

RAPPORT ANNUEL

FNB Scotia

31 décembre 2023

TABLE DES MATIÈRES

Responsabilité de la direction à l'égard de l'information financière	1
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	2
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	15
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	19
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	32
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	41
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	47
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	50
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	57
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	61
Notes annexes	66
Rapport de l'auditeur indépendant	76

Les états financiers ci-joints des Fonds (indiqués à la note annexe 1) ont été dressés par Gestion d'actifs 1832 S.E.C., en sa qualité de gestionnaire (le « gestionnaire ») des Fonds, et ont été approuvés par le conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C., à titre de commandité et au nom de Gestion d'actifs 1832 S.E.C., en sa qualité de fiduciaire (le « fiduciaire ») des Fonds. Le conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C. à titre de commandité et au nom de Gestion d'actifs 1832 S.E.C., est responsable des informations et des déclarations contenues dans les présents états financiers et dans le rapport de la direction sur le rendement du Fonds.

Le gestionnaire maintient des processus appropriés afin de s'assurer que sont produites des informations financières exactes, pertinentes et fiables. Les états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (les *International Financial Reporting Standards*, ou « IFRS ») et comprennent certains montants basés sur des estimations et des jugements faits par le gestionnaire. Les principales méthodes comptables que le gestionnaire juge appropriées pour les Fonds sont décrites à la note annexe 2 des états financiers.

Le conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C. a délégué la surveillance du processus de présentation de l'information financière au comité des finances du conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C. (le « comité des finances »). Il incombe au comité des finances d'examiner les états financiers et le rapport de la direction sur le rendement du Fonds et de recommander leur approbation au conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C. ainsi que de rencontrer les membres de la direction et les auditeurs internes et externes pour discuter des contrôles internes portant sur le processus de présentation de l'information financière, des questions d'audit et des problèmes liés à la présentation de l'information financière.

KPMG s.r.l./S.E.N.C.R.L. est l'auditeur indépendant des Fonds, nommé par le fiduciaire des Fonds. L'auditeur des Fonds a effectué l'audit des états financiers conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada pour exprimer une opinion sur les états financiers adressée aux porteurs de titres. Son rapport est reproduit ci-après.



NEAL KERR
Président
Gestion d'actifs 1832 S.E.C.



GREGORY JOSEPH
Chef des finances
Gestion d'actifs 1832 S.E.C.

Le 7 mars 2024

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	327 439 689	224 858 695
Trésorerie	768 944	561 982
Montant à recevoir pour la vente de titres	139 229	–
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	1 718 625	1 098 268
Total de l'actif	330 066 487	226 518 945
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	15 289	10 536
Charges à payer	9 288	6 431
Distributions à verser	818 280	530 400
Total du passif	842 857	547 367
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	329 223 630	225 971 578
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	17,19	16,62

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Intérêts à distribuer	7 943 011	5 647 919
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(4 248 068)	(3 192 241)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	16 567 108	(26 973 212)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	20 262 051	(24 517 534)
Revenu tiré du prêt de titres	24 963	22 487
Total des revenus (pertes), montant net	20 287 014	(24 495 047)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	132 150	105 914
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	79 290	63 548
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 115
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	21 524	16 692
Total des charges	234 102	187 269
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	20 052 912	(24 682 316)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	1,26	(2,01)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	15 853 562	12 280 548

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	225 971 578	178 720 879
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	20 052 912	(24 682 316)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(7 576 430)	(5 383 356)
Remboursement de capital	–	(20 194)
	(7 576 430)	(5 403 550)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	116 626 750	88 242 070
Paieement au rachat	(25 851 180)	(10 905 505)
	90 775 570	77 336 565
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	103 252 052	47 250 699
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	329 223 630	225 971 578

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20 052 912	(24 682 316)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	4 248 068	3 192 241
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(16 567 108)	26 973 212
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés	(63 345 577)	(41 946 444)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés	62 985 769	41 493 992
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(620 357)	(397 530)
Charges à payer et autres montants à payer	7 610	3 642
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	6 761 317	4 636 797
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables	1 067 717	839 591
Montant payé au rachat de parts rachetables	(333 522)	(87 284)
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(7 288 550)	(5 096 350)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(6 554 355)	(4 344 043)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	206 962	292 754
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	561 982	269 228
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	768 944	561 982
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	7 322 655	5 250 389

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 %			
Obligations de sociétés – 23,1 %			
407 International, Inc., 5,96 %, 3 déc. 2035, série 04-A3	55 000	68 847	62 824
407 International, Inc., 5,75 %, 14 févr. 2036, série 06-D1	70 000	83 943	76 266
407 International, Inc., 4,45 %, 15 nov. 2041	43 000	45 150	42 781
407 International, Inc., 4,19 %, 25 avr. 2042, série 12-A1	51 000	56 413	49 117
407 International, Inc., 3,98 %, 11 sept. 2052, série 12-A2	60 000	61 970	55 720
407 International, Inc., 3,83 %, 11 mai 2046, série 15-A2	60 000	63 721	54 715
407 International, Inc., 3,60 %, 21 mai 2047, série 16-A1	67 000	66 080	58 604
407 International, Inc., 2,43 %, 4 mai 2027, série 16-A2	56 000	57 743	53 385
407 International, Inc., 3,65 %, 8 sept. 2044, série 17-A2	55 000	57 469	48 902
407 International, Inc., 3,72 %, 11 mai 2048, série 18-A1	150 000	131 041	133 608
407 International, Inc., 3,14 %, 6 mars 2030, série 19-A1	30 000	32 009	28 681
407 International, Inc., 3,67 %, 8 mars 2049, série 19-A2	65 000	65 447	57 442
407 International, Inc., 4,68 %, 7 oct. 2053, série 13-A1	31 000	34 411	32 229
407 International, Inc., 3,43 %, 1 ^{er} juin 2033, série 17-A1	26 000	27 967	24 465
407 International, Inc., 2,84 %, 7 mars 2050, série 20-A1	180 000	147 106	136 076
407 International, Inc., 1,80 %, 22 mai 2025, série 20-A2	40 000	40 255	38 549
407 International, Inc., 2,59 %, 25 mai 2032, série 20-A3	70 000	66 459	62 460
407 International, Inc., 4,22 %, 14 févr. 2028, série 22-D1	45 000	44 211	44 901
407 International, Inc., 4,45 %, 14 août 2031, série 22-D2	45 000	43 623	44 731
407 International, Inc., 4,86 %, 31 juill. 2053	65 000	65 123	69 513
The 55 Ontario School Board Trust, 5,90 %, 2 juin 2033	95 000	122 115	108 081
Aéroports de Montréal, 6,55 %, 11 oct. 2033, série D	26 000	29 581	30 351
Aéroports de Montréal, 5,17 %, 17 sept. 2035, série G	35 000	43 102	37 210
Aéroports de Montréal, 5,67 %, 16 oct. 2037, série H	35 000	46 056	39 273
Aéroports de Montréal, 3,92 %, 26 sept. 2042, série K	30 000	30 543	28 220
Aéroports de Montréal, 3,92 %, 12 juin 2045, série M	30 000	32 246	28 161
Aéroports de Montréal, 3,36 %, 24 avr. 2047, série N	45 000	42 384	38 655
Aéroports de Montréal, 6,95 %, 16 avr. 2032, série B	19 341	23 871	21 194
Aéroports de Montréal, 3,03 %, 21 avr. 2050	60 000	58 884	48 003
Aéroports de Montréal, 3,44 %, 26 avr. 2051	46 000	47 862	39 599
AIMCo Realty Investors LP, 3,04 %, 1 ^{er} juin 2028, série 2	50 000	51 650	47 202
AIMCo Realty Investors LP, 3,37 %, 1 ^{er} juin 2027, série 3	46 000	46 784	44 509
AIMCo Realty Investors LP, 2,71 %, 1 ^{er} juin 2029, série 4	90 000	90 521	82 445
AIMCo Realty Investors LP, 2,20 %, 4 nov. 2026, série 5	57 000	56 328	53 670
Alberta Powerline LP, 4,06 %, 1 ^{er} déc. 2053	24 591	26 976	22 469
Alberta Powerline LP, 4,06 %, 1 ^{er} mars 2054	78 768	80 932	71 888
Alectra, Inc., 3,96 %, 30 juill. 2042, série A	20 000	21 992	18 732
Alectra, Inc., 5,30 %, 29 avr. 2041, série B	19 000	24 663	20 889
Alectra, Inc., 2,49 %, 17 mai 2027, série A	85 000	87 145	80 761
Alectra, Inc., 3,46 %, 12 avr. 2049, série 2019	20 000	21 600	17 120
Alectra, Inc., 1,75 %, 11 févr. 2031, série 2021-1	53 000	47 850	45 266
Alectra, Inc., 5,22 %, 14 nov. 2052, série 2022-1	35 000	36 244	39 590
Algonquin Power Co., 4,09 %, 17 févr. 2027	40 000	42 074	39 080
Algonquin Power Co., 4,60 %, 29 janv. 2029	29 000	33 223	28 772
Algonquin Power Co., 2,85 %, 15 juill. 2031	50 000	46 101	43 671
Alimentation Couche-Tard Inc., 3,60 %, 2 juin 2025, série 5	130 000	133 888	127 869
Alimentation Couche-Tard Inc., 5,59 %, 25 sept. 2030	100 000	102 126	98 785
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,64 %, 21 avr. 2025, série C	99 000	99 000	104 890
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,39 %, 15 août 2029, série D	50 000	49 963	48 512
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,11 %, 8 avr. 2027, série E	35 000	36 264	30 318
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,12 %, 21 févr. 2030, série F	35 000	35 246	31 966
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 1,73 %, 12 févr. 2026, série H	50 000	48 194	41 895
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,13 %, 15 mai 2028, série G	130 000	121 130	119 547
	30 000	31 088	26 618

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3,10 %, 6 févr. 2032, série I	54 000	52 796	42 331
AltaGas Ltd., 4,40 %, 15 mars 2024, série 11	24 000	25 433	23 945
AltaGas Ltd., 4,50 %, 15 août 2044	40 000	38 746	35 359
AltaGas Ltd., 3,84 %, 15 janv. 2025	35 000	36 970	34 559
AltaGas Ltd., 4,12 %, 7 avr. 2026	78 000	80 093	77 247
AltaGas Ltd., 3,98 %, 4 oct. 2027	45 000	45 542	43 866
AltaGas Ltd., 2,16 %, 10 juin 2025	55 000	54 810	52 918
AltaGas Ltd., 4,99 %, 4 oct. 2047	25 000	27 971	23 567
AltaGas Ltd., 2,08 %, 30 mai 2028	65 000	63 807	58 608
AltaGas Ltd., 2,48 %, 30 nov. 2030	45 000	40 115	39 007
AltaGas Ltd., 2,17 %, 16 mars 2027	25 000	23 886	23 171
AltaLink LP, 4,46 %, 8 nov. 2041, série 2011-1	35 000	40 776	34 876
AltaLink LP, 3,99 %, 30 juin 2042	65 000	72 480	60 975
AltaLink LP, 4,92 %, 17 sept. 2043, série 2013-3	30 000	38 404	31 789
AltaLink LP, 3,40 %, 6 juin 2024	41 000	42 974	40 686
AltaLink LP, 4,05 %, 21 nov. 2044	40 000	45 984	37 756
AltaLink LP, 4,09 %, 30 juin 2045	64 000	65 832	60 773
AltaLink LP, 2,75 %, 29 mai 2026	49 000	50 591	47 474
AltaLink LP, 3,72 %, 3 déc. 2046	75 000	78 450	67 394
AltaLink LP, 1,51 %, 11 sept. 2030, série 2020-1	30 000	27 094	25 555
AltaLink LP, 4,45 %, 11 juill. 2053, série 2013-1	23 000	28 564	23 174
AltaLink LP, 4,69 %, 28 nov. 2032, série 2022-1	30 000	31 377	31 068
AltaLink LP, 5,46 %, 11 oct. 2055	102 000	105 783	120 319
ARC Resources Ltd., 3,47 %, 10 mars 2031	55 000	55 260	50 678
ARC Resources Ltd., 2,35 %, 10 mars 2026	55 000	52 954	52 457
Artis Real Estate Investment Trust, 5,60 %, 29 avr. 2025	20 000	19 715	19 481
Banque de Montréal, 4,61 %, 10 sept. 2025	82 000	88 933	82 079
Banque de Montréal, 2,70 %, 9 déc. 2026	90 000	92 415	86 407
Banque de Montréal, 3,19 %, 1 ^{er} mars 2028	365 000	382 380	352 302
Banque de Montréal, 2,37 %, 3 févr. 2025	181 000	183 991	175 764
Banque de Montréal, 2,08 %, 17 juin 2030	199 000	195 509	190 483
Banque de Montréal, 1,76 %, 10 mars 2026	90 000	89 151	85 250
Banque de Montréal, 1,55 %, 28 mai 2026	173 000	167 146	162 227
Banque de Montréal, 1,93 %, 22 juill. 2031	125 000	120 277	116 154
Banque de Montréal, 3,65 %, 1 ^{er} avr. 2027	446 000	430 590	435 033
Banque de Montréal, 4,31 %, 1 ^{er} juin 2027	530 000	518 202	527 339
Banque de Montréal, 6,53 %, 27 oct. 2032	105 000	108 362	110 677
Banque de Montréal, 4,71 %, 7 déc. 2027	345 000	343 783	347 995
Banque de Montréal, 5,04 %, 29 mai 2028	267 000	266 414	273 074
Banque de Montréal, 6,03 %, 7 sept. 2033	102 000	102 000	106 410
Banque de Montréal, 4,54 %, 18 déc. 2028	202 000	202 000	203 174
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,62 %, 2 déc. 2026	181 000	182 621	172 404
La Banque de Nouvelle-Écosse, 3,10 %, 2 févr. 2028	267 000	271 071	256 966
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 févr. 2025	293 000	291 131	283 853
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,40 %, 1 ^{er} nov. 2027	260 000	240 055	234 166
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,85 %, 2 nov. 2026	371 000	352 891	346 150
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janv. 2025	300 000	294 972	290 655
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,95 %, 8 mars 2027	580 000	556 586	554 039
La Banque de Nouvelle-Écosse, 3,93 %, 3 mai 2032	270 000	263 199	260 877
La Banque de Nouvelle-Écosse, 5,50 %, 8 mai 2026	190 000	194 203	194 018
La Banque de Nouvelle-Écosse, 5,50 %, 29 déc. 2025	150 000	149 683	152 251
BCI QuadReal Realty, 1,68 %, 3 mars 2025	45 000	44 888	43 387
BCI QuadReal Realty, 1,75 %, 24 juill. 2030	40 000	37 843	33 791
BCI QuadReal Realty, 1,07 %, 4 févr. 2026	42 000	40 900	39 222
BCI QuadReal Realty, 2,55 %, 24 juin 2026	43 000	42 638	41 181
bclMC Realty Corp., 2,84 %, 3 juin 2025	60 000	63 360	58 465
bclMC Realty Corp., 3,00 %, 31 mars 2027	135 000	131 426	129 364
Bell MTS, Inc., 4,00 %, 27 mai 2024	41 000	41 518	40 784
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 7,85 %, 2 avr. 2031	35 000	40 683	41 171
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 7,30 %, 23 févr. 2032	35 000	46 045	40 491
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 6,10 %, 16 mars 2035	55 000	66 462	60 252
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 4,75 %, 29 sept. 2044	60 000	65 862	57 735
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 6,17 %, 26 févr. 2037, série M-34	25 000	31 522	27 792
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,55 %, 2 mars 2026	100 000	103 066	98 148
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 2,90 %, 12 août 2026	81 000	82 239	78 188
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 4,45 %, 27 févr. 2047	75 000	83 036	69 083
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,60 %, 29 sept. 2027	100 000	107 049	97 542
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,35 %, 12 mars 2025	280 000	285 336	274 568
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,80 %, 21 août 2028	120 000	127 744	117 756
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 4,35 %, 18 déc. 2045	65 000	67 788	59 018
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 2,75 %, 29 janv. 2025	80 000	81 350	78 037

