 136	23 228	
USD	1 394	Reliance Steel & Aluminum Co.	217 325	260 756	
USD	509	Royal Gold Inc.	70 015	71 992	
USD	784	Scotts Miracle-Gro Co. (The), catégorie A	150 821	186 517	
USD	2 348	Sealed Air Corp.	146 033	172 452	
USD	970	Sensient Technologies Corp.	96 439	104 081	
USD	1 564	Silgan Holdings Inc.	74 096	80 457	
USD	2 962	Sonoco Products Co.	228 028	245 636	
USD	3 858	Steel Dynamics Inc.	215 923	285 030	
USD	605	UFP Industries Inc.	48 504	55 752	
USD	351	United States Steel Corp.	8 682	10 442	
USD	2 829	Valvoline Inc.	93 603	113 832	
USD	1 170	Westlake Chemical Corp.	118 296	130 660	
USD	3 427	WestRock Co.	186 841	226 084	
USD	1 145	Worthington Industries Inc.	77 708	86 835	
			3 245 564	3 777 912	10,54
IMMOBILIER					
USD	442	Agree Realty Corp.	37 178	38 622	
USD	1 330	American Campus Communities Inc.	72 537	77 026	
USD	705	American Homes 4 Rent, catégorie A	27 540	33 952	
USD	1 190	Americold Realty Trust	53 692	55 833	
USD	3 500	Brixmor Property Group Inc.	82 941	99 311	
USD	749	Camden Property Trust	105 061	123 179	
USD	574	Coresite Realty Corp.	91 020	95 772	
USD	1 097	Corporate Office Properties Trust	39 440	38 062	
USD	1 155	Cousins Properties Inc.	52 379	52 659	
USD	2 573	CubeSmart	120 829	147 737	
USD	809	CyrusOne Inc.	72 030	71 723	
USD	1 390	Douglas Emmett Inc.	61 416	57 929	
USD	314	EastGroup Properties Inc.	54 122	64 010	
USD	915	Equity Lifestyle Properties Inc.	74 570	84 285	
USD	6 589	Fidelity National Financial Inc.	337 171	354 969	
USD	1 039	First Industrial Realty Trust Inc.	57 563	67 269	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		IMMOBILIER (suite)			
USD	4 283	Gaming and Leisure Properties Inc.	220 176	245 976	
USD	1 846	Healthcare Realty Trust Inc.	72 083	69 107	
USD	2 377	Healthcare Trust of America Inc., catégorie A	84 952	78 672	
USD	1 115	Highwoods Properties Inc.	63 066	62 432	
USD	1 304	Hudson Pacific Properties Inc.	48 095	44 969	
USD	142	Innovative Industrial Properties Inc.	34 176	33 624	
USD	5 250	Iron Mountain Inc.	245 534	275 414	
USD	840	JBG SMITH Properties	35 627	32 810	
USD	837	Kilroy Realty Corp.	72 167	72 255	
USD	4 096	Kimco Realty Corp.	92 615	105 864	
USD	478	Lamar Advertising Co., catégorie A	51 062	61 872	
USD	3 739	Lexington Corporate Properties Trust	53 519	55 387	
USD	603	Life Storage Inc.	62 894	80 242	
USD	6 234	Medical Properties Trust Inc.	148 691	155 326	
USD	652	National Health Investors Inc.	57 965	54 191	
USD	2 000	National Retail Properties Inc.	111 773	116 225	
USD	2 364	Physicians Realty Trust	54 328	54 125	
USD	742	PotlatchDeltic Corp.	47 611	48 886	
USD	194	PS Business Parks Inc.	34 871	35 611	
USD	463	QTS Realty Trust Inc., catégorie A	39 136	44 365	
USD	1 055	Rayonier Inc.	42 861	46 988	
USD	753	Rexford Industrial Realty Inc.	46 332	53 158	
USD	3 109	Sabra Health Care REIT Inc.	71 488	70 141	
USD	168	Safehold Inc.	15 571	16 348	
USD	896	SL Green Realty Corp.	90 179	88 855	
USD	1 486	Spirit Realty Capital Inc.	81 016	88 123	
USD	1 642	STAG Industrial Inc.	70 826	76 186	
USD	2 528	STORE Capital Corp.	97 061	108 144	
USD	472	Terreno Realty Corp. REIT	35 797	37 750	
USD	2 464	UDR Inc.	130 756	149 603	
			3 651 717	3 924 987	10,96
		SERVICES PUBLICS			
USD	1 507	Allete Inc.	129 263	130 728	
USD	672	American States Water Co.	67 108	66 274	
USD	1 691	Black Hills Corp.	139 421	137 571	
USD	5 127	Clearway Energy Inc.	194 576	168 292	
USD	3 612	Essential Utilities Inc.	202 020	204 619	
USD	2 685	Hawaiian Electric Industries Inc.	133 089	140 722	
USD	1 588	IDACORP Inc.	194 476	191 927	
USD	7 219	MDU Resources Group Inc.	256 794	280 451	
USD	2 604	National Fuel Gas Co.	164 906	168 659	
USD	2 786	New Jersey Resources Corp.	136 038	136 656	
USD	9 867	NiSource Inc.	309 766	299 663	
USD	1 533	NorthWestern Corp.	117 212	114 436	
USD	6 106	NRG Energy Inc.	279 653	305 031	
USD	6 973	OGE Energy Corp.	296 993	290 862	
USD	994	ONE Gas Inc.	98 109	91 328	
USD	226	Ormat Technologies Inc.	21 385	19 479	
USD	3 279	Pinnacle West Capital Corp.	345 375	333 179	
USD	2 430	Portland General Electric Co.	140 799	138 803	
USD	1 393	Southwest Gas Corp.	122 039	114 294	
USD	1 415	Spire Inc.	128 098	126 764	

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

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

Inventaire du portefeuille au 30 juin 2021 (non audité) (suite)

	Nombre de parts/d'actions ou valeur nominale	Description	Coût moyen (\$)	Juste valeur (\$)	% de l'actif net
ACTIONS (suite)					
		SERVICES PUBLICS (suite)			
USD	5 461	UGI Corp.	294 348	313 493	
USD	10 166	Vistra Corp.	253 356	233 763	
			4 024 824	4 006 994	11,19
Total des actions			32 769 950	36 259 550	101,23
Ajustement au titre des coûts de transaction			(2 210)		
Total des placements			32 767 740	36 259 550	101,23
Gains (pertes) latent(e)s sur le(s) contrat(s) de change à terme				(480 350)	(1,34)
Autres actifs (passifs) nets				40 808	0,11
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables				35 820 008	100,00

Contrat(s) de change à terme

Contrepartie	Note de crédit de la contrepartie*	Date de règlement	Devise achetée	Position	Devise vendue	Position	Taux contractuel	Profit (perte) latent(e) (\$)
Banque HSBC, Toronto	A-1	07 juillet 2021	USD	270 000	CAD	335 840	0,80	(1 148)
JPMorgan Chase Bank, New York	A-1	07 juillet 2021	CAD	15 982 310	USD	13 280 000	1,20	(479 596)
Banque Royale du Canada	A-1+	07 juillet 2021	CAD	376 982	USD	305 000	1,24	(1 096)
Banque Royale du Canada	A-1+	07 juillet 2021	USD	410 000	CAD	506 747	0,81	1 490
Valeur totale du (des) contrat(s) de change à terme								(480 350)

*Note de crédit selon S&P Global Ratings.