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 2,90 %, 10 sept. 2029	120 000	113 251	111 454
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,50 %, 30 sept. 2050	270 000	217 125	209 965
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 2,50 %, 14 mai 2030, série M-52	120 000	115 820	107 244
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 1,65 %, 16 août 2027	90 000	86 075	82 846
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 3,00 %, 17 mars 2031	166 000	159 098	150 685
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 4,05 %, 17 mars 2051	89 000	83 494	76 254
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 2,20 %, 29 mai 2028, série M-56	71 000	68 673	65 068
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 5,85 %, 10 nov. 2032, série M-57	165 000	164 916	179 348
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 4,55 %, 9 févr. 2030	212 000	205 441	213 486
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 5,15 %, 9 févr. 2053	56 000	55 720	57 066
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 5,15 %, 14 nov. 2028	75 000	74 186	77 755
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 5,60 %, 11 août 2053	50 000	48 879	54 490
Compagnie de Téléphone Bell du Canada ou Bell Canada, 5,25 %, 15 mars 2029	92 000	91 905	95 947
BMW Canada, Inc., 0,99 %, 14 janv. 2025	20 000	19 535	19 198
BMW Canada, Inc., 4,41 %, 10 févr. 2027	50 000	48 977	50 152
Bridging North America GP, 4,34 %, 31 août 2053	15 000	15 721	13 217
British Columbia Ferry Services, Inc., 5,02 %, 20 mars 2037, série 07-1	32 000	40 611	33 930
British Columbia Ferry Services, Inc., 5,58 %, 11 janv. 2038, série 08-1	27 000	35 215	30 282
British Columbia Ferry Services, Inc., 4,29 %, 28 avr. 2044, série 14-1	40 000	43 169	39 355
British Columbia Ferry Services, Inc., 4,70 %, 23 oct. 2043	25 000	29 788	25 855
British Columbia Ferry Services, Inc., 2,79 %, 15 oct. 2049, série 19-1	45 000	37 959	34 217
Brookfield Corp., 5,95 %, 14 juin 2035	40 000	48 631	42 372
Brookfield Corp., 5,04 %, 8 mars 2024	55 000	58 975	54 952
Brookfield Corp., 4,82 %, 28 janv. 2026	140 000	148 432	140 244
Brookfield Corp., 3,80 %, 16 mars 2027	80 000	83 656	78 481
Brookfield Finance II, Inc., 5,43 %, 14 déc. 2032	145 000	144 087	148 861
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 4,19 %, 11 sept. 2028	80 000	85 791	78 394
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3,41 %, 9 oct. 2029	105 000	107 488	97 842
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 2,86 %, 1 ^{er} sept. 2032	105 000	90 001	89 657
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,44 %, 25 avr. 2034, série 9	51 000	51 111	52 227
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,79 %, 25 avr. 2052, série 10	41 000	39 416	43 634
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,62 %, 14 nov. 2027, série 11	62 000	62 247	64 128
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,98 %, 14 févr. 2033, série 12	40 000	39 971	42 696
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,71 %, 27 juill. 2030	75 000	75 577	78 445
Brookfield Infrastructure Finance ULC, 5,95 %, 27 juill. 2053	35 000	35 943	37 898
Brookfield Property Finance ULC, 4,30 %, 1 ^{er} mars 2024	25 000	26 287	24 865
Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 15 janv. 2027	33 000	34 103	29 831
Brookfield Property Finance ULC, 3,93 %, 24 août 2025	25 000	25 925	23 704
Brookfield Renewable Partners ULC, 3,75 %, 2 juin 2025	62 000	65 182	61 020
Brookfield Renewable Partners ULC, 3,63 %, 15 janv. 2027	85 000	87 712	82 731
Brookfield Renewable Partners ULC, 4,25 %, 15 janv. 2029	45 000	50 789	44 352
Brookfield Renewable Partners ULC, 3,38 %, 15 janv. 2030	61 000	62 644	56 965
Brookfield Renewable Partners ULC, 4,29 %, 5 nov. 2049	35 000	37 033	31 119
Brookfield Renewable Partners ULC, 3,33 %, 13 août 2050	54 000	48 565	40 344
Brookfield Renewable Partners ULC, 5,88 %, 9 nov. 2032, série 15	58 000	59 140	62 274
Brookfield Renewable Partners ULC, 5,29 %, 28 oct. 2033	50 000	51 846	51 428
Bruce Power LP, 3,97 %, 23 juin 2026	89 000	93 361	88 087
Bruce Power LP, 4,01 %, 21 juin 2029	55 000	58 914	54 087
Bruce Power LP, 4,13 %, 21 juin 2033	65 000	64 767	62 371
Bruce Power LP, 4,75 %, 21 juin 2049	53 000	63 445	52 551
Bruce Power LP, 4,00 %, 21 juin 2030	75 000	85 698	72 962

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Bruce Power LP, 2,68 %, 21 déc. 2028	81 000	77 252	74 994
Bruce Power LP, 4,70 %, 21 déc. 2027	45 000	44 172	45 491
Bruce Power LP, 4,99 %, 21 déc. 2032	50 000	51 409	51 295
CAE, Inc., 5,54 %, 12 juin 2028	100 000	99 079	102 968
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,20 %, 7 oct. 2036, série A	55 000	51 363	48 302
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,34 %, 7 oct. 2038, série B	35 000	34 841	30 785
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,45 %, 7 oct. 2041, série C	44 000	42 166	38 542
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,55 %, 7 oct. 2051, série D	60 000	57 601	52 110
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,55 %, 7 oct. 2053, série E	50 000	46 556	43 058
Administration aéroportuaire de Calgary, 3,75 %, 7 oct. 2061, série F	9 775	9 775	8 919
Corporation Cameco, 4,19 %, 24 juin 2024, série G	110 000	111 894	109 279
Corporation Cameco, 2,95 %, 21 oct. 2027, série H	45 000	45 328	42 462
Société canadienne des postes, 4,08 %, 16 juill. 2025, série 2	25 000	27 975	24 928
Immobilier Canadien de Base S.E.C., 3,30 %, 2 mars 2027	30 000	29 214	28 148
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,30 %, 26 mai 2025	228 000	238 782	223 960
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,00 %, 17 avr. 2025	250 000	252 628	240 935
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,01 %, 21 juill. 2030	105 000	102 428	100 026
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,10 %, 19 janv. 2026	154 000	146 347	143 935
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,96 %, 21 avr. 2031	175 000	166 887	163 460
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,70 %, 15 juill. 2026	307 000	287 012	288 095
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janv. 2027	242 000	235 306	227 473
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,75 %, 7 mars 2025	491 000	478 270	478 509
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,20 %, 7 avr. 2032	159 000	153 903	155 060
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,95 %, 29 juin 2027	277 000	276 978	280 947
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,05 %, 7 oct. 2027	228 000	227 171	232 061
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,33 %, 20 janv. 2033	119 000	119 236	120 178
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,35 %, 20 avr. 2033	100 000	100 589	101 271
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,50 %, 14 janv. 2028	230 000	228 961	238 153
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,93 %, 14 juill. 2026	95 000	94 671	95 476
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,00 %, 7 déc. 2026	181 000	180 989	183 672
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,80 %, 22 sept. 2025	55 000	56 820	53 396
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,95 %, 22 sept. 2045	45 000	44 675	41 460
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 1 ^{er} août 2047	80 000	81 389	69 379
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 31 juill. 2048	45 000	45 555	38 934
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,20 %, 31 juill. 2028	40 000	42 756	38 650
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,00 %, 8 févr. 2029	45 000	45 973	42 885
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 8 févr. 2049	55 000	56 813	47 581
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,05 %, 8 févr. 2050	63 000	56 644	49 080
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 4,40 %, 10 mai 2033	60 000	60 470	60 708
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 4,15 %, 10 mai 2030	93 000	92 653	93 144
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 4,70 %, 10 mai 2053	183 000	172 412	188 843
Canadian Natural Resources Ltd., 3,55 %, 3 juin 2024	62 000	64 298	61 551
Canadian Natural Resources Ltd., 3,42 %, 1 ^{er} déc. 2026	75 000	78 701	72 910
Canadian Natural Resources Ltd., 4,85 %, 30 mai 2047	30 000	33 206	28 468
Canadian Natural Resources Ltd., 2,50 %, 17 janv. 2028	37 000	35 653	34 442
Compagnie de Chemin de fer Canadien Pacifique, 6,45 %, 17 nov. 2039	60 000	79 447	72 206
Compagnie de Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,15 %, 13 mars 2029	55 000	57 533	52 273

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Compagnie de Chemin de fer Canadien Pacifique, 3,05 %, 9 mars 2050	25 000	23 011	19 275
Compagnie de Chemin de fer Canadien Pacifique, 2,54 %, 28 févr. 2028	147 000	144 533	137 807
La Société Canadian Tire Limitée, 5,37 %, 16 sept. 2030	55 000	55 000	57 610
Canadian Utilities Ltd., 4,85 %, 3 juin 2052	17 000	17 000	17 637
Banque Canadienne de l'Ouest, 2,60 %, 6 sept. 2024	65 000	65 352	63 822
Banque canadienne de l'Ouest, 2,61 %, 30 janv. 2025	90 000	89 466	87 395
Banque Canadienne de l'Ouest, 1,82 %, 16 déc. 2027	55 000	52 971	49 565
Banque Canadienne de l'Ouest, 1,93 %, 16 avr. 2026	57 000	55 394	53 679
Banque Canadienne de l'Ouest, 3,86 %, 21 avr. 2025	46 000	45 679	45 255
Capital Power Corp., 4,28 %, 18 sept. 2024, série 1	60 000	62 432	59 485
Capital Power Corp., 4,99 %, 23 janv. 2026	42 000	46 417	41 906
Capital Power Corp., 4,42 %, 8 févr. 2030	35 000	38 363	34 010
Capital Power Corp., 3,15 %, 1 ^{er} oct. 2032	40 000	36 946	34 221
Capital Power Corp., 5,38 %, 25 janv. 2027	100 000	101 332	101 692
Capital Power Corp., 5,97 %, 25 janv. 2034	68 000	67 992	70 923
Carleton University, 3,26 %, 5 juill. 2061	10 000	10 000	7 715
CCL Industries, Inc., 3,86 %, 13 avr. 2028, série 1	33 000	33 084	31 884
CDP Financière inc., 1,50 %, 19 oct. 2026	142 000	139 802	133 402
CDP Financière inc., 3,95 %, 1 ^{er} sept. 2029	211 000	211 054	214 682
CDP Financière inc., 3,80 %, 2 juin 2027	114 000	113 968	114 321
CDP Financière inc., 3,70 %, 8 mars 2028	449 000	440 053	450 441
CDP Financière inc., 4,20 %, 2 déc. 2030	110 000	109 711	113 429
Enovus Energy, Inc., 3,50 %, 7 févr. 2028	156 000	160 301	150 340
Enovus Energy, Inc., 3,60 %, 10 mars 2027	120 000	121 632	117 150
Central 1 Credit Union, 1,32 %, 29 janv. 2026	24 000	23 488	22 239
Central 1 Credit Union, 2,39 %, 30 juin 2031	37 000	34 744	33 642
Central 1 Credit Union, 4,65 %, 7 févr. 2028	22 000	20 902	21 606
CGI, Inc., 2,10 %, 18 sept. 2028	70 000	66 705	63 568
Fiducie hypothécaire CHIP, 1,74 %, 15 déc. 2045, série 2020-1	30 000	26 932	27 952
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 4,05 %, 24 nov. 2025, série F	25 000	26 883	24 607
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 3,55 %, 10 janv. 2025, série J	65 000	65 705	63 900
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 3,56 %, 9 sept. 2024, série K	70 000	72 420	69 153
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 4,18 %, 8 mars 2028, série L	115 000	123 125	112 882
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 3,53 %, 11 juin 2029, série M	112 000	112 197	105 809
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 2,98 %, 4 mars 2030, série N	50 000	47 451	45 274
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 2,85 %, 21 mai 2027, série P	95 000	92 856	89 803
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 2,46 %, 30 nov. 2026, série Q	46 000	44 632	43 371
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 6,00 %, 24 juin 2032, série R	96 000	97 549	102 844
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, 5,40 %, 1 ^{er} mars 2033, série S	75 000	74 949	76 906
CI Financial Corp., 3,22 %, 22 juill. 2024	55 000	53 555	54 316
CI Financial Corp., 7,00 %, 2 déc. 2025	63 000	63 000	64 315
Ville de Montréal, 3,00 %, 1 ^{er} sept. 2027	133 000	137 409	129 781
Ville de Montréal, 6,00 %, 1 ^{er} juin 2043	57 000	79 666	69 759
Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} déc. 2036	80 000	80 450	72 198
Ville de Montréal, 3,00 %, 1 ^{er} sept. 2025	55 000	58 351	53 949
Ville de Montréal, 3,50 %, 1 ^{er} sept. 2024	75 000	77 872	74 327
Ville de Montréal, 4,10 %, 1 ^{er} déc. 2034	65 000	76 391	65 391
Ville de Montréal, 4,25 %, 1 ^{er} déc. 2032	55 000	61 600	56 443
Ville de Montréal, 2,30 %, 1 ^{er} sept. 2029	60 000	59 376	55 791
Ville de Montréal, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2038	134 000	142 349	123 541
Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} sept. 2028	105 000	110 571	102 649
Ville de Montréal, 1,75 %, 1 ^{er} sept. 2030	305 000	262 859	269 541
Ville de Montréal, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2026	45 000	47 897	43 749
Ville de Montréal, 2,40 %, 1 ^{er} déc. 2041	62 000	55 235	47 516
Ville de Montréal, 2,00 %, 1 ^{er} sept. 2031	81 000	74 423	71 333
Ville de Montréal, 4,70 %, 1 ^{er} déc. 2041	57 000	57 289	60 003
Ville de Montréal, 4,25 %, 1 ^{er} sept. 2033	71 000	66 414	72 671
Ville d'Ottawa, 3,25 %, 10 nov. 2047	30 000	23 485	25 430
Ville d'Ottawa, 4,20 %, 30 juill. 2053	45 000	53 074	45 055
Ville d'Ottawa, 3,10 %, 27 juill. 2048	48 000	49 862	39 473
Ville d'Ottawa, 4,60 %, 14 juill. 2042	60 000	68 869	62 422
Ville d'Ottawa, 2,50 %, 11 mai 2051	71 000	61 120	51 523
Ville d'Ottawa, 4,10 %, 6 déc. 2052	15 000	14 961	14 748
Ville de Toronto, 2,40 %, 7 juin 2027	100 000	102 589	95 903
Ville de Toronto, 3,25 %, 24 juin 2046	62 000	62 899	52 671
Ville de Toronto, 3,50 %, 2 juin 2036	85 000	95 859	80 288
Ville de Toronto, 5,20 %, 1 ^{er} juin 2040	60 000	80 358	66 904
Ville de Toronto, 3,80 %, 13 déc. 2042	45 000	48 002	42 159
Ville de Toronto, 4,15 %, 10 mars 2044	15 000	17 498	14 685
Ville de Toronto, 2,40 %, 24 juin 2026	35 000	35 705	33 772
Ville de Toronto, 2,65 %, 9 nov. 2029	65 000	67 768	61 832
Ville de Toronto, 4,70 %, 10 juin 2041	50 000	64 608	52 501
Ville de Toronto, 3,40 %, 21 mai 2024	20 000	21 418	19 880

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Ville de Toronto, 2,45 %, 6 févr. 2025	31 000	32 206	30 385
Ville de Toronto, 2,60 %, 24 sept. 2039	40 000	37 070	32 747
Ville de Toronto, 2,80 %, 22 nov. 2049	92 000	84 916	70 903
Ville de Toronto, 2,95 %, 28 avr. 2035	36 000	37 605	32 525
Ville de Toronto, 3,20 %, 1 ^{er} août 2048	25 000	26 378	20 909
Ville de Toronto, 2,15 %, 25 août 2040	64 000	56 970	48 262
Ville de Toronto, 1,60 %, 2 déc. 2030	12 000	11 305	10 521
Ville de Toronto, 2,90 %, 29 avr. 2051	70 000	70 194	55 230
Ville de Toronto, 2,85 %, 23 nov. 2041	25 000	23 314	20 545
Ville de Toronto, 3,25 %, 20 avr. 2032	39 000	38 323	37 606
Ville de Toronto, 4,30 %, 1 ^{er} juin 2052	88 000	87 367	89 092
Ville de Toronto, 4,55 %, 27 juill. 2042	33 000	32 992	34 061
Ville de Toronto, 4,40 %, 14 déc. 2042	57 000	56 313	57 793
Ville de Toronto, 4,25 %, 11 juill. 2033	200 000	190 784	206 344
Ville de Vancouver, 3,70 %, 18 oct. 2052	25 000	28 005	22 914
Ville de Winnipeg, 4,30 %, 15 nov. 2051	24 000	29 877	24 532
Ville de Winnipeg, 4,10 %, 1 ^{er} juin 2045	15 000	17 763	14 217
CNH Industrial Capital Canada Ltd., 1,50 %, 1 ^{er} oct. 2024	30 000	29 590	29 174
Services financiers Co-operators limitée, 3,33 %, 13 mai 2030	35 000	33 309	30 847
Coast Capital Savings Federal Credit Union, 4,25 %, 21 avr. 2025	15 000	14 613	14 673
Cogeco Communications, Inc., 2,99 %, 22 sept. 2031	75 000	69 378	65 527
Cogeco Communications, Inc., 5,30 %, 16 févr. 2033	51 000	51 000	51 825
Concordia University, 6,55 %, 2 sept. 2042, série A	20 000	28 971	25 022
Fonds de placement immobilier Crombie, 3,68 %, 26 août 2026, série F	25 000	25 458	24 179
Fonds de placement immobilier Crombie, 5,24 %, 28 sept. 2029	30 000	29 481	30 216
Crosslinx Transit Solutions GP, 4,65 %, 30 sept. 2046	62 697	65 860	58 993
Fiducie de placement immobilier CT, 3,53 %, 9 juin 2025, série B	70 000	69 212	68 293
Fiducie de placement immobilier CT, 3,29 %, 1 ^{er} juin 2026, série D	25 000	25 449	24 094
Fiducie de placement immobilier CT, 3,86 %, 7 déc. 2027, série F	25 000	26 749	24 012
Fiducie de placement immobilier CT, 3,03 %, 5 févr. 2029, série H	26 000	26 000	23 709
CU, Inc., 5,90 %, 20 nov. 2034	31 000	37 808	34 845
CU, Inc., 5,56 %, 30 oct. 2037	25 000	32 342	27 597
CU, Inc., 5,58 %, 26 mai 2038	20 000	25 798	22 072
CU, Inc., 4,54 %, 24 oct. 2041	80 000	89 022	80 338
CU, Inc., 3,81 %, 10 sept. 2042	64 000	66 080	58 390
CU, Inc., 3,86 %, 14 nov. 2052	25 000	26 261	22 708
CU, Inc., 4,72 %, 9 sept. 2043	165 000	167 176	169 643
CU, Inc., 4,08 %, 2 sept. 2044	161 000	173 706	152 105
CU, Inc., 3,76 %, 19 nov. 2046	40 000	46 497	35 937
CU, Inc., 3,55 %, 22 nov. 2047	50 000	52 229	43 246
CU, Inc., 3,96 %, 27 juill. 2045	50 000	53 201	46 368
CU, Inc., 3,95 %, 23 nov. 2048	45 000	50 223	41 487
CU, Inc., 4,21 %, 29 oct. 2055	30 000	30 698	28 824
CU, Inc., 4,59 %, 24 oct. 2061	10 000	11 818	10 231
CU, Inc., 3,82 %, 11 sept. 2062	40 000	36 722	35 221
CU, Inc., 4,56 %, 7 nov. 2053	25 000	31 665	25 556
CU, Inc., 2,96 %, 7 sept. 2049	105 000	97 610	81 324
CU, Inc., 3,17 %, 5 sept. 2051	63 000	63 293	50 563
CU, Inc., 4,09 %, 19 oct. 2054	15 000	16 266	14 182
CU, Inc., 4,77 %, 14 sept. 2052	22 000	22 000	23 198
CU, Inc., 5,09 %, 20 sept. 2053	100 000	98 428	110 810
Daimler Truck Finance Canada, Inc., 2,14 %, 13 déc. 2024	119 000	115 747	115 570
Daimler Truck Finance Canada, Inc., 2,46 %, 15 déc. 2026	41 000	40 759	38 564
Daimler Truck Finance Canada, Inc., 5,22 %, 20 sept. 2027	37 000	37 092	37 695
Société Financière Daimler Truck, Inc., 5,18 %, 19 sept. 2025	78 000	77 944	78 367
Dollarama, Inc., 1,51 %, 20 sept. 2027	45 000	41 398	40 820
Dollarama, Inc., 2,44 %, 9 juill. 2029	45 000	43 496	40 945
Dollarama, Inc., 1,87 %, 8 juill. 2026	51 000	47 722	48 041
Dollarama, Inc., 5,08 %, 27 oct. 2025	30 000	30 293	30 249
Dollarama, Inc., 5,16 %, 26 avr. 2030	75 000	73 700	77 930
Dollarama, Inc., 5,53 %, 26 sept. 2028	60 000	60 000	63 161
Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 1,66 %, 22 déc. 2025, série A	65 000	62 246	61 210
Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 2,06 %, 17 juin 2027, série C	62 000	58 161	56 439
Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 2,54 %, 7 déc. 2026, série D	53 000	50 382	49 633
Dream Summit Industrial LP, 2,15 %, 17 sept. 2025	45 000	41 459	42 935
Dream Summit Industrial LP, 1,82 %, 1 ^{er} avr. 2026	30 000	27 004	27 992
Dream Summit Industrial LP, 2,25 %, 12 janv. 2027	20 000	17 846	18 504
Dream Summit Industrial LP, 2,44 %, 14 juill. 2028	27 000	23 342	24 287
E.L. Financial Corp. Ltd., 4,00 %, 22 juin 2050	20 000	19 271	17 525
EllisDon Infrastructure SNH GP, 5,15 %, 31 août 2057	35 000	35 471	37 722
Emera, Inc., 4,84 %, 2 mai 2030	60 000	60 380	60 307

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, 2,02 %, 24 sept. 2031	51 000	47 094	46 819
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, 5,50 %, 13 janv. 2033	10 000	9 914	10 045
Enbridge Gas Inc., 4,95 %, 22 nov. 2050	40 000	48 339	42 335
Enbridge Gas Inc., 4,50 %, 23 nov. 2043	25 000	28 952	24 613
Enbridge Gas Inc., 4,00 %, 22 août 2044	60 000	63 803	55 115
Enbridge Gas Inc., 3,31 %, 11 sept. 2025	65 000	66 872	63 588
Enbridge Gas Inc., 2,50 %, 5 août 2026	40 000	40 259	38 277
Enbridge Gas Inc., 3,51 %, 29 nov. 2047	32 000	31 393	27 052
Enbridge Gas Inc., 4,20 %, 2 juin 2044, série 12	118 000	120 417	111 676
Enbridge Gas Inc., 3,19 %, 17 sept. 2025, série 13	20 000	20 959	19 508
Enbridge Gas Inc., 2,81 %, 1 ^{er} juin 2026	25 000	26 201	24 169
Enbridge Gas Inc., 6,05 %, 2 sept. 2038	31 000	42 598	35 657
Enbridge Gas Inc., 5,20 %, 23 juill. 2040	45 000	52 698	47 953
Enbridge Gas Inc., 4,88 %, 21 juin 2041	30 000	35 989	30 899
Enbridge Gas Inc., 2,88 %, 22 nov. 2027	40 000	41 689	38 256
Enbridge Gas Inc., 3,59 %, 22 nov. 2047	20 000	21 533	17 151
Enbridge Gas Inc., 3,80 %, 1 ^{er} juin 2046	31 000	33 733	27 591
Enbridge Gas Inc., 2,37 %, 9 août 2029	55 000	55 099	50 412
Enbridge Gas Inc., 3,01 %, 9 août 2049	25 000	23 705	19 177
Enbridge Gas Inc., 5,21 %, 25 févr. 2036	50 000	58 326	52 585
Enbridge Gas Inc., 2,90 %, 1 ^{er} avr. 2030	95 000	101 611	88 533
Enbridge Gas Inc., 3,65 %, 1 ^{er} avr. 2050	70 000	74 833	60 221
Enbridge Gas Inc., 3,15 %, 22 août 2024	30 000	29 159	29 610
Enbridge Gas Inc., 2,35 %, 15 sept. 2031	75 000	70 395	65 821
Enbridge Gas Inc., 3,20 %, 15 sept. 2051	74 000	65 127	58 390
Enbridge Gas Inc., 4,15 %, 17 août 2032	39 000	38 367	38 569
Enbridge Gas Inc., 4,55 %, 17 août 2052	43 000	42 725	42 898
Enbridge Gas Inc., 5,70 %, 6 oct. 2033	57 000	57 000	62 862
Enbridge Gas Inc., 5,46 %, 6 oct. 2028	75 000	76 787	79 500
Enbridge Gas Inc., 5,67 %, 6 oct. 2053	89 000	92 521	105 039
Pipelines Enbridge Inc., 5,35 %, 10 nov. 2039	30 000	32 827	30 386
Pipelines Enbridge Inc., 5,33 %, 6 avr. 2040	20 000	23 487	20 185
Pipelines Enbridge Inc., 3,45 %, 29 sept. 2025	100 000	105 440	97 934
Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 29 sept. 2045	130 000	117 337	119 128
Pipelines Enbridge Inc., 3,00 %, 10 août 2026	57 000	57 629	55 121
Pipelines Enbridge Inc., 4,13 %, 9 août 2046	49 000	48 811	42 049
Pipelines Enbridge Inc., 3,52 %, 22 févr. 2029	95 000	102 240	91 144
Pipelines Enbridge Inc., 4,33 %, 22 févr. 2049	75 000	75 909	65 950
Pipelines Enbridge Inc., 8,20 %, 15 févr. 2024, série K	24 000	25 275	24 068
Pipelines Enbridge Inc., 4,55 %, 17 août 2043	30 000	31 817	27 547
Pipelines Enbridge Inc., 2,82 %, 12 mai 2031	49 000	48 227	43 825
Pipelines Enbridge Inc., 4,20 %, 12 mai 2051	45 000	46 209	38 537
Pipelines Enbridge Inc., 5,82 %, 17 août 2053	50 000	49 979	54 705
Enbridge Inc., 7,20 %, 18 juin 2032	21 000	25 974	23 410
Enbridge Inc., 5,75 %, 2 sept. 2039	30 000	36 069	31 280
Enbridge Inc., 4,24 %, 27 août 2042	80 000	78 100	69 957
Enbridge Inc., 4,57 %, 11 mars 2044	195 000	181 287	177 000
Enbridge Inc., 3,20 %, 8 juin 2027	180 000	182 762	172 994
Enbridge Inc., 3,95 %, 19 nov. 2024	123 000	124 712	121 593
Enbridge Inc., 4,87 %, 21 nov. 2044	30 000	30 624	28 471
Enbridge Inc., 2,99 %, 3 oct. 2029	140 000	137 487	129 514
Enbridge Inc., 2,44 %, 2 juin 2025	68 000	68 561	65 798
Enbridge Inc., 3,10 %, 21 sept. 2033	241 000	210 257	208 352
Enbridge Inc., 4,10 %, 21 sept. 2051	42 000	40 773	35 010
Enbridge Inc., 6,10 %, 9 nov. 2032	115 000	119 780	125 215
Enbridge Inc., 6,51 %, 9 nov. 2052	60 000	63 500	71 278
Enbridge Inc., 5,70 %, 9 nov. 2027	85 000	87 640	88 590
Enbridge Inc., 5,36 %, 26 mai 2033	50 000	49 992	51 819
Enbridge Inc., 4,90 %, 26 mai 2028	89 000	88 665	90 566
Enbridge Inc., 5,76 %, 26 mai 2053	50 000	49 978	53 988
Énergir LP, 3,04 %, 9 févr. 2032, série 2022-1	40 000	38 588	36 648
Énergir LP, 4,67 %, 27 sept. 2032	25 000	25 033	25 591
Énergir LP, 4,83 %, 2 juin 2053	50 000	49 435	53 226
Énergir Inc., 3,53 %, 16 mai 2047, série L	25 000	25 802	21 587
Énergir Inc., 2,10 %, 16 avr. 2027, série V	35 000	35 238	32 844
ENMAX Corp., 3,81 %, 5 déc. 2024	25 000	27 414	24 592
ENMAX Corp., 3,84 %, 5 juin 2028, série 4	39 000	41 312	37 568
ENMAX Corp., 3,33 %, 2 juin 2025, série 6	58 000	56 379	56 327
ENMAX Corp., 3,88 %, 18 oct. 2029	30 000	31 747	28 467
EPCOR Utilities Inc., 6,65 %, 15 avr. 2038	15 000	21 505	18 346
EPCOR Utilities Inc., 5,75 %, 24 nov. 2039	25 000	33 339	28 485
EPCOR Utilities Inc., 4,55 %, 28 févr. 2042	35 000	41 136	35 293
EPCOR Utilities Inc., 3,55 %, 27 nov. 2047	45 000	46 382	39 114
EPCOR Utilities Inc., 3,95 %, 26 nov. 2048	30 000	32 780	27 768
EPCOR Utilities Inc., 3,11 %, 8 juill. 2049	50 000	47 736	39 926
EPCOR Utilities Inc., 2,90 %, 19 mai 2050	50 000	40 992	38 197
EPCOR Utilities Inc., 3,29 %, 28 juin 2051	17 000	17 306	13 955
EPCOR Utilities Inc., 2,41 %, 30 juin 2031	31 000	30 575	27 540
EPCOR Utilities Inc., 5,65 %, 16 nov. 2035	35 000	40 478	38 862
EPCOR Utilities Inc., 4,72 %, 2 sept. 2052	58 000	58 123	60 820
EPCOR Utilities Inc., 5,33 %, 3 oct. 2053	75 000	78 509	86 122
Banque Équitable, 1,88 %, 26 nov. 2025	30 000	27 095	28 136
Banque Équitable, 1,94 %, 10 mars 2025	50 000	48 106	47 911
Banque Équitable, 3,36 %, 2 mars 2026	35 000	34 126	33 653
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	147 000	148 231	147 071
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,70 %, 16 déc. 2026	70 000	73 576	70 056