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Compensation des instruments financiers (note 2)

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

au 30 juin 2021

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	1	(1)	-	-
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	1	(1)	-	-
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	(481)	1	-	(480)
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	(481)	1	-	(480)

au 31 décembre 2020

	Montants admissibles à la compensation			Exposition nette (en milliers de dollars)
	Actif (passif) brut (en milliers de dollars)	Instruments financiers (en milliers de dollars)	Garantie reçue (payée) (en milliers de dollars)	
Actifs dérivés - Contrats de change à terme	240	-	-	240
Actifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	240	-	-	240
Passifs dérivés - Contrats de change à terme	-	-	-	-
Passifs dérivés - Swaps et options sur swaps	-	-	-	-
Total	-	-	-	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Commissions (note 2)

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Commissions de courtage	1	s.o.
Paiements indirects [†]	-	s.o.

Transactions sur parts rachetables (note 4)

pour les périodes closes les 30 juin

	Parts couvertes		Parts non couvertes	
	2021	2020	2021	2020
Nombre de parts rachetables à l'ouverture de la période	591 082	591 082	200 000	50 000
Parts rachetables émises contre trésorerie	-	-	450 000	-
Parts rachetables émises aux fins du réinvestissement des distributions	-	-	-	-
Parts rachetables rachetées	(50 000)	(50 000)	-	-
Nombre de parts rachetables à la clôture de la période	541 082	541 082	650 000	50 000

s.o. – données historiques non disponibles.

[†]Une partie des commissions de courtage payées a été utilisée pour payer les services de recherche et de données du marché; ce sont les accords de paiement indirect. Ce montant a été estimé par le gestionnaire du Fonds.
Les notes ci-jointes font partie intégrante de ces états financiers.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Taux des frais de gestion (note 5)

au 30 juin 2021 (en %)

	Taux des frais de gestion annuels :
Parts couvertes	0,350*
Parts non couvertes	0,350

*Le 23 juin 2021, le taux des frais de gestion annuels des parts couvertes est passé de 0,38 % à 0,35 %.

Prêts de titres (note 6)

aux 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Titres prêtés	627	-
Garanties (hors trésorerie)	659	-

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

pour les périodes closes les 30 juin (en milliers de dollars)

	2021	2020
Revenu brut tiré des prêts de titres	4	-
Charges	(2)	-
Revenu tiré des prêts de titres	2	-
Charges en % du revenu brut tiré des prêts de titres	57,2	-

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

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Risques liés aux instruments financiers (note 10)

Risque de concentration

Pour des informations sur le risque de concentration au 30 juin 2021, consultez l'inventaire du portefeuille.

Le tableau ci-dessous résume l'exposition du Fonds au risque de concentration.

au 31 décembre 2020

Catégories	Actif net (%)
Services financiers	24,0
Produits industriels	14,1
Services publics	12,1
Immobilier	10,9
Matériaux	9,9
Biens de consommation discrétionnaire	9,6
Technologies de l'information	6,3
Biens de consommation de base	4,0
Énergie	3,7
Services de communication	2,5
Soins de santé	1,3
Total du profit latent sur le(s) contrat(s) de change à terme	1,2
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Total	100,0

Risque de crédit

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

au 30 juin 2021

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	(1,3)
Total	(1,3)

au 31 décembre 2020

Note de crédit ^{A*}	Actif net (%)
AA/Aa/A+	1,2
Total	1,2

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

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

Autre risque de prix

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds investissait principalement dans des actions américaines et était donc sensible à l'évolution de la conjoncture économique générale aux États-Unis.

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

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

États financiers semestriels - 30 juin 2021

Autre risque de prix (suite)

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

au 30 juin 2021

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree	3 573 856

au 31 décembre 2020

Indice de référence	(\$)
Indice de rendement total de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree	1 929 842

Risque de change

Les tableaux ci-dessous résument l'exposition du Fonds au risque de change.

au 30 juin 2021[~]

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	36 310	(15 997)	20 313	56,7	
Total	36 310	(15 997)	20 313	56,7	

Parts couvertes

au 31 décembre 2020[~]

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	14 270	(14 129)	141	1,0	
Total	14 270	(14 129)	141	1,0	

Parts non couvertes

au 31 décembre 2020[~]

Devises	Exposition aux instruments financiers		Exposition nette		Actif net (%)
	(en milliers de dollars)	Dérivés (en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	(en milliers de dollars)	
Dollar américain	5 220	-	5 220	98,5	
Total	5 220	-	5 220	98,5	

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

Au 30 juin 2021, si le dollar canadien avait augmenté ou diminué de 10 % (10 % au 31 décembre 2020) par rapport à toutes les autres devises détenues dans le Fonds, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 031 000 \$ (536 000 \$ au 31 décembre 2020). En pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse et la différence peut être importante.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Fonds était peu exposé au risque de taux d'intérêt puisque la presque totalité de ses actifs était investie dans des actions et des dérivés.

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

Notes annexes propres au Fonds (non audité)

Hiérarchie des justes valeurs

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

Positions acheteur à la juste valeur au 30 juin 2021

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	36 260	-	-	36 260
Dérivés, nets	-	(480)	-	(480)
Total	36 260	(480)	-	35 780

Positions acheteur à la juste valeur au 31 décembre 2020

	Niveau 1 (en milliers de dollars)	Niveau 2 (en milliers de dollars)	Niveau 3 (en milliers de dollars)	Total (en milliers de dollars)
Actions	19 455	-	-	19 455
Dérivés, nets	-	240	-	240
Total	19 455	240	-	19 695

Il n'y a eu aucun transfert entre les niveaux 1, 2 et 3 au cours de la période close le 30 juin 2021 et de l'exercice clos le 31 décembre 2020.

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

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité)

1. LES FONDS

Les Fonds suivants sont des fonds négociés en bourse, et chacun est une fiducie établie en vertu des lois de la province de l'Ontario et régie par une déclaration de fiducie.

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

Le 19 février 2020, le nom du fiduciaire, du gestionnaire, et du promoteur, WisdomTree Asset Management Canada, Inc., a été remplacé par 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 devenue le fiduciaire (le « fiduciaire ») et le gestionnaire (le « gestionnaire ») des Fonds. Le 28 août 2020, la Compagnie Trust CIBC Mellon a remplacé State Street Bank en tant que dépositaire (le « dépositaire ») des Fonds.

L'adresse du siège social des Fonds est le 15, rue York, deuxième étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3. Le 1^{er} août 2021 ou vers cette date, l'adresse du siège social des Fonds est passée de 2, rue Queen Est, vingtième étage, Toronto (Ontario) M5C 3G7 au 15, rue York, deuxième étage, Toronto (Ontario) M5J 0A3.

La publication des présents états financiers a été autorisée par le gestionnaire le 16 août 2021. Le gestionnaire est une filiale de CI Financial Corp.

Le tableau qui suit indique la date à laquelle chaque catégorie de titres de chaque Fonds a commencé à être négociée à 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 ^{er} août 2018	-	-
FNB d'actions mondiales ONE CI	ONEQ	21 sept. 2015	-	-	-	-
FNB d'obligations essentielles nord-américaines améliorées ONE CI	ONEB	9 oct. 2018	-	-	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	-	-	DGRC	19 sept. 2017	-	-
FNB Indice de dividendes de marchés émergents WisdomTree CI	-	-	EMV.B	19 sept. 2017	-	-
FNB Indice d'actions européennes couvert WisdomTree CI	EHE	12 juill. 2016	EHE.B	8 août 2017	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité WisdomTree CI	IQD	12 juill. 2016	IQD.B	12 juill. 2016	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres internationaux de qualité à couverture variable WisdomTree CI	-	-	-	-	DQI	12 juill. 2016
FNB Indice d'actions japonaises WisdomTree CI	JAPN	1 ^{er} août 2018	JAPN.B	1 ^{er} août 2018	-	-
FNB Indice de dividendes de sociétés américaines à moyenne capitalisation WisdomTree CI	UMI	19 sept. 2017	UMI.B	19 sept. 2017	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	DGR	12 juill. 2016	DGR.B	12 juill. 2016	-	-
FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité à couverture variable WisdomTree CI	-	-	-	-	DQD	12 juill. 2016
FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI	-	-	CAGG	22 juin 2017	-	-
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	-	-	CAGS	22 juin 2017	-	-

Les Fonds offrent de façon continue des parts non couvertes, des parts couvertes ou des parts à couverture variable.

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

Fonds	Objectifs de placement
FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI	Le Fonds cherche à reproduire, autant qu'il 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.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Fonds	Objectifs de placement
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, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il 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 sur titres internationaux de qualité WisdomTree CI	Le Fonds cherche à reproduire, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il 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, autant qu'il est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Barclays Canadian Aggregate Enhanced Yield Index, compte non tenu des frais.
FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI	Le Fonds cherche à reproduire, autant qu'il est raisonnablement possible, le cours et le rendement de l'indice Bloomberg Barclays Canadian Short Aggregate Enhanced Yield Index, compte non tenu des frais.

Le 16 avril 2021, à la fermeture des bureaux, les Fonds suivants ont été fusionnés :

Fonds clôturé

FNB Indice Morningstar Canada
Dividende cible 30 CI First Asset
FNB Indice de rachat d'actions
canadiennes CI First Asset
FNB Indice de rachat d'actions
américaines CI First Asset
FNB Indice Morningstar États-Unis
Dividende cible 50 CI First Asset

Fonds prorogé

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

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

En dates du 16 avril 2021, à la clôture des bureaux, les Fonds prorogés ont acquis la totalité de l'actif net des Fonds clôturés en échange de titres des Fonds prorogés. La valeur des titres des Fonds prorogés émis dans le contexte de ces fusions correspond à l'actif net transféré des Fonds clôturés. Le coût associé à ces fusions a été pris en charge par le gestionnaire.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les fusions suivantes ont été effectuées avec report d'impôt.

Fonds clôturé	Fonds prorogé	Actif net acquis (\$)	Parts émises
FNB Indice Morningstar Canada Dividende cible 30 CI First Asset	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	11 879 699	361 184
FNB Indice de rachat d'actions canadiennes CI First Asset	FNB Indice de croissance de dividendes de titres canadiens de qualité WisdomTree CI	7 178 651	218 256
FNB Indice de rachat d'actions américaines CI First Asset	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	15 911 373	453 912
FNB Indice Morningstar États-Unis Dividende cible 50 CI First Asset	FNB Indice de croissance de dividendes de titres américains de qualité WisdomTree CI	3 412 914	973 786

Les états de la situation financière sont au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le cas échéant. Les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables ainsi que les tableaux des flux de trésorerie sont pour les périodes closes les 30 juin 2021 et 2020, sauf dans le cas des fonds lancés au cours de l'une ou l'autre de ces périodes; pour ceux-ci, les données fournies couvrent les périodes allant de la date de création aux 30 juin 2021 ou 2020, le cas échéant.

2. RÉSUMÉ DES PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

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

Les principales méthodes comptables des Fonds sont résumées ci-après :

a. Classement et comptabilisation des instruments financiers

Les Fonds classent et évaluent leurs placements, entre autres dans des titres à revenu fixe, des titres de capitaux propres, des fonds de placement, des fonds négociés en Bourse et des dérivés, selon le modèle économique des Fonds pour la gestion de ces actifs financiers et les caractéristiques de flux de trésorerie contractuels des actifs financiers. Les portefeuilles d'actifs financiers des Fonds sont gérés et leur rendement est évalué selon la juste valeur. Les Fonds mettent surtout l'accent sur les informations sur la juste valeur et utilisent celles-ci pour évaluer le rendement des actifs et pour prendre des décisions. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance des Fonds correspondent uniquement à du capital et à des intérêts. Ces titres ne sont pas détenus aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels ni aux fins de la perception des flux de trésorerie contractuels et de la vente de ces titres. La perception de flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à la réalisation de l'objectif du modèle économique des Fonds. Par conséquent, tous les placements et les dérivés sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net (« JVRN »). Les ventes à découvert sont comptabilisées en tant que passifs financiers à la JVRN. Les contrats de dérivés dont la juste valeur est négative sont présentés en tant que passifs à la JVRN.

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

Les actifs financiers et passifs financiers sont compensés et le solde net est présenté dans les états de la situation financière si, et seulement si, les Fonds ont un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants comptabilisés et s'ils ont l'intention soit de régler les montants nets, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les Fonds concluent, dans le cadre normal de leurs activités, diverses conventions-cadres de compensation ou autres accords similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans les états de la situation financière, mais qui permettent néanmoins d'opérer compensation des montants dans certaines circonstances, comme la faillite ou la résiliation des contrats.

b. Juste valeur des instruments financiers

À la clôture, les titres cotés sont évalués au dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des conditions actuelles du marché. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. Les bons de souscription non cotés, le cas échéant, sont évalués en fonction d'un modèle d'établissement des cours prenant en compte des facteurs comme la valeur de marché du titre sous-jacent, le prix d'exercice et les modalités du bon de souscription. Les titres à revenu fixe, les débentures et les autres instruments de créance, y compris les placements à court terme, sont évalués au cours fourni par des courtiers en valeurs mobilières reconnus. Le ou les fonds sous-jacents sont évalués chaque jour ouvrable selon la valeur liquidative présentée par les gestionnaires des fonds sous-jacents.

La juste valeur des placements privés et des autres titres pour lesquels il existe des données non observables importantes est établie à l'aide de modèles d'évaluation pouvant être fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire afin de garantir qu'elles sont raisonnables. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des placements privés.

c. Trésorerie

La trésorerie est constituée de fonds déposés et de découvert bancaire.

d. Coût des placements

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

e. Opérations de placement et comptabilisation du revenu

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de l'opération, c'est-à-dire à la date où un Fonds s'engage à acheter ou à vendre le placement. Les « intérêts à distribuer » présentés dans les états du résultat global correspondent à l'intérêt nominal reçu par les Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Les dividendes et les distributions tirés des placements sont comptabilisés à la date ex-dividende/ex-distribution.