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 déc. 2027	65 000	68 064	64 169
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,23 %, 14 juin 2029	50 000	53 228	48 864
Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,95 %, 3 mars 2031	78 000	78 995	73 475
Federated Co-Operatives Ltd., 3,92 %, 17 juin 2025	30 000	29 405	29 283
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 2,86 %, 26 mai 2030	155 000	155 408	149 842
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 1,09 %, 21 janv. 2026	220 000	204 498	205 462
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 1,99 %, 28 mai 2031	124 000	119 896	115 613
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 1,59 %, 10 sept. 2026	83 000	77 209	77 422
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 4,41 %, 19 mai 2027	126 000	125 426	125 709
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,03 %, 23 août 2032	130 000	128 378	130 006
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,20 %, 1 ^{er} oct. 2025	130 000	130 760	130 950
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,47 %, 16 août 2028	125 000	123 947	130 316
Fédération des caisses Desjardins du Québec, 5,47 %, 17 nov. 2028	200 000	201 400	208 586
Finning International, Inc., 4,44 %, 16 mai 2028	65 000	63 102	64 782
First Capital Real Estate Investment Trust, 4,32 %, 31 juill. 2025, série S	50 000	53 345	49 001
First Capital Real Estate Investment Trust, 3,60 %, 6 mai 2026, série T	51 000	51 338	48 984
First Capital Real Estate Investment Trust, 3,75 %, 12 juill. 2027, série U	40 000	40 279	37 708
First Capital Real Estate Investment Trust, 3,46 %, 22 janv. 2027	20 000	18 159	18 861
First Capital Real Estate Investment Trust, 3,45 %, 1 ^{er} mars 2028, série A	20 000	20 417	18 370
First National Financial Corp., 3,58 %, 25 nov. 2024	25 000	24 301	24 464
First National Financial Corp., 2,96 %, 17 nov. 2025	20 000	18 407	18 927
Administration financière des Premières Nations, 1,71 %, 16 juin 2030	59 000	54 592	52 423
Administration financière des Premières Nations, 3,40 %, 26 juin 2024	30 000	29 826	29 772
Administration financière des Premières Nations, 2,85 %, 1 ^{er} juin 2032	38 000	36 989	35 418
Compagnie Crédit Ford du Canada, 2,96 %, 6 sept. 2026	130 000	121 207	122 556
Compagnie Crédit Ford du Canada, 7,37 %, 12 mai 2026	100 000	102 411	104 245
Compagnie Crédit Ford du Canada, 7,00 %, 10 févr. 2026	100 000	101 428	103 034
Fortis Inc., 6,51 %, 4 juill. 2039	15 000	20 392	17 732
Fortis Inc., 2,18 %, 15 mai 2028	72 000	69 638	66 230
Fortis Inc., 4,43 %, 31 mai 2029	66 000	66 011	66 145
Fortis Inc., 5,68 %, 8 nov. 2033	70 000	70 000	75 717
FortisAlberta, Inc., 3,67 %, 9 sept. 2047, série 17-1	30 000	35 225	26 340
FortisAlberta, Inc., 6,22 %, 31 oct. 2034, série 04-2	25 000	31 281	28 676
FortisAlberta, Inc., 4,86 %, 26 mai 2053	50 000	49 159	53 357
FortisBC Energy, Inc., 6,00 %, 2 oct. 2037	35 000	44 754	39 743
FortisBC Energy, Inc., 5,80 %, 13 mai 2038	30 000	39 631	33 759
FortisBC Energy, Inc., 6,05 %, 15 févr. 2038	25 000	32 954	28 704
FortisBC Energy, Inc., 3,85 %, 7 déc. 2048	25 000	30 543	22 717
FortisBC Energy, Inc., 2,82 %, 9 août 2049	45 000	42 513	33 813
FortisBC Energy, Inc., 2,54 %, 13 juill. 2050	15 000	12 482	10 542
FortisBC, Inc., 4,00 %, 28 oct. 2044	45 000	42 939	40 837
Société de financement GE Capital du Canada, 5,73 %, 22 oct. 2037	22 000	25 575	22 942
Financière General Motors du Canada Ltée, 5,95 %, 14 mai 2024	45 000	50 341	45 071
Financière General Motors du Canada Ltée, 1,75 %, 15 avr. 2026	50 000	49 049	46 730
Financière General Motors du Canada Ltée, 1,70 %, 9 juill. 2025	56 000	53 714	53 282
Financière General Motors du Canada Ltée, 3,15 %, 8 févr. 2027	59 000	58 340	56 127
Financière General Motors du Canada Ltée, 5,20 %, 9 févr. 2028	60 000	59 329	60 695
George Weston Ltée, 4,11 %, 17 juin 2024	35 000	36 477	34 788
Gibson Energy Inc., 3,60 %, 17 sept. 2029	100 000	88 062	94 345
Gibson Energy Inc., 2,45 %, 14 juill. 2025	50 000	47 907	48 227
Gibson Energy Inc., 6,20 %, 12 juill. 2053	30 000	29 968	33 590
Gibson Energy Inc., 5,75 %, 12 juill. 2033	60 000	59 977	63 215
Granite REIT Holdings LP, 3,06 %, 4 juin 2027, série 4	85 000	84 691	80 517
Granite REIT Holdings LP, 2,38 %, 18 déc. 2030, série 5	65 000	60 701	55 271
Granite REIT Holdings LP, 2,19 %, 30 août 2028, série 6	76 000	71 924	67 856
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 6,45 %, 3 déc. 2027, série 1997-3	40 000	48 952	43 293
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 7,05 %, 12 juin 2030, série 2000-1	62 000	80 239	71 498

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 7,10 %, 4 juin 2031, série 2001-1	56 000	75 501	65 712
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 6,98 %, 15 oct. 2032, série 2002-3	74 000	95 680	88 127
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 6,47 %, 2 févr. 2034, série 2004-1	65 000	85 176	76 039
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 5,30 %, 25 févr. 2041	82 000	98 287	91 286
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 5,30 %, 25 févr. 2041, série 2011-2	45 000	53 439	45 978
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 3,26 %, 1 ^{er} juin 2037	65 000	64 419	58 047
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 5,63 %, 7 juin 2040, série 2010-1	50 000	67 339	57 403
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 2,73 %, 3 avr. 2029, série 2019-1	100 000	108 016	94 846
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 2,75 %, 17 oct. 2039, série 19-2	185 000	160 830	151 376
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 1,54 %, 3 mai 2028, série 2020-1	70 000	66 108	63 701
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 3,15 %, 5 oct. 2051	100 000	77 937	82 217
Great-West Lifeco, Inc., 6,74 %, 24 nov. 2031	15 000	20 116	17 164
Great-West Lifeco, Inc., 6,67 %, 21 mars 2033	65 000	82 279	74 947
Great-West Lifeco, Inc., 6,00 %, 16 nov. 2039	40 000	53 985	45 899
Great-West Lifeco, Inc., 3,34 %, 28 févr. 2028	65 000	67 764	62 850
Great-West Lifeco, Inc., 2,38 %, 14 mai 2030	150 000	137 933	135 099
Great-West Lifeco Inc., 2,98 %, 8 juill. 2050	65 000	57 489	50 481
Fonds de placement immobilier H&R, 3,37 %, 30 janv. 2024	40 000	39 951	39 932
Fonds de placement immobilier H&R, 4,07 %, 16 juin 2025	70 000	71 521	68 379
Fonds de placement immobilier H&R, 2,91 %, 2 juin 2026	45 000	43 575	42 426
Fonds de placement immobilier H&R, 2,63 %, 19 févr. 2027	35 000	34 385	32 230
HCN Canadian Holdings-1 LP, 2,95 %, 15 janv. 2027	40 000	39 182	37 182
Société en commandite Santé Montréal Collectif, 6,72 %, 30 sept. 2049	134 086	169 833	153 222
Home Trust Co., 5,32 %, 13 juin 2024	25 000	24 714	24 871
Honda Canada Finance Inc., 3,44 %, 23 mai 2025	55 000	58 267	54 062
Honda Canada Finance Inc., 1,34 %, 17 mars 2026	55 000	53 544	51 431
Honda Canada Finance Inc., 1,65 %, 25 févr. 2028	80 000	75 587	71 917
Honda Canada Finance Inc., 1,71 %, 28 sept. 2026	42 000	41 177	39 219
Honda Canada Finance Inc., 4,87 %, 23 sept. 2027	60 000	60 213	61 022
Honda Canada Finance Inc., 5,73 %, 28 sept. 2028	50 000	50 000	52 933
Hospital Infrastructure Partners NOH Partnership, 5,44 %, 31 janv. 2045, série A	36 954	44 723	38 313
Banque HSBC Canada, 1,78 %, 20 mai 2026	187 000	180 297	174 987
Banque HSBC Canada, 3,40 %, 24 mars 2025	154 000	153 104	151 231
Banque HSBC Canada, 4,81 %, 16 déc. 2024	233 000	231 891	232 441
Hydro One Ltd., 1,41 %, 15 oct. 2027	55 000	53 069	50 180
Hydro One Inc., 6,93 %, 1 ^{er} juin 2032	62 000	83 371	73 05 ^{er}
Hydro One Inc., 6,35 %, 31 janv. 2034, série 4	58 000	74 156	67 223
Hydro One Inc., 5,36 %, 20 mai 2036	175 000	191 199	190 136
Hydro One Inc., 4,89 %, 13 mars 2037	55 000	62 592	57 080
Hydro One Inc., 6,03 %, 3 mars 2039, série 17	35 000	45 909	40 787
Hydro One Inc., 5,49 %, 16 juill. 2040, série 18	55 000	71 323	61 274
Hydro One Inc., 4,39 %, 26 sept. 2041, série 23	35 000	40 533	34 527
Hydro One Inc., 4,00 %, 22 déc. 2051, série 24	55 000	52 948	51 342
Hydro One Inc., 3,79 %, 31 juill. 2062, série 26	11 000	10 836	9 621
Hydro One Inc., 4,59 %, 9 oct. 2043, série 29	145 000	141 779	146 966
Hydro One Inc., 4,17 %, 6 juin 2044, série 32	50 000	54 632	47 915
Hydro One Inc., 2,77 %, 24 févr. 2026, série 35	160 000	156 586	155 469
Hydro One Inc., 3,91 %, 23 févr. 2046, série 36	50 000	52 597	46 043
Hydro One Inc., 3,72 %, 18 nov. 2047, série 38	58 000	61 438	51 724
Hydro One Inc., 2,97 %, 26 juin 2025, série 40	54 000	56 112	52 835
Hydro One Inc., 3,63 %, 25 juin 2049, série 41	110 000	112 696	96 584
Hydro One Inc., 7,35 %, 3 juin 2030, série 3	65 000	80 206	76 002
Hydro One Inc., 5,00 %, 19 oct. 2046, série 11	30 000	39 477	32 174
Hydro One Inc., 3,02 %, 5 avr. 2029, série 43	85 000	87 542	81 523
Hydro One Inc., 3,64 %, 5 avr. 2050	30 000	32 109	26 353
Hydro One Inc., 1,76 %, 28 févr. 2025, série 45	145 000	139 443	140 361
Hydro One Inc., 2,16 %, 28 févr. 2030, série 46	50 000	48 256	45 134
Hydro One Inc., 2,71 %, 28 févr. 2050, série 47	115 000	100 003	84 696
Hydro One Inc., 1,69 %, 16 janv. 2031	65 000	62 419	55 975
Hydro One Inc., 2,23 %, 17 sept. 2031	51 000	49 680	44 910
Hydro One Inc., 3,10 %, 15 sept. 2051	62 000	54 685	48 980
Hydro One Inc., 6,59 %, 22 avr. 2043	25 000	36 273	31 735
Hydro One Inc., 4,91 %, 27 janv. 2028, série 52	190 000	189 019	196 367
Hydro One Inc., 3,93 %, 30 nov. 2029	29 000	28 996	29 025
Hydro One Inc., 4,16 %, 27 janv. 2033	94 000	90 056	94 140
Hydro One Inc., 4,46 %, 27 janv. 2053	95 000	87 135	95 593
Hydro Ottawa Holding Inc., 2,61 %, 3 févr. 2025	25 000	23 975	24 365
Hyundai Capital Canada Inc., 2,01 %, 12 mai 2026	75 000	70 704	70 651
Hyundai Capital Canada Inc., 3,20 %, 16 févr. 2027	64 000	63 190	61 292
Hyundai Capital Canada Inc., 5,56 %, 8 mars 2028	60 000	60 530	61 677
iA Société financière inc., 3,07 %, 24 sept. 2031	75 000	74 320	71 389
iA Société financière inc., 2,40 %, 21 févr. 2030	70 000	69 448	67 718