Les distributions des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents sont traitées à titre de revenu, gains en capital ou remboursement de capital, selon les meilleurs renseignements dont dispose le gestionnaire. En raison de la nature de ces placements, la répartition effectuée au cours de l'exercice considéré pourrait être différente de cette information. Les distributions de fiducies de revenu et de fonds sous-jacents qui sont traitées comme un remboursement de capital aux fins de l'impôt sur le revenu réduisent le coût moyen des fiducies de revenu et des fonds sous-jacents.

f. Conversion de devises

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

g. Évaluation des parts

La valeur liquidative par part de chaque catégorie est calculée à la fin de chaque jour d'évaluation, c'est-à-dire un jour ouvrable de la Bourse de Toronto, en divisant la valeur liquidative totale de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre de parts de cette catégorie en circulation.

La valeur liquidative de chaque catégorie est basée sur le calcul de la quote-part des actifs du Fonds revenant à cette catégorie, moins la quote-part du passif collectif du Fonds revenant à cette catégorie et le passif attribuable à cette catégorie. Les charges directement attribuables à une catégorie sont imputées à cette catégorie. Les autres revenus et charges ainsi que les profits et les pertes sont imputés proportionnellement à chaque catégorie en fonction de la valeur liquidative relative de chaque catégorie.

Au 30 juin 2021, au 31 décembre 2020 et au 30 juin 2020, il n'y avait pas de différence entre la valeur liquidative utilisée aux fins des transactions avec les porteurs de parts et l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables utilisés aux fins de présentation de l'information financière selon les IFRS.

h. Classement des parts

Les parts du Fonds sont classées comme passifs financiers, conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : présentation* (IAS 32), car elles ne répondent pas à la définition d'instruments remboursables au gré du porteur permettant de les classer en tant qu'actions conformément à l'IAS 32 à des fins de présentation de l'information financière.

i. Commissions et autres coûts de transaction du portefeuille

Les coûts de transaction, notamment les commissions de courtage, engagés lors de l'achat et de la vente de titres, sont comptabilisés dans les états du résultat global sous « Commissions et autres coûts de transaction ».

Les Fonds qui investissent uniquement dans les parts/les actions de fonds sous-jacents ne sont pas assujettis aux coûts de transaction.

j. Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part :

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, dans les états du résultat global est déterminée en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables de chaque catégorie d'un Fonds par le nombre moyen pondéré de parts de cette catégorie en circulation au cours de la période.

k. Contrats de change à terme

Les Fonds sont autorisés à conclure des contrats de change à terme de temps à autre. Les contrats de change à terme sont évalués chaque jour d'évaluation selon la différence entre le taux prévu aux termes du contrat et le taux à terme en vigueur à la date d'évaluation, appliquée au montant notionnel du contrat et ajustée en fonction du risque de contrepartie. Tout profit (perte) latent découlant des contrats de change à terme est inscrit dans les états du résultat global sous « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » et dans les états de la situation financière sous « Profit (perte) latent(e) sur les contrats à terme standardisés et les contrats de change à terme », jusqu'au moment où les contrats sont liquidés ou échus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ».

l. Compensation des instruments financiers

Les informations présentées dans les tableaux « Compensation des instruments financiers » dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds comprennent les actifs et passifs des contrats de change à terme qui sont assujettis à un accord de compensation exécutoire. Les transactions avec des contreparties individuelles sont régies par des accords de compensation distincts. Chaque accord prévoit un règlement net de certains contrats ouverts pour lesquels les Fonds et la contrepartie concernée choisissent de régler leurs contrats sur une base nette. En l'absence d'un tel choix, les contrats seront réglés sur une base brute. Cependant, chaque partie à l'accord de compensation aura la possibilité de régler tous les contrats ouverts sur une base nette en cas de défaillance de l'autre partie.

Les accords de compensation de l'International Swaps and Derivatives Association Inc. (« accord de compensation ISDA ») régissent les opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré conclus par les Fonds et des contreparties choisies. Les accords de compensation ISDA prévoient des dispositions pour les obligations générales, les représentations, les accords, les garanties et les cas de défaillance ou de résiliation. Les clauses de résiliation comprennent des dispositions qui peuvent permettre aux contreparties de choisir une résiliation anticipée et de provoquer un règlement de toutes les opérations en cours en vertu de l'accord de compensation ISDA applicable. Tout choix de résiliation anticipée pourrait avoir une incidence importante sur les états financiers. La juste valeur des opérations sur instruments financiers dérivés de gré à gré, nette de la garantie reçue ou des biens donnés en garantie par la contrepartie à la fin de la période est décrite dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

Les Fonds peuvent être assujettis à plusieurs accords-cadres ou accords de compensation, avec certaines contreparties. Ces accords-cadres réduisent le risque de contrepartie lié aux opérations pertinentes en spécifiant les mécanismes de protection de crédit et en fournissant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Puisque les opérations ont des mécanismes différents et sont parfois négociées par différentes entités juridiques d'une contrepartie, chaque type d'opération peut être couvert par un accord-cadre différent, d'où la nécessité d'avoir plusieurs accords avec une seule contrepartie. Comme les accords-cadres sont propres aux opérations uniques visant différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de dénouer et de régler leur exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance à l'égard des opérations régies par un accord unique avec une contrepartie.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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

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

Le gestionnaire a déterminé que le ou les fonds sous-jacents ou le ou les fonds négociés en bourse (« FNB ») détenus par les Fonds répondent généralement à la définition d'une entité structurée non consolidée. Les titres adossés à des créances hypothécaires et les titres adossés à des actifs sont également considérés comme des entités structurées non consolidées. Les Fonds comptabilisent leurs placements dans des entités structurées non consolidées à la JVRN.

Les Fonds qui investissent dans un ou des fonds sous-jacents sont assujettis aux modalités des documents de placement du fonds sous-jacent concerné et sont sensibles au risque de prix du marché découlant des incertitudes entourant les valeurs futures du fonds sous-jacent en question. Le ou les fonds sous-jacents du portefeuille de placements sont gérés par des gestionnaires de portefeuille qui sont rémunérés pour leurs services par le fonds sous-jacent concerné. Cette rémunération est généralement constituée de frais calculés en fonction de l'actif et est reflétée dans l'évaluation de chacun des fonds sous-jacents, sauf lorsque les Fonds investissent dans certaines catégories de fonds sous-jacents pour lesquelles la rémunération des gestionnaires de portefeuille est négociée et payée à l'extérieur de chacun des fonds sous-jacents. Les fonds sous-jacents financent leurs activités en émettant des parts ou des actions rachetables qui donnent droit aux porteurs à une participation égale des fonds sous-jacents. Les Fonds peuvent demander le rachat de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents sur une base quotidienne. Ces placements sont inclus au poste « Placements » à la JVRN dans les états de la situation financière. Tout profit (perte) latent découlant de ces placements est inscrit à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente des placements et des dérivés » dans les états du résultat global, jusqu'au moment où ces placements sont vendus. À ce moment, les profits (pertes) sont réalisés et présentés dans les états du résultat global sous « Profit (perte) net(te) réalisé(e) sur la vente de placements et de dérivés ». L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les fonds sous-jacents est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les fonds sous-jacents.

Certains Fonds effectuent des placements dans un ou des FNB, qui sont présentés dans l'inventaire du portefeuille. Ces Fonds ont déterminé que ces FNB satisfont aux critères de définition des entités structurées non consolidées. Ce ou ces FNB financent leurs activités en émettant des parts rachetables au gré du porteur qui garantissent à ce dernier une quote-part de la valeur liquidative du FNB en question. Le ou les FNB sont domiciliés au Canada ou aux États-Unis et sont cotés en bourse. L'exposition maximale des Fonds au risque de perte découlant de leur participation dans le ou les FNB est égale à la juste valeur totale de leurs placements dans le ou les FNB.

L'information se rapportant à la participation dans des entités structurées non consolidées figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

n. Retenues d'impôts

Un Fonds peut, de temps à autre, être assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés au

montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées séparément dans les états du résultat global.

o. Taxe de vente harmonisée

Certaines provinces, y compris l'Ontario, l'Île-du-Prince-Édouard, la Nouvelle-Écosse, le Nouveau-Brunswick et Terre-Neuve-et-Labrador (chacune, une juridiction fiscale participante), ont harmonisé leur taxe de vente provinciale (« TVP ») avec la taxe fédérale sur les produits et services (« TPS »). La taxe de vente harmonisée (« TVH ») correspond au taux de 5 % de la TPS fédérale combiné à celui de la TVP des provinces concernées. La province de Québec perçoit également la taxe de vente du Québec (« TVQ ») de 9,975 %. La TVH à verser ou à recevoir est calculée selon le lieu de résidence des porteurs de parts et la valeur de leur participation dans le Fonds à une date donnée, et non en fonction du territoire dont relève le Fonds. Le taux effectif des taxes de vente applicable à chaque catégorie du Fonds est fonction de la répartition des placements des porteurs de parts entre les provinces. Il est calculé selon le taux de TVH ou, si la province concernée n'applique pas la TVH, selon le taux de TPS ou de la TVQ. Tous les montants à ce titre sont inscrits au poste « Taxe de vente harmonisée » des états du résultat global.

p. Soldes comparatifs

Les états financiers comparatifs ont été reclassés par rapport aux états présentés antérieurement dans le but de rendre leur présentation conforme à celle des états financiers de la période considérée. Certains soldes ont été combinés ou ventilés dans le but de rendre leur classement conforme à celui des postes des états financiers de la période considérée.

3. ESTIMATIONS COMPTABLES ET JUGEMENTS CRITIQUES

La préparation des états financiers conformément aux IFRS exige que la direction émette des jugements, fasse des estimations et pose des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des méthodes comptables ainsi que sur les montants présentés au titre de l'actif et du passif à la date de clôture et sur les montants présentés des revenus et des charges pour la période de présentation de l'information financière. Le paragraphe suivant présente une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation de leurs états financiers :

Évaluation de la juste valeur des placements et des dérivés non cotés sur un marché actif

De temps à autre, les Fonds peuvent détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, notamment des titres non cotés, des titres privés ou des dérivés. Les titres non cotés sont évalués selon les prix fournis par des courtiers en valeurs mobilières reconnus ou, à défaut, leur juste valeur est déterminée par le gestionnaire selon les données les plus récentes. La juste valeur des titres privés est établie à l'aide de modèles d'évaluation fondés, en partie, sur des hypothèses qui ne sont pas étayées par des données observables du marché. Ces méthodes et procédures peuvent comprendre des comparaisons effectuées avec des cours de titres comparables ou semblables, l'obtention de renseignements liés à l'évaluation de la part d'émetteurs ou d'autres données analytiques relatives au placement et l'utilisation d'autres indicateurs de valeur disponibles. Ces valeurs sont examinées de façon indépendante par le gestionnaire selon les hypothèses et les estimations sur des paramètres disponibles au moment de la préparation des états financiers. Toutefois, en raison de l'incertitude inhérente à l'évaluation, les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être très différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé. Les risques perçus liés à la solvabilité des émetteurs, à la prévisibilité des flux de trésorerie et à la durée jusqu'à l'échéance ont tous un effet sur la juste valeur des titres privés.

Dans la mesure du possible, les modèles d'évaluation font appel à des données observables. La volatilité a nettement augmenté sur le marché depuis le début de l'épidémie de coronavirus 2019 (COVID-19), ce qui a causé des fluctuations des cours du marché, un élargissement de l'écart

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

acheteur-vendeur et une diminution des liquidités sur le marché. Ces changements pourraient avoir une incidence sur le caractère observable des données du modèle de valorisation, ce qui pourrait influencer sur le classement de certains instruments financiers dans la hiérarchie des justes valeurs. Le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (aussi bien le risque de crédit propre à l'entité que le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités, les corrélations et les hypothèses clés au sujet d'événements futurs. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers.

Les Fonds considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question.

La juste valeur des placements dans des fonds sous-jacents qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs est évaluée principalement selon la dernière valeur liquidative de ces parts ou actions disponible pour chaque fonds sous-jacent, telle qu'elle est déterminée par les gestionnaires des fonds sous-jacents.

IFRS 10 – États financiers consolidés (IFRS 10)

Conformément à l'IFRS 10, le gestionnaire a déterminé que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement, à savoir une entité qui obtient des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion de placements, qui déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital ou de revenus de placement ou les deux, et qui évalue et mesure la performance de ses placements sur la base de la juste valeur. Par conséquent, les Fonds ne consolident pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent plutôt à la JVRN, comme l'exige la norme comptable.

4. PARTS RACHETABLES

Chaque Fonds est autorisée à émettre un nombre illimité de parts rachetables et cessibles d'un nombre illimité de catégories de parts, dont chacune représente une participation égale et indivise dans l'actif net de ce Fonds.

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'appels subséquents seront 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 FNB 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.

Chaque Fonds gère son capital selon ses objectifs et stratégies de placement décrits à la note 1 et les pratiques de gestion des risques décrites à la note 10, et s'efforce d'investir les souscriptions reçues dans des placements appropriés, tout en maintenant des liquidités suffisantes pour effectuer

des distributions et des rachats. Afin de gérer leur structure du capital, les Fonds peuvent rajuster le montant des distributions versées aux porteurs de parts.

L'information se rapportant aux transactions sur parts rachetables figure dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

5. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

Frais de gestion

Le gestionnaire de chaque Fonds, en contrepartie des frais de gestion qu'il reçoit, fournit les services de gestion requis pour les activités quotidiennes des Fonds, y compris la gestion des portefeuilles de placements des Fonds et le détachement de personnel de direction clé.

À titre de rémunération pour les services rendus aux Fonds, les Fonds versent au gestionnaire des frais de gestion annuels calculés quotidiennement en pourcentage de la valeur liquidative et payés mensuellement à terme échu.