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
iA Société financière inc., 3,19 %, 25 févr. 2032	37 000	35 962	35 165
iA Société financière inc., 5,68 %, 20 juin 2033	50 000	50 000	51 428
Société financière IGM Inc., 6,00 %, 10 déc. 2040	20 000	26 439	22 563
Société financière IGM Inc., 3,44 %, 26 janv. 2027	85 000	93 214	81 942
Société financière IGM Inc., 4,56 %, 25 janv. 2047	22 000	24 710	21 140
Société financière IGM Inc., 4,11 %, 9 déc. 2047	30 000	29 901	27 041
Société financière IGM Inc., 4,17 %, 13 juill. 2048	25 000	27 314	22 735
Société financière IGM Inc., 4,21 %, 21 mars 2050	25 000	25 730	22 731
Société financière IGM Inc., 5,43 %, 26 mai 2053	50 000	51 228	55 441
L'Ordre Indépendant des Forestiers, 2,89 %, 15 oct. 2035	37 000	35 075	31 518
InPower BC General Partnership, 4,47 %, 31 mars 2033	18 989	20 083	18 577
Intact Corporation Financière, 6,40 %, 23 nov. 2039	30 000	39 093	35 702
Intact Corporation Financière, 5,16 %, 16 juin 2042	30 000	36 723	31 888
Intact Corporation Financière, 3,77 %, 2 mars 2026	25 000	26 729	24 649
Intact Corporation Financière, 2,85 %, 7 juin 2027	55 000	56 785	52 515
Intact Corporation Financière, 3,69 %, 24 mars 2025	35 000	37 538	34 510
Intact Corporation Financière, 1,93 %, 16 déc. 2030	35 000	32 688	29 969
Intact Corporation Financière, 2,95 %, 16 déc. 2050	50 000	41 245	38 423
Intact Corporation Financière, 2,18 %, 18 mai 2028	60 000	56 895	55 135
Intact Corporation Financière, 3,77 %, 20 mai 2053	25 000	26 177	22 047
Intact Corporation Financière, 5,28 %, 14 sept. 2054	50 000	49 806	56 589
Inter Pipeline Ltd., 6,38 %, 17 févr. 2033	60 000	63 930	63 763
Inter Pipeline Ltd., 5,76 %, 17 févr. 2028	100 000	103 200	103 244
Inter Pipeline Ltd., 5,71 %, 29 mai 2030	100 000	99 711	102 667
Inter Pipeline Ltd., 6,59 %, 9 févr. 2034	155 000	154 940	166 834
Inter Pipeline Ltd./AB, 4,64 %, 30 mai 2044, série 5	65 000	61 929	56 142
Inter Pipeline Ltd./AB, 3,17 %, 24 mars 2025	35 000	36 437	34 199
Inter Pipeline Ltd./AB, 3,48 %, 16 déc. 2026	72 000	72 780	70 481
Inter Pipeline Ltd./AB, 4,23 %, 1 ^{er} juin 2027	110 000	115 100	108 140
Inter Pipeline Ltd./AB, 3,98 %, 25 nov. 2031	102 000	97 751	93 073
Inter Pipeline Ltd./AB, 5,09 %, 27 nov. 2051	30 000	29 980	27 190
Inter Pipeline Ltd./AB, 5,85 %, 18 mai 2032	70 000	70 247	71 891
Banque internationale pour la reconstruction et le développement, 1,20 %, 22 juill. 2026	27 000	26 944	25 272
Ivanhoe Cambridge II Inc., 2,30 %, 12 déc. 2024	50 000	50 779	48 738
John Deere Financial, Inc., 2,40 %, 17 sept. 2024	30 000	31 168	29 462
John Deere Financial, Inc., 2,58 %, 16 oct. 2026	40 000	40 578	38 363
John Deere Financial, Inc., 2,41 %, 14 janv. 2025	50 000	52 037	48 715
John Deere Financial, Inc., 1,34 %, 8 sept. 2027	40 000	37 563	36 213
John Deere Financial, Inc., 1,63 %, 9 avr. 2026	40 000	38 520	37 778
John Deere Financial, Inc., 2,31 %, 20 juin 2025	34 000	33 992	32 913
John Deere Financial, Inc., 2,81 %, 19 janv. 2029	21 000	20 990	19 946
John Deere Financial, Inc., 4,95 %, 14 juin 2027	75 000	75 099	76 857
John Deere Financial, Inc., 5,17 %, 15 sept. 2028	125 000	123 695	130 784
Keyera Corp., 3,93 %, 21 juin 2028	90 000	89 164	87 572
Keyera Corp., 3,96 %, 29 mai 2030	40 000	43 091	38 057
Keyera Corp., 5,02 %, 28 mars 2032	43 000	42 436	43 132
Banque Laurentienne du Canada, 1,60 %, 6 mai 2026	25 000	24 928	23 493
Banque Laurentienne du Canada, 1,95 %, 17 mars 2025	72 000	69 802	69 053
Banque Laurentienne du Canada, 3,55 %, 20 avr. 2027	42 000	42 000	41 033
Banque Laurentienne du Canada, 4,60 %, 2 sept. 2025	61 000	60 265	60 316
Liberty Utilities Canada LP, 3,32 %, 14 févr. 2050	20 000	19 034	15 502
Les Compagnies Loblaw limitée, 5,90 %, 18 janv. 2036	20 000	25 074	21 668
Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	45 000	48 232	44 735
Les Compagnies Loblaw limitée, 4,49 %, 11 déc. 2028	50 000	60 207	50 594
Les Compagnies Loblaw limitée, 2,28 %, 7 mai 2030	45 000	43 833	40 013
Les Compagnies Loblaw limitée, 5,01 %, 13 sept. 2032	42 000	42 000	43 573
Les Compagnies Loblaw limitée, 5,34 %, 13 sept. 2052	60 000	60 496	65 269
Lower Mattagami Energy LP, 5,14 %, 18 mai 2041, série 2011-4	25 000	32 672	27 218
Lower Mattagami Energy LP, 4,18 %, 23 févr. 2046, série 2013-1	30 000	34 765	29 007
Lower Mattagami Energy LP, 4,94 %, 21 sept. 2043	40 000	48 536	42 883
Lower Mattagami Energy LP, 3,42 %, 20 juin 2024, série 2014-1	25 000	24 834	24 793
Lower Mattagami Energy LP, 2,31 %, 21 oct. 2026, série 16-1	35 000	34 790	33 228
Lower Mattagami Energy LP, 2,43 %, 14 mai 2031, série 2021-1	58 000	57 705	51 827
Lower Mattagami Energy LP, 4,85 %, 31 oct. 2033	25 000	26 485	26 246
Lower Mattagami Energy LP, 4,17 %, 23 avr. 2052	40 000	36 850	38 666
Banque Manuvie du Canada, 2,38 %, 19 nov. 2024	80 000	80 269	78 140
Banque Manuvie du Canada, 1,50 %, 25 juin 2025	75 000	73 191	71 683
Banque Manuvie du Canada, 1,34 %, 26 févr. 2026	60 000	58 217	56 378
Banque Manuvie du Canada, 1,54 %, 14 sept. 2026	100 000	93 331	93 114
Banque Manuvie du Canada, 2,86 %, 16 févr. 2027	39 000	39 000	37 337
Manulife Finance Delaware LP, 5,06 %, 15 déc. 2041	100 000	109 864	99 438
Société Financière Manuvie, 3,05 %, 20 août 2029	102 000	104 299	100 358

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Société Financière Manuvie, 2,24 %, 12 mai 2030	130 000	129 756	125 008
Société Financière Manuvie, 2,82 %, 13 mai 2035	150 000	144 806	133 470
Société Financière Manuvie, 5,41 %, 10 mars 2033	200 000	197 956	204 230
Maritime Link Financing Trust, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2052	48 185	54 444	46 081
MCAP Commercial LP, 3,38 %, 26 nov. 2027	45 000	42 621	40 796
Mercedes-Benz Finance Canada Inc., 1,65 %, 22 sept. 2025	55 000	54 017	52 412
Mercedes-Benz Finance Canada Inc., 5,14 %, 29 juin 2026	75 000	74 080	76 271
Metro, Inc., 5,03 %, 1 ^{er} déc. 2044, série D	35 000	41 419	35 965
Metro, Inc., 3,39 %, 6 déc. 2027, série G	91 000	94 276	88 572
Metro, Inc., 4,27 %, 4 déc. 2047, série H	60 000	61 653	55 577
Metro Inc., 5,97 %, 15 oct. 2035, série B	45 000	53 210	49 781
Metro, Inc., 3,41 %, 28 fév. 2050, série I	45 000	40 405	35 977
Metro, Inc., 1,92 %, 2 déc. 2024, série J	34 000	33 431	33 057
Metro, Inc., 4,66 %, 7 fév. 2033	55 000	54 021	55 646
Banque Nationale du Canada, 2,58 %, 3 fév. 2025	187 000	186 051	181 949
Banque Nationale du Canada, 1,57 %, 18 août 2026	85 000	83 697	80 831
Banque Nationale du Canada, 1,53 %, 15 juin 2026	83 000	80 755	77 573
Banque Nationale du Canada, 2,24 %, 4 nov. 2026	118 000	115 817	111 168
Banque Nationale du Canada, 5,43 %, 16 août 2032	102 000	101 108	103 159
Banque Nationale du Canada, 5,30 %, 3 nov. 2025	140 000	140 024	141 337
Banque Nationale du Canada, 5,22 %, 14 juin 2028	221 000	220 457	227 601
Banque Nationale du Canada, 5,02 %, 1 ^{er} fév. 2029	78 000	77 991	79 892
NAV Canada, 3,53 %, 23 fév. 2046, série 2016-1	19 000	19 197	16 982
NAV Canada, 3,29 %, 30 mars 2048, série 2018-1	50 000	47 092	42 352
NAV Canada, 3,21 %, 29 sept. 2050, série 2019-1	25 000	26 282	20 771
NAV Canada, 2,06 %, 29 mai 2030	45 000	42 843	40 217
NAV Canada, 2,92 %, 29 sept. 2051	75 000	70 174	59 253
NAV Canada, 0,94 %, 9 fév. 2026	40 000	39 164	37 440
NAV Canada, 0,56 %, 9 fév. 2024, série 2021-2	20 000	19 843	19 906
Nissan Canada Inc., 2,10 %, 22 sept. 2025	80 000	77 247	75 899
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 3,20 %, 22 juill. 2024, série A	55 000	56 716	54 359
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,05 %, 22 juill. 2044, série B	145 000	141 274	132 688
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 3,70 %, 23 fév. 2043, série D	65 000	63 081	56 662
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 3,20 %, 24 avr. 2026	85 000	85 856	82 818
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,25 %, 1 ^{er} juin 2029, série F	72 000	78 526	71 960
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,75 %, 1 ^{er} juin 2037, série G	80 000	86 343	80 990
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,15 %, 1 ^{er} juin 2033, série H	50 000	54 847	48 659
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 4,35 %, 10 janv. 2039, série I	60 000	64 495	57 607
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 2,80 %, 1 ^{er} juin 2027, série J	151 000	150 716	144 030
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 3,65 %, 1 ^{er} juin 2035, série K	120 000	115 794	110 224
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 2,00 %, 1 ^{er} déc. 2026	61 000	59 024	57 214
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 2,80 %, 1 ^{er} juin 2031	157 000	148 010	140 824
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., 3,75 %, 1 ^{er} juin 2051	68 000	67 233	58 696
Nova Scotia Power Inc., 6,95 %, 25 août 2033	20 000	27 418	22 992
Nova Scotia Power Inc., 5,95 %, 27 juill. 2039	20 000	26 979	21 962
Nova Scotia Power Inc., 5,61 %, 15 juin 2040	25 000	33 011	26 603
Nova Scotia Power Inc., 4,15 %, 6 mars 2042	25 000	27 974	22 401
Nova Scotia Power Inc., 4,50 %, 20 juill. 2043	35 000	40 462	32 838
Nova Scotia Power Inc., 3,57 %, 5 avr. 2049, série AB	65 000	63 414	52 097
Nova Scotia Power Inc., 3,31 %, 25 avr. 2050	35 000	33 827	26 509
Nova Scotia Power Inc., 4,95 %, 15 nov. 2032	50 000	51 338	50 561
Nova Scotia Power Inc., 5,35 %, 24 mars 2053	35 000	36 794	36 937
OMERS Finance Trust, 2,60 %, 14 mai 2029	110 000	110 000	104 108
OMERS Finance Trust, 1,55 %, 21 avr. 2027	140 000	135 643	130 344
OMERS Finance Trust, 2,60 %, 14 mai 2029	25 000	27 346	23 688
OMERS Realty Corp., 3,33 %, 12 nov. 2024	70 000	70 867	68 969
OMERS Realty Corp., 3,24 %, 4 oct. 2027, série 9	93 000	99 268	89 379
OMERS Realty Corp., 3,33 %, 5 juin 2025, série 10	25 000	26 595	24 334
OMERS Realty Corp., 3,63 %, 5 juin 2030, série 11	102 000	104 177	97 117
OMERS Realty Corp., 5,38 %, 14 nov. 2028, série 13	70 000	71 875	72 855
Ontario Power Generation Inc., 3,32 %, 4 oct. 2027	60 000	62 983	58 256
Ontario Power Generation Inc., 3,84 %, 22 juin 2048	100 000	90 196	89 159
Ontario Power Generation Inc., 4,25 %, 18 janv. 2049	47 000	53 163	44 725
Ontario Power Generation Inc., 2,98 %, 13 sept. 2029	75 000	74 659	70 657
Ontario Power Generation Inc., 3,65 %, 13 sept. 2050	40 000	41 316	34 335
Ontario Power Generation Inc., 2,89 %, 8 avr. 2025	45 000	46 905	43 972
Ontario Power Generation Inc., 3,22 %, 8 avr. 2030	130 000	135 579	122 807
Ontario Power Generation Inc., 1,17 %, 22 avr. 2026	72 000	67 304	67 040
Ontario Power Generation Inc., 2,95 %, 21 fév. 2051	55 000	52 136	41 094