Charges d'exploitation

Outre les frais de gestion, chaque Fonds doit régler a) 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), b) 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), c) 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, d) les frais de distribution versés par le Fonds dans le cadre d'un régime de réinvestissement des distributions adopté par le Fonds, e) 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), f) les frais liés à la prestation de services de prêt de titres, g) les frais engagés pour se conformer à de nouvelles exigences du gouvernement ou des autorités de réglementation adoptées après l'établissement du Fonds, et h) les dépenses extraordinaires. Le paiement ou la prise en charge, par le gestionnaire, des frais d'un Fonds décrits aux points a) à h) 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.

Prise en charge

La décision de renoncer aux frais de gestion et aux charges d'exploitation propres à un Fonds ou de les prendre en charge est au gré du gestionnaire. La pratique visant à renoncer aux charges, ou à les prendre en charge, peut se poursuivre indéfiniment ou être abandonnée en tout temps sans avis aux porteurs de parts. Les charges d'exploitation propres à un Fonds prises en charge par le gestionnaire ou les frais de gestion auxquels il a renoncé sont présentés dans les états du résultat global.

Dans certains cas, le gestionnaire peut accepter de réduire les frais de gestion qu'il recevrait autrement des Fonds à l'égard de placement effectués dans ceux-ci par certains porteurs de parts. Une somme correspondant à la différence entre les frais autrement facturables et les frais réduits du Fonds sera distribuée aux porteurs de parts concernés en espèces sous forme de distribution des frais de gestion.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Placements dans les fonds sous-jacents

Un Fonds qui investit dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents ne paiera pas de frais de gestion et d'administration en double sur la portion des actifs qui sont investis dans des parts ou des actions du ou des fonds sous-jacents. Au cours de la période de présentation de l'information financière, un Fonds pourrait recevoir des rabais sur frais de gestion ou d'administration du gestionnaire du ou des fonds sous-jacents relativement à ses placements dans un fonds sous-jacent. Les rabais sur frais de gestion ou d'administration, le cas échéant, sont compris dans les états de la situation financière et les états du résultat global de chaque Fonds, selon le cas, sous « Rabais sur frais à recevoir » et « Rabais sur frais ».

Voir le tableau des taux de frais de gestion dans les notes annexes propres au Fonds pour obtenir les ratios des frais de gestion de chaque catégorie de chaque Fonds.

6. PRÊT DE TITRES

Le 31 août 2020, les Fonds ont conclu un programme de prêt de titres avec la Bank of New York Mellon, qui agit comme agent de prêt de titres. Ces opérations comportent l'échange temporaire de titres contre une garantie comportant l'engagement à remettre les mêmes titres à une date future. Le produit tiré de ces opérations prend la forme d'honoraires payés par la contrepartie et, dans certaines circonstances, d'intérêts payés sur le montant au comptant ou les titres détenus en garantie. Le produit des opérations de prêt de titres est inclus aux états du résultat global et est comptabilisé lorsqu'il est gagné. La valeur de marché globale de tous les titres prêtés par un Fonds ne peut dépasser 50 % des actifs de ce Fonds. La garantie reçue est composée de titres admissibles et de titres qui sont immédiatement convertibles en titres de même type ou qui peuvent être échangés contre de tels titres, qui comportent les mêmes modalités et pour un même nombre que ceux prêtés par chaque Fonds, d'une valeur de marché correspondant au moins à 102 % de la valeur de marché des titres prêtés. Chaque dépositaire du Fonds a le droit de recevoir des paiements à même le montant brut tiré des opérations de prêt de titres des Fonds et assume tous les coûts d'exploitation directement liés au prêt de titres, y compris le coût d'indemnisation en cas de défaut de l'emprunteur. La valeur des titres prêtés et des garanties reçues de même qu'un rapprochement entre le revenu brut tiré des prêts de titres et le revenu tiré des prêts de titres figurent dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant. Les revenus tirés des prêts de titres figurent au poste « Revenu tiré des prêts de titres » des états du résultat global.

Avant le 31 août 2020, State Street Bank et la Compagnie Trust CIBC Mellon agissaient à titre de mandataire dans le cadre des opérations de prêt de titres des Fonds.

7. IMPOSITION

Les Fonds répondent à la définition de fiducie de fonds commun de placement en vertu de la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada). La totalité du résultat net des Fonds aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours d'une période doivent être distribués aux porteurs de parts de manière à ce que chaque Fonds n'ait aucun impôt à payer. Les Fonds ne comptabilisent donc pas d'impôts sur le résultat. Par conséquent, l'économie d'impôts liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans les états de la situation financière. L'impôt sur le montant net des gains en capital réalisés qui ne sont ni payés ni payables peut, en général, être recouvré en vertu des dispositions de remboursement contenues dans la Loi de l'impôt sur le revenu (Canada) et dans les lois provinciales de l'impôt sur le revenu, lorsque des rachats sont effectués. À l'occasion, les Fonds peuvent effectuer des distributions supérieures à leurs revenus. Ces distributions sont des remboursements de capital et ne sont pas imposables pour les porteurs de parts.

8. DISTRIBUTIONS

Chaque Fonds verse des distributions mensuelles ou trimestrielles à ses porteurs de parts. Le montant des distributions est fondé sur l'évaluation par le gestionnaire des flux de trésorerie prévus des Fonds de temps à autre.

Outre les distributions décrites ci-dessus, un Fonds peut, à l'occasion, verser d'autres distributions sur ses parts, notamment dans le cadre du versement d'un dividende spécial ou d'un remboursement de capital.

9. OPÉRATIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Les Fonds peuvent détenir une participation directe ou indirecte dans CI Financial Corp. ou ses filiales ou dans d'autres fonds de placement gérés par le gestionnaire indiqués dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds, le cas échéant.

Opérations entre fonds liés

Les opérations entre fonds liés ont lieu lorsque le Fonds achète ou vend les parts d'un émetteur auprès d'un autre Fonds géré par le gestionnaire. Durant les périodes closes les 30 juin 2021 et 2020, certains Fonds ont effectué des opérations entre fonds liés ou détenaient une ou plusieurs positions dans un ou des fonds liés à la fin de chaque période.

Opérations avec un émetteur lié

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 au cours de réunions prévues. Durant les périodes closes les 30 juin 2021 et 2020, le Fonds a effectué des opérations entre émetteurs ou détenait une ou plusieurs positions dans CI Financial Corp. à la fin de chaque période.

Opérations entre fonds

Les opérations entre fonds ont lieu lorsque le Fonds achète ou vend le titre d'un émetteur auprès d'un autre Fonds géré par le gestionnaire. Ces opérations sont réalisées par des intermédiaires du marché et selon les conditions qui prévalent sur le marché. Le Comité d'examen indépendant passe en revue ces opérations au cours de réunions prévues. Au cours des périodes closes les 30 juin 2021 et 2020, le Fonds a effectué des opérations entre fonds.

10. RISQUE LIÉ AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Répercussions de la COVID-19

Depuis le début de la pandémie de COVID-19, les mesures d'urgence adoptées en réaction à cet enjeu ont fortement perturbé les activités commerciales à l'échelle mondiale, ce qui a entraîné un ralentissement économique. Les marchés boursiers mondiaux et les marchés de capitaux ont affiché une forte volatilité ainsi qu'une grande faiblesse. Les gouvernements ont donc mis en œuvre d'importantes mesures monétaires et budgétaires afin de stabiliser les conditions économiques. La situation ne cesse d'évoluer et, pour l'instant, il est très difficile de déterminer et de prévoir avec certitude les répercussions de la pandémie de COVID-19. Cela dit, ces conséquences pourraient nettement influencer sur les résultats et les rendements futurs des Fonds. Compte tenu de l'incertitude et de la volatilité accrues sur les marchés à l'heure actuelle, le gestionnaire continue de surveiller de près les effets de la conjoncture sur les risques que présentent les placements en portefeuille pour les Fonds.

Gestion des risques

Les Fonds sont exposés à divers risques associés aux instruments financiers, à savoir le risque de concentration, le risque de crédit, le risque de liquidité, le risque de 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 la performance des Fonds à l'aide des mesures suivantes, entre autres : un suivi régulier des positions des Fonds et des

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

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.

Les Fonds qui investissent dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents sont indirectement exposés aux risques liés aux instruments financiers indiqués plus haut.

Risque de concentration

Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie, que ce soit un emplacement géographique, un type d'actif, un secteur d'activité ou un type de contrepartie.

Les renseignements au sujet de l'exposition aux risques liés aux instruments financiers de chaque Fonds, y compris le risque de concentration et le classement de la hiérarchie des justes valeurs, sont présentés dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque que l'émetteur du titre ou la contrepartie à un instrument financier ne puisse pas respecter ses obligations financières. La juste valeur d'un titre de créance tient compte de la note de crédit de l'émetteur. La valeur comptable des titres de créance telle que présentée dans l'inventaire du portefeuille représente l'exposition au risque de crédit de chaque Fonds. L'exposition au risque de crédit pour les dérivés se fonde sur le profit latent de chaque Fonds sur les obligations contractuelles envers la contrepartie à la date de clôture. La note de crédit d'une contrepartie à un dérivé est indiquée dans l'inventaire du portefeuille de chaque Fonds, le cas échéant. L'exposition au risque de crédit des autres actifs du Fonds correspond à leur valeur comptable présentée dans les états de la situation financière.

Les Fonds investissent uniquement dans des parts ou des actions de fonds sous-jacents et peuvent être exposés au risque de crédit indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents investissent dans des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés.

Les notes de crédit des titres de créance, des actions privilégiées et des dérivés proviennent de S&P Global Ratings, sinon de Moody's Investors Service ou Dominion Bond Rating Service, respectivement. Les notes de crédit peuvent être à long terme ou à court terme. Les notes de crédit à court terme sont généralement attribuées aux obligations et instruments dérivés à court terme.

Le tableau ci-dessous permet de comparer les notes de crédit à long terme présentées dans le tableau des risques de crédit et les notes de crédit à court terme présentées à l'annexe des dérivés de l'inventaire du portefeuille.

Notes de crédit selon le tableau des risques de crédit

AAA/Aaa/A++
AA/Aa/A+
A
BBB/Baa/B++
BB/Ba/B+
B
CCC/Caa/C++
CC/Ca/C+
C and Lower
Aucune

Notes de crédit selon les tableaux des dérivés

A-1+
A-1, A-2, A-3
B, B-1
B-2
B-3
C
-
-
D
WR

Les soldes de trésorerie présentés dans les états de la situation financière sont conservés par le dépositaire. Le gestionnaire surveille régulièrement la solvabilité du dépositaire. La note de crédit du dépositaire au 30 juin 2021 était de AA- (AA- au 31 décembre 2020).

Toutes les opérations effectuées par les Fonds portant sur des titres cotés sont réglées ou payées à la livraison en utilisant des courtiers approuvés. Le risque de défaillance est considéré comme minime, étant donné que la livraison des titres vendus n'est effectuée qu'au moment de la réception du paiement par le courtier. Le paiement est effectué lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une ou l'autre des parties manque à son obligation.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité s'entend du risque que les Fonds ne soient pas en mesure de satisfaire à leurs obligations en temps opportun ou à un prix raisonnable.

Les Fonds sont principalement exposés au risque de liquidité en raison des rachats de parts quotidiens en espèces. En règle générale, les Fonds investissent dans des titres qui sont considérés comme étant facilement réalisables étant donné qu'ils sont négociés en bourse. Certains titres peuvent être moins liquides que d'autres titres et comportent le risque que le gestionnaire ne soit pas en mesure de les vendre aux cours du marché en vigueur. Ainsi, il peut être difficile de modifier considérablement la composition du portefeuille d'un Fonds dans une courte période.

L'échéance de tous les passifs financiers est de moins de trois mois, sauf pour les parts rachetables, lesquelles peuvent être rachetées sur demande au gré du porteur. Le gestionnaire ne s'attend pas à ce que cette échéance contractuelle soit représentative des sorties de trésorerie réelles, car les porteurs de parts conservent généralement ces instruments pour une plus longue période.

Risque de marché

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

Autre risque de prix

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

Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme et, par conséquent, leur exposition à l'autre risque de prix est minime.

Risque de change

Le risque de change provient d'instruments financiers qui sont libellés en devises autres que le dollar canadien, la monnaie fonctionnelle des Fonds. Par conséquent, les Fonds peuvent être exposés au risque que la valeur des titres libellés dans d'autres devises varie à cause de fluctuations des taux de change. L'inventaire du portefeuille indique toutes les obligations et tous les dérivés qui sont libellés en devises. Les actions négociées sur des marchés étrangers sont aussi exposées à des risques de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle des Fonds afin de déterminer leur juste valeur.

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Notes des états financiers (non audité) (suite)

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de change indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers qui sont libellés en devises autres que la monnaie fonctionnelle des Fonds.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que la juste valeur des placements portant intérêt et des dérivés de taux d'intérêt fluctue en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur. Par conséquent, la valeur des Fonds qui investissent dans des titres de créance ou des titres de fiducies de revenu sera influencée par des fluctuations du taux d'intérêt applicable. Si les taux d'intérêt diminuent, la juste valeur des titres de créance existants pourrait augmenter en raison du rendement plus élevé. Par contre, si les taux d'intérêt augmentent, la réduction du rendement des titres de créance existants pourrait entraîner une baisse de leur juste valeur. En général, la baisse est plus importante pour les titres de créance à long terme que pour les titres de créance à court terme.

Le risque de taux d'intérêt s'applique également aux Fonds qui investissent dans des titres convertibles. La juste valeur de ces titres varie de façon inverse aux taux d'intérêt, tout comme d'autres titres de créance. Toutefois, étant donné qu'ils peuvent être convertis en actions ordinaires, les titres convertibles sont généralement moins touchés par les fluctuations de taux d'intérêt que d'autres titres de créance.

Certains Fonds investissent dans des parts ou des actions d'un ou plusieurs fonds sous-jacents et d'un ou plusieurs FNB et peuvent être exposés au risque de taux d'intérêt indirect, dans le cas où les fonds sous-jacents ou les FNB investissent dans des instruments financiers portant intérêt.