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Ontario Power Generation Inc., 4,92 %, 19 juill. 2032	40 000	39 820	41 588
Ontario Teachers' Finance Trust, 1,10 %, 19 oct. 2027	195 000	177 518	177 130
Ontario Teachers' Finance Trust, 1,10 %, 19 oct. 2027	30 000	29 766	27 236
Ontario Teachers' Finance Trust, 4,45 %, 2 juin 2032	98 000	97 693	102 081
Ontario Teachers' Finance Trust, 4,15 %, 1 ^{er} nov. 2029	103 000	102 945	105 583
OPB Finance Trust, 2,98 %, 25 janv. 2027, série F	80 000	84 149	77 795
OPB Finance Trust, 3,89 %, 4 juill. 2042	41 000	45 495	38 783
OPB Finance Trust, 2,95 %, 2 fév. 2026, série E	30 000	30 887	29 267
Original Wempi, Inc., 7,79 %, 4 oct. 2027	177 000	179 336	187 170
Administration de l'aéroport international Macdonald-Cartier d'Ottawa, 3,93 %, 9 juin 2045, série E	45 568	44 274	41 474
Pembina Pipeline Corp., 4,75 %, 30 avr. 2043	50 000	51 941	45 755
Pembina Pipeline Corp., 4,81 %, 25 mars 2044, série 4	185 000	165 481	170 864
Pembina Pipeline Corp., 3,54 %, 3 fév. 2025, série 5	70 000	71 413	68 752
Pembina Pipeline Corp., 4,24 %, 15 juin 2027	55 000	59 344	54 528
Pembina Pipeline Corp., 3,71 %, 11 août 2026, série 7	112 000	113 206	109 778
Pembina Pipeline Corp., 2,99 %, 22 janv. 2024, série 8	75 000	77 387	74 901
Pembina Pipeline Corp., 4,74 %, 21 janv. 2047	60 000	61 468	54 535
Pembina Pipeline Corp., 4,02 %, 27 mars 2028, série 10	90 000	97 114	88 047
Pembina Pipeline Corp., 4,75 %, 26 mars 2048, série 11	95 000	98 801	86 350
Pembina Pipeline Corp., 3,62 %, 3 avr. 2029	95 000	97 542	90 590
Pembina Pipeline Corp., 4,54 %, 3 avr. 2049, série 13	80 000	81 005	70 377
Pembina Pipeline Corp., 3,31 %, 1 ^{er} fév. 2030, série 15	128 000	120 894	118 743
Pembina Pipeline Corp., 4,67 %, 28 mai 2050, série 16	45 000	44 961	40 202
Pembina Pipeline Corp., 3,53 %, 10 déc. 2031, série 17	81 000	77 532	73 977
Pembina Pipeline Corp., 4,49 %, 10 déc. 2051, série 18	80 000	75 814	69 265
Pembina Pipeline Corp., 5,72 %, 22 juin 2026, série 19	52 000	51 989	52 124
Location de camions Penske Canada Inc., 5,44 %, 8 déc. 2025	54 000	54 433	54 501
Plenary Properties LTAP LP, 6,29 %, 31 janv. 2044	80 009	101 041	89 702
Power Corporation du Canada, 4,45 %, 27 juill. 2048	30 000	34 625	28 942
Power Corporation du Canada, 4,81 %, 31 janv. 2047	35 000	39 657	35 382
Corporation Financière Power, 6,90 %, 11 mars 2033	11 000	14 192	12 608
Fiducie de placement immobilier Primaris, 4,27 %, 30 mars 2025	23 000	22 198	22 547
Fiducie de placement immobilier Primaris, 5,93 %, 29 mars 2028	33 000	32 350	33 630
Municipalité régionale de Peel, 3,85 %, 30 oct. 2042	20 000	22 897	18 844
Municipalité régionale de Peel, 5,10 %, 29 juin 2040	42 000	56 441	46 226
Municipalité régionale de Peel, 2,50 %, 16 juin 2051	44 000	39 654	31 841
Municipalité régionale de Peel, 4,25 %, 2 déc. 2033	25 000	24 137	25 748
Municipalité régionale de York, 4,00 %, 31 mai 2032	37 000	42 690	37 607
Municipalité régionale de York, 2,65 %, 18 avr. 2029	45 000	47 610	43 035
Municipalité régionale de York, 3,65 %, 13 mai 2033	40 000	44 633	39 394
Municipalité régionale de York, 4,05 %, 1 ^{er} mai, 2034	48 000	55 449	48 624
Municipalité régionale de York, 1,70 %, 27 mai 2030	45 000	43 852	40 098
Municipalité régionale de York, 2,60 %, 15 déc. 2025	40 000	41 096	38 888
Municipalité régionale de York, 2,15 %, 22 juin 2031	35 000	34 943	31 498
Municipalité régionale de York, 2,50 %, 2 juin 2026	40 000	40 245	38 718
Reliance LP, 3,84 %, 15 mars 2025	52 000	54 766	51 107
Reliance LP, 3,75 %, 15 mars 2026	50 000	50 519	48 710
Reliance LP, 2,68 %, 1 ^{er} déc. 2027	50 000	49 605	45 914
Reliance LP, 2,67 %, 1 ^{er} août 2028	65 000	61 748	58 729
RioCan Real Estate Investment Trust, 2,58 %, 12 fév. 2025, série AB	66 000	66 099	64 067
RioCan Real Estate Investment Trust, 2,36 %, 10 mars 2027	50 000	48 818	45 979
RioCan Real Estate Investment Trust, 1,97 %, 15 juin 2026, série AD	72 000	68 321	67 004
RioCan Real Estate Investment Trust, 2,83 %, 8 nov. 2028, série AE	53 000	51 463	47 527
RioCan Real Estate Investment Trust, 4,63 %, 1 ^{er} mai, 2029, série AF	25 000	25 000	24 260
RioCan Real Estate Investment Trust Trust, 5,96 %, 1 ^{er} oct. 2029	75 000	72 950	77 192
RioCan Real Estate Investment Trust, 5,61 %, 6 oct. 2027, série AG	10 000	9 992	10 126
RioCan Real Estate Investment Trust, 6,49 %, 29 sept. 2026	75 000	74 726	75 515
Rogers Communications Inc., 6,68 %, 4 nov. 2039	65 000	81 823	73 687
Rogers Communications Inc., 6,11 %, 25 août 2040	165 000	187 558	177 806
Rogers Communications Inc., 6,56 %, 22 mars 2041	52 000	64 121	58 694

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Rogers Communications Inc., 4,00 %, 13 mars 2024	70 000	73 842	69 791
Rogers Communications Inc., 3,25 %, 1 ^{er} mai 2029	174 000	168 776	163 309
Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	284 000	287 602	276 803
Rogers Communications Inc., 3,75 %, 15 avr. 2029	120 000	117 800	115 468
Rogers Communications Inc., 3,10 %, 15 avr. 2025	147 000	146 115	143 612
Rogers Communications Inc., 4,25 %, 15 avr. 2032	112 000	110 358	107 803
Rogers Communications Inc., 5,25 %, 15 avr. 2052	189 000	179 056	187 970
Rogers Communications Inc., 6,75 %, 9 nov. 2039	250 000	296 948	285 247
Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janv. 2024	55 000	57 524	54 938
Rogers Communications Inc., 3,80 %, 1 ^{er} mars 2027	33 000	35 346	32 338
Rogers Communications Inc., 4,40 %, 2 nov. 2028	60 000	65 082	59 759
Rogers Communications Inc., 3,30 %, 10 déc. 2029	60 000	60 522	55 994
Rogers Communications Inc., 4,25 %, 9 déc. 2049	30 000	29 470	25 763
Rogers Communications Inc., 2,90 %, 9 déc. 2030	75 000	79 508	67 204
Rogers Communications Inc., 5,65 %, 21 sept. 2026	20 000	19 901	20 603
Rogers Communications Inc., 5,70 %, 21 sept. 2028	118 000	117 848	123 814
Rogers Communications Inc., 5,80 %, 21 sept. 2030	51 000	50 965	54 167
Rogers Communications Inc., 5,90 %, 21 sept. 2033	204 000	200 874	219 639
Banque Royale du Canada, 4,93 %, 16 juill. 2025	87 000	98 201	87 498
Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} nov. 2024	290 000	299 524	284 040
Banque Royale du Canada, 2,88 %, 23 déc. 2029	270 000	270 600	263 242
Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28 janv. 2027	336 000	327 677	316 693
Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 ^{er} mai 2025	165 000	165 053	159 030
Banque Royale du Canada, 2,09 %, 30 juin 2030	155 000	153 710	148 502
Banque Royale du Canada, 1,67 %, 28 janv. 2033	124 000	116 544	110 477
Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	157 000	152 212	147 679
Banque Royale du Canada, 1,83 %, 31 juill. 2028	130 000	122 008	117 326
Banque Royale du Canada, 2,14 %, 3 nov. 2031	296 000	280 091	274 626
Banque Royale du Canada, 2,94 %, 3 mai 2032	132 000	126 904	123 988
Banque Royale du Canada, 3,37 %, 29 sept. 2025	491 000	481 647	480 291
Banque Royale du Canada, 4,61 %, 26 juill. 2027	356 000	351 796	358 243
Banque Royale du Canada, 5,23 %, 2 nov. 2026	212 000	213 759	216 454
Banque Royale du Canada, 4,11 %, 22 déc. 2026	143 000	143 000	142 349
Banque Royale du Canada, 5,01 %, 1 ^{er} févr. 2033	261 000	257 379	261 668
Banque Royale du Canada, 4,64 %, 17 janv. 2028	428 000	419 327	431 463
Banque Royale du Canada, 4,63 %, 1 ^{er} mai 2028	467 000	458 102	470 979
Banque Royale du Canada, 5,23 %, 24 juin 2030	156 000	156 000	162 730
Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	150 000	149 683	152 956
Banque Royale du Canada, 4,26 %, 21 déc. 2026	278 000	278 000	279 151
Royal Office Finance LP, 5,21 %, 12 nov. 2037	70 457	83 935	74 594
Ryerson University, 3,54 %, 4 mai 2061	30 000	23 227	24 643
Sagen MI Canada Inc., 2,96 %, 1 ^{er} mars 2027	35 000	34 023	32 173
Sagen MI Canada Inc., 3,26 %, 5 mars 2031	35 000	33 160	29 551
Sagen MI Canada Inc., 5,91 %, 19 mai 2028	25 000	24 521	25 079
Saputo Inc., 3,60 %, 14 août 2025	50 000	51 381	49 057
Saputo Inc., 2,88 %, 19 nov. 2024	60 000	61 121	58 789
Saputo Inc., 2,24 %, 16 juin 2027	148 000	141 138	137 724
Saputo Inc., 1,42 %, 19 juin 2026	45 000	42 890	41 871
Saputo Inc., 2,30 %, 22 juin 2028	35 000	34 233	32 027
Saputo Inc., 5,25 %, 29 nov. 2029	40 000	41 459	41 430
Saputo Inc., 5,49 %, 20 nov. 2030	75 000	75 000	78 727
SGTP Highway Bypass LP, 4,10 %, 31 janv. 2045	58 761	59 585	54 116
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3,44 %, 28 août 2026, série P	30 000	31 336	28 775
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3,83 %, 21 déc. 2027, série S	25 000	26 652	23 811
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3,53 %, 20 déc. 2029, série U	85 000	81 030	77 591
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3,19 %, 11 juin 2027, série V	50 000	52 291	46 948
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3,65 %, 11 déc. 2030, série W	20 000	20 662	17 965
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 1,74 %, 16 déc. 2025, série X	50 000	46 689	46 811
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 2,31 %, 18 déc. 2028, série Y	37 000	35 403	32 312
SmartCentres Real Estate Investment Trust, 5,35 %, 29 mai 2028, série Z	50 000	48 719	50 242
SNC-Lavalin Innisfree McGill Finance, Inc., 6,63 %, 30 juin 2044	30 006	40 735	34 314
SSL Finance Inc. 4,10 %, 31 oct. 2045	54 814	58 768	50 778
Stantec Inc., 2,05 %, 8 oct. 2027	35 000	33 288	32 002
Financière Sun Life inc., 5,40 %, 29 mai 2042	42 000	53 005	43 239
Financière Sun Life inc., 2,38 %, 13 août 2029	80 000	81 523	78 505
Financière Sun Life inc., 2,58 %, 10 mai 2032	190 000	182 668	177 629
Financière Sun Life inc., 2,06 %, 1 ^{er} oct. 2035	101 000	92 738	84 948
Financière Sun Life inc., 2,46 %, 18 nov. 2031, série 2021-1	56 000	55 871	52 643
Financière Sun Life inc., 2,80 %, 21 nov. 2033, série 2021-2	121 000	119 021	111 025
Financière Sun Life inc., 3,15 %, 18 nov. 2036, série 2021-3	57 000	56 912	50 504
Financière Sun Life inc., 4,78 %, 10 août 2034	70 000	69 983	70 029
Financière Sun Life inc., 5,50 %, 4 juill. 2035	55 000	54 943	56 884
Suncor Énergie Inc., 5,39 %, 26 mars 2037	25 000	25 012	25 678
Suncor Énergie Inc., 4,34 %, 13 sept. 2046	35 000	36 170	31 528
Suncor Énergie Inc., 3,95 %, 4 mars 2051	64 000	61 564	53 482
Suncor Énergie Inc., 5,60 %, 17 nov. 2025	249 000	248 666	252 660
Suncor Énergie Inc., 5,40 %, 17 nov. 2026	100 000	100 621	102 475

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
Sysco Canada, Inc., 3,65 %, 25 avr. 2025	89 000	90 881	87 509
TCHC Issuer Trust, 5,39 %, 22 févr. 2040, série B	15 000	19 795	16 688
TELUS Corp., 4,40 %, 1 ^{er} avr. 2043, série CL	75 000	76 438	67 428
TELUS Corp., 4,85 %, 5 avr. 2044	215 000	213 282	204 512
TELUS Corp., 3,75 %, 17 janv. 2025, série CQ	115 000	119 183	113 401
TELUS Corp., 4,75 %, 17 janv. 2045, série CR	64 000	65 950	60 177
TELUS Corp., 4,40 %, 29 janv. 2046, série CU	85 000	81 017	75 976
TELUS Corp., 3,75 %, 10 mars 2026, série CV	84 000	88 145	82 737
TELUS Corp., 4,70 %, 6 mars 2048, série CW	50 000	54 612	46 470
TELUS Corp., 3,63 %, 1 ^{er} mars 2028, série CX	96 000	96 049	93 351
TELUS Corp., 5,15 %, 26 nov. 2043, série CN	45 000	51 560	44 458
TELUS Corp., 3,30 %, 2 mai 2029, série CY	140 000	142 995	132 804
TELUS Corp., 2,75 %, 8 juill. 2026, série CZ	124 000	121 956	119 390
TELUS Corp., 3,15 %, 19 févr. 2030	60 000	63 186	55 590
TELUS Corp., 3,95 %, 16 févr. 2050, série CAB	105 000	97 976	86 416
TELUS Corp., 2,35 %, 27 janv. 2028, série CAC	86 000	81 578	79 686
TELUS Corp., 2,05 %, 7 oct. 2030	75 000	66 907	63 961
TELUS Corp., 4,10 %, 5 avr. 2051, série CAE	101 000	87 995	85 230
TELUS Corp., 2,85 %, 13 nov. 2031, série CAF	136 000	125 229	119 974
TELUS Corp., 5,25 %, 15 nov. 2032	154 000	154 252	159 253
TELUS Corp., 5,65 %, 13 sept. 2052	73 000	73 614	77 858
TELUS Corp., 5,00 %, 13 sept. 2029	35 000	34 849	35 920
TELUS Corp., 4,95 %, 28 mars 2033	60 000	59 897	60 739
TELUS Corp., 5,60 %, 9 sept. 2030	65 000	64 255	68 741
TELUS Corp., 5,75 %, 8 sept. 2033	209 000	205 925	223 599
TELUS Corp., 5,95 %, 8 sept. 2053	50 000	49 268	55 632
Teranet Holdings LP, 5,75 %, 17 déc. 2040	60 000	68 323	59 305
Teranet Holdings LP, 6,10 %, 17 juin 2041	35 000	40 421	35 904
Teranet Holdings LP, 3,54 %, 11 juin 2025	70 000	72 470	68 108
Teranet Holdings LP, 3,72 %, 23 févr. 2029	49 000	47 876	45 744
Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	200 000	198 697	193 358
Groupe TMX Ltée, 3,00 %, 11 déc. 2024, série D	35 000	36 161	34 336
Groupe TMX Ltée, 3,78 %, 5 juin 2028, série E	25 000	26 955	24 486
Groupe TMX Ltée, 2,02 %, 12 févr. 2031, série F	50 000	43 941	42 570
Toromont Industries Ltd., 3,84 %, 27 oct. 2027	65 000	68 334	63 710
Toronto Hydro Corp., 5,54 %, 21 mai 2040, série 6	25 000	33 519	28 255
Toronto Hydro Corp., 3,96 %, 9 avr. 2063	25 000	27 586	23 017
Toronto Hydro Corp., 3,55 %, 28 juill. 2045, série 11	25 000	27 561	22 036
Toronto Hydro Corp., 2,52 %, 25 août 2026	45 000	42 323	43 174
Toronto Hydro Corp., 2,43 %, 11 déc. 2029, série 14	25 000	25 874	22 982
Toronto Hydro Corp., 2,99 %, 10 déc. 2049, série 15	25 000	24 744	19 619
Toronto Hydro Corp., 4,08 %, 16 sept. 2044, série 10	25 000	29 243	23 900
Toronto Hydro Corp., 3,49 %, 28 févr. 2048, série 13	15 000	16 190	12 974
Toronto Hydro Corp., 1,50 %, 15 oct. 2030, série 16	45 000	44 717	38 346
Toronto Hydro Corp., 2,47 %, 20 oct. 2031, série 17	15 000	15 114	13 353
Toronto Hydro Corp., 3,27 %, 18 oct. 2051, série 18	29 000	24 797	23 828
Toronto Hydro Corp., 4,95 %, 13 oct. 2052	43 000	44 374	46 928
Toronto Hydro Corp., 4,61 %, 14 juin 2033	30 000	28 496	30 946
Toronto Hydro Corp., 5,13 %, 12 oct. 2028	30 000	31 091	31 566
La Banque Toronto-Dominion, 4,86 %, 4 mars 2031	125 000	136 694	125 046
La Banque Toronto-Dominion, 2,50 %, 2 déc. 2024	275 000	277 377	268 546
La Banque Toronto-Dominion, 3,06 %, 26 janv. 2032	205 000	208 885	194 590
La Banque Toronto-Dominion, 1,94 %, 13 mars 2025	215 000	214 901	207 843
La Banque Toronto-Dominion, 3,11 %, 22 avr. 2030	510 000	514 096	496 026
La Banque Toronto-Dominion, 1,13 %, 9 déc. 2025	220 000	209 631	206 617
La Banque Toronto-Dominion, 1,89 %, 8 mars 2028	226 000	213 581	205 956
La Banque Toronto-Dominion, 1,90 %, 11 sept. 2028	206 000	192 349	185 952
La Banque Toronto-Dominion, 2,26 %, 7 janv. 2027	226 000	222 063	212 675
La Banque Toronto-Dominion, 2,67 %, 9 sept. 2025	576 000	558 881	557 176
La Banque Toronto-Dominion, 4,21 %, 1 ^{er} juin 2027	497 000	485 904	493 521
La Banque Toronto-Dominion, 4,34 %, 27 janv. 2026	179 000	178 049	178 408
La Banque Toronto-Dominion, 5,38 %, 21 oct. 2027	251 000	250 509	258 949
La Banque Toronto-Dominion, 4,68 %, 8 janv. 2029	450 000	442 591	455 328
La Banque Toronto-Dominion, 4,48 %, 18 janv. 2028	490 000	479 268	490 505
La Banque Toronto-Dominion, 5,42 %, 10 juill. 2026	170 000	170 000	173 709
La Banque Toronto-Dominion, 5,49 %, 8 sept. 2028	169 000	169 000	176 804
Tourmaline Oil Corp., 2,08 %, 25 janv. 2028	51 000	46 971	46 489
Tourmaline Oil Corp., 2,53 %, 12 févr. 2029	25 000	24 596	22 805
Toyota Credit Canada Inc., 2,11 %, 26 févr. 2025	50 000	50 815	48 492
Toyota Credit Canada Inc., 1,18 %, 23 févr. 2026	45 000	43 241	41 997
Toyota Credit Canada Inc., 1,66 %, 20 juill. 2026	40 000	36 973	37 441
Toyota Credit Canada Inc., 1,27 %, 22 juill. 2024	45 000	43 991	44 069
Toyota Credit Canada Inc., 2,73 %, 25 août 2025	60 000	58 617	58 316
Toyota Credit Canada Inc., 4,33 %, 24 janv. 2028	50 000	48 529	50 052
Toyota Credit Canada Inc., 4,45 %, 26 janv. 2026	50 000	49 070	49 937
Toyota Credit Canada Inc., 5,16 %, 12 juill. 2028	40 000	39 340	41 413
TransCanada PipeLines Ltd., 8,05 %, 17 févr. 2039	35 000	52 025	44 785
TransCanada PipeLines Ltd., 4,55 %, 15 nov. 2041	125 000	125 801	113 550
TransCanada PipeLines Ltd., 3,30 %, 17 juill. 2025	110 000	113 446	107 601
TransCanada PipeLines Ltd., 4,35 %, 6 juin 2046	90 000	88 126	78 619
TransCanada PipeLines Ltd., 3,39 %, 15 mars 2028	62 000	64 207	59 527
TransCanada PipeLines Ltd., 4,33 %, 16 sept. 2047	152 000	144 463	132 004
TransCanada PipeLines Ltd., 4,18 %, 3 juill. 2048	150 000	143 629	127 005
TransCanada PipeLines Ltd., 4,34 %, 15 oct. 2049	175 000	162 664	151 494
TransCanada PipeLines Ltd., 3,00 %, 18 sept. 2029	140 000	135 932	129 536
TransCanada PipeLines Ltd., 8,29 %, 5 févr. 2026	20 000	23 922	21 186
TransCanada PipeLines Ltd., 3,80 %, 5 avr. 2027	355 000	363 709	348 109
TransCanada PipeLines Ltd., 2,97 %, 9 juin 2031	66 000	66 861	58 667
TransCanada PipeLines Ltd., 4,35 %, 12 mai 2026	48 000	47 988	47 878

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 23,1 % (suite)			
TransCanada PipeLines Ltd., 5,33 %, 12 mai 2032	116 000	115 544	120 041
TransCanada PipeLines Ltd., 5,92 %, 12 mai 2052	35 000	36 100	38 142
TransCanada PipeLines Ltd., 5,28 %, 15 juill. 2030	254 000	250 832	262 435
TransCanada PipeLines Ltd., 5,42 %, 10 mars 2026	68 000	68 000	68 035
Transcontinental Inc., 2,28 %, 13 juill. 2026	31 000	29 128	28 893
Transcontinental Inc., 2,67 %, 3 févr. 2025	30 000	28 718	28 945
Trillium Windpower LP, 5,80 %, 15 févr. 2033	10 801	12 252	11 031
TriSummit Utilities Inc., 4,26 %, 5 déc. 2028	35 000	37 195	34 417
TriSummit Utilities Inc., 3,15 %, 6 avr. 2026	40 000	40 738	38 610
Université de Toronto, 4,25 %, 7 déc. 2051	20 000	22 802	19 405
Université de Toronto, 5,84 %, 15 déc. 2043	20 000	26 998	23 316
Administration de l'aéroport international de Vancouver, 3,66 %, 23 nov. 2048	25 000	24 452	22 586
Administration de l'aéroport international de Vancouver, 3,86 %, 10 nov. 2045	15 000	15 902	14 045
Administration de l'aéroport international de Vancouver, 2,87 %, 18 oct. 2049	55 000	46 610	43 188
Administration de l'aéroport international de Vancouver, 1,76 %, 20 sept. 2030	30 000	29 017	26 126
Administration de l'aéroport international de Vancouver, 2,80 %, 21 sept. 2050	50 000	47 401	38 529
Vancouver Airport Fuel Facilities Corp., 2,17 %, 23 juin 2025	60 000	56 714	57 791
Ventas Canada Finance Ltd., 4,12 %, 30 sept. 2024, série B	14 000	14 928	13 846
Ventas Canada Finance Ltd., 2,45 %, 4 janv. 2027, série G	76 000	72 673	70 875
Ventas Canada Finance Ltd., 3,30 %, 1 ^{er} déc. 2031, série H	31 000	30 893	27 227
Ventas Canada Finance Ltd., 5,40 %, 21 avr. 2028, série I	75 000	74 059	76 426
Crédit VW Canada, Inc., 5,86 %, 15 nov. 2027	43 000	44 529	44 797
Crédit VW Canada, Inc., 2,85 %, 26 sept. 2024	55 000	56 623	54 029
Crédit VW Canada, Inc., 1,50 %, 23 sept. 2025	55 000	51 562	51 957
Crédit VW Canada, Inc., 2,45 %, 10 déc. 2026	73 000	70 838	68 586
Crédit VW Canada, Inc., 2,05 %, 10 déc. 2024	59 000	58 303	57 277
Crédit VW Canada, Inc., 5,80 %, 17 nov. 2025	60 000	60 304	60 999
Crédit VW Canada, Inc., 5,73 %, 20 sept. 2028	100 000	98 968	104 427
Crédit VW Canada, Inc., 5,75 %, 21 sept. 2026	100 000	99 437	102 626
Waste Management of Canada Corp., 2,60 %, 23 sept. 2026	60 000	61 157	57 484
Westcoast Energy Inc., 4,79 %, 28 oct. 2041	25 000	27 443	24 197
Westcoast Energy Inc., 3,77 %, 8 déc. 2025, série 16	82 000	83 247	80 622
Westcoast Energy Inc., 3,43 %, 12 sept. 2024, série 15	40 000	41 528	39 477
Westcoast Energy Inc., 7,15 %, 20 mars 2031, série 8	25 000	30 089	28 011
Groupe WSP Global Inc., 2,41 %, 19 avr. 2028	58 000	57 116	53 488
York University, 6,48 %, 7 mars 2042	20 000	28 645	24 608
	79 064 535		76 157 327

Obligations fédérales – 44,9 %			
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2064	940 000	1 081 713	891 844
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2048	2 440 000	2 483 511	2 316 365
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	2 436 000	2 461 921	2 375 392
Obligations du gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} juin 2027	2 194 000	2 039 437	2 035 418
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} juin 2028	2 622 000	2 555 141	2 501 257
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} déc. 2051	7 894 000	6 659 733	6 358 380
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	2 460 000	2 344 512	2 361 182
Obligations du gouvernement du Canada, 8,00 %, 1 ^{er} juin 2027	169 000	237 574	194 538
Obligations du gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2029	2 055 000	2 485 277	2 325 561
Obligations du gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2033	1 878 000	2 551 748	2 280 268
Obligations du gouvernement du Canada, 5,00 %, 1 ^{er} juin 2037	1 886 000	2 382 625	2 271 197
Obligations du gouvernement du Canada, 4,00 %, 1 ^{er} juin 2041	2 100 000	2 326 547	2 352 714
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2045	2 460 000	2 590 932	2 627 108
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} juin 2026	1 975 000	1 947 757	1 882 116
Obligations du gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} juin 2030	6 785 000	6 291 229	6 063 076
Obligations du gouvernement du Canada, 0,50 %, 1 ^{er} sept. 2025	7 729 000	7 383 842	7 308 310
Obligations du gouvernement du Canada, 0,50 %, 1 ^{er} déc. 2030	6 062 000	5 261 744	5 092 322

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations fédérales – 44,9 % (suite)			
Obligations du gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	5 431 000	5 072 061	5 054 034
Obligations du gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} sept. 2026	3 336 000	3 155 998	3 128 234
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} juin 2031	6 359 000	5 926 244	5 684 819
Obligations du gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} déc. 2053	4 940 000	3 620 850	3 712 361
Obligations du gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	2 407 000	2 208 495	2 254 180
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} déc. 2031	4 853 000	4 439 524	4 308 882
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} avr. 2025	2 140 000	2 038 500	2 067 989
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} juin 2032	3 969 000	3 598 544	3 646 479
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} déc. 2029	598 000	586 162	572 435
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2027	2 822 000	2 730 582	2 767 451
Obligations du gouvernement du Canada, 3,00 %, 1 ^{er} oct. 2025	2 170 000	2 118 311	2 136 256
Obligations du gouvernement du Canada, 2,50 %, 1 ^{er} déc. 2032	3 339 000	3 097 317	3 183 503
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} mars 2028	2 245 000	2 225 209	2 268 617
Obligations du gouvernement du Canada, 3,00 %, 1 ^{er} avr. 2026	1 705 000	1 664 593	1 680 738
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2055	1 577 000	1 358 371	1 487 190
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	2 854 000	2 659 938	2 773 917
Obligations du gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	2 695 000	2 666 468	2 679 234
Obligations du gouvernement du Canada, 3,25 %, 1 ^{er} sept. 2028	1 856 000	1 796 765	1 862 514
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} août 2025	3 520 000	3 449 654	3 490 045
Obligations du gouvernement du Canada, 3,25 %, 1 ^{er} déc. 2033	3 241 000	3 175 862	3 283 263
Obligations du gouvernement du Canada, 4,50 %, 1 ^{er} nov. 2025	2 900 000	2 889 901	2 931 175
Obligations du gouvernement du Canada, 4,00 %, 1 ^{er} mars 2029	450 000	460 557	468 414
Obligations du gouvernement du Canada, 4,50 %, 1 ^{er} févr. 2026	1 500 000	1 512 045	1 522 770
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,55 %, 15 mars 2025	725 000	746 375	709 898
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,95 %, 15 déc. 2025	2 145 000	2 138 452	2 064 713
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,25 %, 15 déc. 2025	485 000	494 439	469 548
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,90 %, 15 sept. 2026	845 000	871 105	806 519
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 juin 2027	1 980 000	1 950 052	1 904 087
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 mars 2028	265 000	274 967	253 679
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,65 %, 15 mars 2028	530 000	558 134	513 750
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,65 %, 15 déc. 2028	1 015 000	1 011 332	980 683
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,10 %, 15 sept. 2029	963 000	980 816	898 816
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,80 %, 15 déc. 2024	1 110 000	1 118 504	1 081 417
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,75 %, 15 juin 2030	1 805 000	1 684 296	1 632 298
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 0,95 %, 15 juin 2025	2 202 000	2 120 042	2 102 888
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,10 %, 15 mars 2031	1 161 000	1 007 116	989 532
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,40 %, 15 mars 2031	309 000	296 393	269 232
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,25 %, 15 juin 2026	1 742 000	1 675 838	1 640 267
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,90 %, 15 mars 2031	583 000	532 287	526 414
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,60 %, 15 déc. 2031	502 000	482 649	437 724
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,10 %, 15 déc. 2026	738 000	710 762	685 388
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,15 %, 15 déc. 2031	624 000	598 254	567 778
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,55 %, 15 déc. 2026	553 000	544 430	520 439
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,45 %, 15 déc. 2031	381 000	372 029	354 559