Les renseignements au sujet de l'exposition aux risques liés aux instruments financiers de chaque Fonds, y compris le risque de concentration et le classement de la hiérarchie des justes valeurs, sont présentés dans les notes annexes propres au Fonds de chaque Fonds.

Hiérarchie des justes valeurs

Les Fonds doivent classer les instruments financiers évalués selon la juste valeur en utilisant une hiérarchie des justes valeurs. Les placements évalués selon des cours cotés sur des marchés actifs sont classés au niveau 1. Ce niveau 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 options hors cote, les billets structurés de titres indexés, les contrats de change à terme, les swaps, les certificats américains d'actions étrangères et les certificats mondiaux d'actions étrangères si aucun cours du marché n'est disponible.

L'évaluation des placements classés au niveau 3 repose sur des données non observables importantes. Les placements du niveau 3 comprennent les actions de sociétés fermées, les prêts à terme privés, les fonds d'actions privés et certains dérivés. Des cours observables n'étant pas disponibles pour ces titres, les Fonds pourraient utiliser une variété de techniques d'évaluation pour calculer leur juste valeur.

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

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

Fonds négociés en bourse CI WisdomTree

Avis juridique

Certains noms, mots, phrases, graphismes ou conceptions graphiques figurant dans ce document peuvent constituer des noms commerciaux, des marques déposées ou non déposées, ou des marques de service de Gestion Mondiale d'actifs CI. Fonds CI, Financière CI, Placements CI et la conception graphique de Placements CI sont des marques déposées de Gestion Mondiale d'actifs CI. Les marques et noms des logos CI et icône CI sont la propriété de Gestion Mondiale d'actifs CI et sont utilisés sous licence. Gestion Mondiale d'actifs CI est le nom d'une société enregistrée de CI Investments Inc.

Le gestionnaire est autorisé par WisdomTree Investments, Inc. à utiliser certains indices WisdomTree (les « **indices WisdomTree** ») et les marques WisdomTree dans les Fonds. (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 et du FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI) (les « **Fonds sous licence de WisdomTree** ») et à s'y référer.

« WisdomTree® » et « Variably Hedged® » sont des marques déposées de WisdomTree Investments, Inc., laquelle est en attente de la réponse aux demandes de brevets qu'elle a déposées concernant la méthodologie et le fonctionnement de ses indices. Les Fonds sous licence de WisdomTree ne sont ni cautionnés, ni recommandés, ni vendus, ni promus par WisdomTree Investments, Inc. ou ses sociétés affiliées (« **WisdomTree** »). WisdomTree ne fait aucune déclaration ni ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant à l'utilité, à la légalité (y compris quant à l'exactitude ou au caractère adéquat des descriptions et des déclarations relatives aux Fonds sous licence de WisdomTree) ou à la pertinence d'investir dans des titres ou d'autres instruments ou produits financiers en général ou dans les Fonds sous licence de WisdomTree en particulier ou quant à l'utilisation des indices WisdomTree ou des données qu'ils comprennent. WisdomTree n'a accordé au gestionnaire que certains droits d'utilisation des indices WisdomTree, qui sont déterminés, composés et calculés par WisdomTree et/ou d'autres tierces parties, sans égard au gestionnaire, aux Fonds sous licence de WisdomTree ou aux investisseurs des Fonds sous licence de WisdomTree, et ni les Fonds sous licence de WisdomTree ni les investisseurs n'établissent quelque relation que ce soit avec WisdomTree en lien avec les Fonds sous licence de WisdomTree. WISDOMTREE NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE QUELLE FAÇON QUE CE SOIT DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE, NOTAMMENT DE L'ÉMISSION, DE L'EXPLOITATION, DE L'ADMINISTRATION, DE LA GESTION, DU RENDEMENT, DU MARKETING OU DE LA DISTRIBUTION DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE OU DU DÉFAUT DES FONDS SOUS LICENCE DE WISDOMTREE D'ATTEINDRE LEURS OBJECTIFS DE PLACEMENT RESPECTIFS. LA RESPONSABILITÉ DE WISDOMTREE NE SAURAIT D'AUCUNE FAÇON ÊTRE ENGAGÉE RELATIVEMENT À L'EXACTITUDE, À LA QUALITÉ, À LA CONFORMITÉ, À LA FIABILITÉ, À LA SÉQUENCE, À L'ACTUALITÉ OU AUTRES DES INDICES DE WISDOMTREE OU DES DONNÉES QU'ILS COMPRENNENT. SANS LIMITER LA PORTÉE DE CE QUI PRÉCÈDE, WISDOMTREE NE PEUT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE DOMMAGES PARTICULIERS, INDIRECTS OU ACCESSOIRES, DE DOMMAGES-INTÉRÊTS PUNITIFS OU DE TOUT MANQUE À GAGNER, MÊME SI ELLE AVAIT ÉTÉ AVISÉE DE CETTE POSSIBILITÉ.

BLOOMBERG® est une marque de commerce et de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « **Bloomberg** »). BARCLAYS® est une marque de commerce et de service de Barclays Bank Plc (collectivement, avec ses sociétés affiliées, « **Barclays** »), utilisée sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, dont Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur l'indice Bloomberg Barclays Canadian Aggregate Enhanced Yield et l'indice Bloomberg Barclays Canadian Short Aggregate Enhanced Yield (collectivement, les « **indices Bloomberg Barclays** »). Ni Bloomberg ni Barclays ne sont affiliées à CI Investments Inc., et ni l'une ni l'autre n'approuve, n'analyse ou ne recommande le FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI ou le FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI ou ne s'en porte garante. Ni Bloomberg ni Barclays ne garantissent l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou de l'information se rapportant aux indices Bloomberg Barclays, et ni l'une ni l'autre ne peut être tenue responsable de quelque façon que ce soit envers les investisseurs du FNB Indice total des obligations du Canada à rendement amélioré CI ou du FNB Indice total des obligations à court terme du Canada à rendement amélioré CI ou envers de tierces parties de l'utilisation ou de l'exactitude des indices Bloomberg Barclays ou des données qu'ils comprennent.

Le « S&P China 500 Index CAD » (l'« **indice** ») est un produit de S&P Dow Jones Indices LLC ou de ses sociétés affiliées (« **SPDJI** ») et d'ICBC Credit Suisse Asset Management (International) Company Limited (« **ICBCCS** »), et CI Investments Inc. détient une licence d'utilisation de cet indice. Standard & Poor's® et S&P® sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (« **S&P** »); Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« **Dow Jones** »). Le FNB Indice S&P China 500 ICBCCS CI n'est ni cautionné, ni recommandé, ni vendu, ni promu par SPDJI, Dow Jones, S&P, leurs sociétés affiliées respectives, ou ICBCCS. Aucune de ces parties ne fait de déclaration quant à l'opportunité d'investir dans ces produits et ne saurait être tenue responsable des erreurs, omissions ou interruptions de l'indice.

Vous pouvez obtenir sur demande et sans frais des exemplaires supplémentaires des présents états financiers en composant le 1 877 642-1289, en écrivant à servicefrancais@ci.com ou en communiquant avec votre représentant.

Ce document, ainsi que tout autre renseignement au sujet des fonds, est disponible au www.firstasset.com ou au www.sedar.com.

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

WT_SA_F (08/21)