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations fédérales – 44,9 % (suite)			
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,55 %, 15 sept. 2032	1 878 000	1 854 172	1 889 061
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,80 %, 15 juin 2027	597 000	596 843	601 812
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,60 %, 15 déc. 2027	1 806 000	1 795 392	1 814 073
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,65 %, 15 juin 2033	1 228 000	1 198 992	1 243 153
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,10 %, 15 juin 2028	624 000	617 008	615 670
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,95 %, 15 juin 2028	676 000	675 571	690 487
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,15 %, 15 juin 2033	479 000	477 879	503 989
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,25 %, 15 déc. 2028	1 591 000	1 615 546	1 651 824
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,25 %, 15 mars 2034	1 182 000	1 181 279	1 254 858
CPPIB Capital Inc., 3,00 %, 15 juin 2028	504 000	500 377	492 917
CPPIB Capital Inc., 1,95 %, 30 sept. 2029	135 000	129 915	123 926
CPPIB Capital Inc., 2,25 %, 1 ^{er} déc. 2031	162 000	158 766	146 085
CPPIB Capital Inc., 2,85 %, 1 ^{er} juin 2027	211 000	207 023	205 685
CPPIB Capital Inc., 3,95 %, 2 juin 2032	675 000	659 033	685 577
CPPIB Capital Inc., 3,25 %, 8 mars 2028	398 000	392 224	393 315
CPPIB Capital Inc., 3,95 %, 8 sept. 2025	75 000	75 430	74 752
CPPIB Capital Inc., 4,75 %, 2 juin 2033	252 000	257 570	270 940
Exportation et développement Canada, 1,65 %, 31 juill. 2024	50 000	50 749	49 082
PSP Capital Inc., 3,00 %, 5 nov. 2025	172 000	179 428	168 636
PSP Capital Inc., 2,05 %, 15 janv. 2030	140 000	138 219	128 344
PSP Capital Inc., 0,90 %, 15 juin 2026	181 000	175 135	168 554
PSP Capital Inc., 1,50 %, 15 mars 2028	138 000	131 795	126 993
PSP Capital Inc., 2,60 %, 1 ^{er} mars 2032	209 000	190 697	192 506
PSP Capital Inc., 3,75 %, 15 juin 2029	176 000	177 040	177 663
PSP Capital Inc., 4,15 %, 1 ^{er} juin 2033	275 000	267 588	282 392
PSP Capital Inc., 4,40 %, 2 déc. 2030	118 000	117 898	123 521
	149 527 035	147 687 000	

Obligations provinciales – 31,5 %

British Columbia Investment Management Corp., 4,90 %, 2 juin 2033	175 000	174 372	189 304
Financement-Québec, 5,25 %, 1 ^{er} juin 2034	234 000	288 637	261 521
Hydro-Québec, 4,00 %, 15 févr. 2055	611 000	709 818	619 212
Hydro-Québec, 5,00 %, 15 févr. 2045, série JM	195 000	254 046	220 976
Hydro-Québec, 5,00 %, 15 févr. 2050, série JN	205 000	263 880	239 372
Hydro-Québec, 6,50 %, 15 févr. 2035, série 19	525 000	714 391	648 553
Hydro-Québec, 6,00 %, 15 févr. 2040	345 000	453 155	427 255
Hydro-Québec, 6,00 %, 15 août 2031, série JG	65 000	85 951	74 952
Hydro-Québec, 2,10 %, 15 févr. 2060	777 000	570 845	511 709
Hydro-Québec, 2,00 %, 1 ^{er} sept. 2028	396 000	367 436	370 280
Hydro-Québec, 4,00 %, 15 févr. 2063, série JS	384 000	356 947	393 711
Hydro-Québec, 3,40 %, 1 ^{er} sept. 2029	194 000	190 269	192 559
Labrador-Island Link Funding Trust, 3,76 %, 1 ^{er} juin 2033, série A	85 000	96 847	85 283
Labrador-Island Link Funding Trust, 3,86 %, 1 ^{er} déc. 2045, série B	46 000	56 708	45 291
Labrador-Island Link Funding Trust, 3,85 %, 1 ^{er} déc. 2053, série C	158 000	169 231	157 063
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,50 %, 19 avr. 2026, série EE	176 000	176 754	170 560
Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,05 %, 23 oct. 2028, série EK	75 000	80 437	73 325
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,95 %, 14 oct. 2024, série EA	45 000	47 154	44 371
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 3 juin 2024, série EN	95 000	96 998	93 900
Municipal Finance Authority of British Columbia, 4,95 %, 1 ^{er} déc. 2027, série DN	246 000	257 652	257 921
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,55 %, 9 oct. 2029, série EL	26 000	27 434	24 631
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,65 %, 2 oct. 2025, série EB	85 000	86 119	82 889
Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,10 %, 1 ^{er} juin 2025, série EO	75 000	73 922	71 735
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,30 %, 15 avr. 2031, série EP	75 000	75 698	68 438
Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,35 %, 30 juin 2026	81 000	77 155	76 188
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,50 %, 27 sept. 2041, série ER	68 000	55 800	53 717
Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,30 %, 8 avr. 2032, série ES	80 000	77 435	77 513
Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,35 %, 1 ^{er} juin 2027	76 000	75 158	75 236
Municipal Finance Authority of British Columbia, 4,50 %, 3 déc. 2028, série EV	141 000	142 285	146 901
Muskkrat Falls / Labrador Transmission Assets Funding Trust, 3,63 %, 1 ^{er} juin 2029	75 000	81 727	75 526
Muskkrat Falls / Labrador Transmission Assets Funding Trust, 3,83 %, 1 ^{er} juin 2037	40 000	49 064	39 786

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 31,5 % (suite)			
Muskkrat Falls / Labrador Transmission Assets Funding Trust, 3,86 %, 1 ^{er} déc. 2048	120 000	150 946	118 163
Muskkrat Falls / Labrador Transmission Assets Funding Trust, 3,38 %, 1 ^{er} juin 2057	52 000	53 071	47 372
Newfoundland and Labrador Hydro, 3,60 %, 1 ^{er} déc. 2045	85 000	80 863	75 355
Société financière de l'industrie de l'électricité de l'Ontario, 8,25 %, 22 juin 2026	110 000	133 620	121 069
Société financière de l'industrie de l'électricité de l'Ontario, 8,50 %, 26 mai 2025	30 000	31 632	31 652
Société ontarienne des infrastructures et de l'immobilier, 4,70 %, 1 ^{er} juin 2037	15 000	18 513	15 758
Province d'Alberta, 4,50 %, 1 ^{er} déc. 2040	70 000	87 815	73 962
Province d'Alberta, 3,45 %, 1 ^{er} déc. 2043	322 000	344 103	294 218
Province d'Alberta, 2,35 %, 1 ^{er} juin 2025	624 000	629 107	607 745
Province d'Alberta, 3,30 %, 1 ^{er} déc. 2046	740 000	743 064	654 678
Province d'Alberta, 2,20 %, 1 ^{er} juin 2026	795 000	788 160	764 989
Province d'Alberta, 2,55 %, 1 ^{er} juin 2027	919 000	928 195	887 221
Province d'Alberta, 3,05 %, 1 ^{er} déc. 2048	1 090 000	992 804	917 082
Province d'Alberta, 2,90 %, 1 ^{er} déc. 2028	480 000	495 747	466 560
Province d'Alberta, 2,90 %, 20 sept. 2029	251 000	263 915	242 923
Province d'Alberta, 3,90 %, 1 ^{er} déc. 2033	244 000	270 675	245 740
Province d'Alberta, 3,50 %, 1 ^{er} juin 2031	139 000	146 887	137 670
Province d'Alberta, 3,10 %, 1 ^{er} juin 2050	1 385 000	1 334 347	1 176 959
Province d'Alberta, 2,05 %, 1 ^{er} juin 2030	1 225 000	1 175 964	1 119 123
Province d'Alberta, 1,65 %, 1 ^{er} juin 2031	646 000	581 063	562 860
Province d'Alberta, 2,95 %, 1 ^{er} juin 2052	565 000	516 716	466 554
Province d'Alberta, 4,15 %, 1 ^{er} juin 2033	300 000	301 394	308 862
Province d'Alberta, 4,45 %, 1 ^{er} déc. 2054	100 000	104 133	108 508
Province de la Colombie-Britannique, 4,30 %, 18 juin 2042	386 000	436 639	399 568
Province de la Colombie-Britannique, 5,70 %, 18 juin 2029	434 000	525 890	480 898
Province de la Colombie-Britannique, 6,35 %, 18 juin 2031	133 000	183 333	156 347
Province de la Colombie-Britannique, 5,40 %, 18 juin 2035	50 000	57 980	57 054
Province de la Colombie-Britannique, 4,70 %, 18 juin 2037	156 000	200 634	168 433
Province de la Colombie-Britannique, 4,95 %, 18 juin 2040	430 000	501 644	480 710
Province de la Colombie-Britannique, 3,20 %, 18 juin 2044	471 000	495 397	416 519
Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	579 000	604 393	567 617
Province de la Colombie-Britannique, 2,80 %, 18 juin 2048	813 000	728 659	660 172
Province de la Colombie-Britannique, 2,30 %, 18 juin 2026	453 000	437 680	436 909
Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	355 000	363 857	342 816
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 déc. 2028	232 000	248 337	226 149
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 juin 2050	1 069 000	991 488	889 055
Province de la Colombie-Britannique, 2,20 %, 18 juin 2030	658 000	645 557	606 439
Province de la Colombie-Britannique, 9,00 %, 23 août 2024	40 000	44 445	41 030
Province de la Colombie-Britannique, 1,55 %, 18 juin 2031	864 000	763 763	746 997
Province de la Colombie-Britannique, 2,75 %, 18 juin 2052	583 000	524 543	466 074
Province de la Colombie-Britannique, 5,00 %, 18 juin 2031	30 000	33 487	32 642
Province de la Colombie-Britannique, 3,20 %, 18 juin 2032	463 000	440 723	446 119
Province de la Colombie-Britannique, 4,25 %, 18 déc. 2053	496 000	495 278	524 699
Province de la Colombie-Britannique, 3,55 %, 18 juin 2033	315 000	304 570	309 554
Province du Manitoba, 6,30 %, 5 mars 2031	70 000	89 488	81 418
Province du Manitoba, 4,40 %, 5 sept. 2025	82 000	90 819	82 306
Province du Manitoba, 3,15 %, 5 sept. 2052	34 000	36 044	28 661
Province du Manitoba, 3,25 %, 5 sept. 2029	65 000	61 598	63 942
Province du Manitoba, 5,70 %, 5 mars 2037	68 000	94 503	79 538
Province du Manitoba, 4,60 %, 5 mars 2038	200 000	224 871	211 442
Province du Manitoba, 4,65 %, 5 mars 2040	200 000	219 426	212 632
Province du Manitoba, 4,10 %, 5 mars 2041	189 000	214 963	187 454
Province du Manitoba, 3,35 %, 5 mars 2043	55 000	59 054	48 988
Province du Manitoba, 4,05 %, 5 sept. 2045	169 000	207 516	165 821
Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	450 000	457 582	438 853
Province du Manitoba, 2,85 %, 5 sept. 2046	325 000	294 479	262 278
Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	230 000	238 785	223 125
Province du Manitoba, 3,40 %, 5 sept. 2048	232 000	250 305	204 942
Province du Manitoba, 2,60 %, 2 juin 2027	185 000	191 832	178 843
Province du Manitoba, 3,00 %, 2 juin 2028	255 000	266 473	249 367
Province du Manitoba, 3,20 %, 5 mars 2050	405 000	422 559	345 267
Province du Manitoba, 4,40 %, 5 mars 2042	45 000	57 249	46 316

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 31,5 % (suite)			
Province du Manitoba, 2,75 %, 2 juin 2029	304 000	303 112	292 314
Province du Manitoba, 4,70 %, 5 mars 2030	40 000	55 658	43 682
Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2030	260 000	237 545	237 055
Province du Manitoba, 2,05 %, 5 sept. 2052	273 000	195 599	179 738
Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2031	235 000	231 665	210 325
Province du Manitoba, 3,10 %, 5 mars 2068	6 000	6 686	4 801
Province du Manitoba, 7,75 %, 22 déc. 2025	35 000	40 058	37 422
Province du Manitoba, 3,80 %, 5 sept. 2053	220 000	195 976	209 282
Province du Manitoba, 3,90 %, 2 déc. 2032	225 000	227 546	227 043
Province du Manitoba, 3,80 %, 2 juin 2033	70 000	71 350	69 876
Province du Manitoba, 4,25 %, 5 mars 2039	100 000	92 439	101 759
Province du Nouveau-Brunswick, 5,65 %, 27 déc. 2028	50 000	60 868	54 654
Province du Nouveau-Brunswick, 4,65 %, 26 sept. 2035	75 000	90 173	79 835
Province du Nouveau-Brunswick, 4,55 %, 26 mars 2037	160 000	183 291	168 686
Province du Nouveau-Brunswick, 4,80 %, 26 sept. 2039	115 000	145 171	124 620
Province du Nouveau-Brunswick, 3,80 %, 14 août 2045	220 000	231 152	209 022
Province du Nouveau-Brunswick, 2,60 %, 14 août 2026	185 000	186 039	179 635
Province du Nouveau-Brunswick, 3,10 %, 14 août 2048	167 000	157 927	140 572
Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	213 000	209 595	203 745
Province du Nouveau-Brunswick, 4,80 %, 3 juin 2041	120 000	157 662	129 760
Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2043	185 000	190 041	170 270
Province du Nouveau-Brunswick, 5,50 %, 27 janv. 2034	65 000	79 927	73 844
Province du Nouveau-Brunswick, 3,10 %, 14 août 2028	155 000	167 166	151 995
Province du Nouveau-Brunswick, 3,05 %, 14 août 2050	235 000	227 132	195 642
Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2055	26 000	30 178	23 392
Province du Nouveau-Brunswick, 1,80 %, 14 août 2025	120 000	119 285	115 630
Province du Nouveau-Brunswick, 2,90 %, 14 août 2052	119 000	98 182	95 941
Province du Nouveau-Brunswick, 2,55 %, 14 août 2031	81 000	73 402	74 828
Province du Nouveau-Brunswick, 3,95 %, 14 août 2032	345 000	336 291	349 537
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 6,15 %, 17 avr. 2028	50 000	61 421	54 850
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 5,70 %, 17 oct. 2035	35 000	46 938	39 940
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,50 %, 17 avr. 2037	70 000	74 301	71 827
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,65 %, 17 oct. 2040	91 000	104 284	94 515
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,30 %, 2 juin 2025	153 000	154 491	148 774
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,30 %, 17 oct. 2046	280 000	253 600	236 116
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,00 %, 2 juin 2026	182 000	185 876	178 189
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2028	185 000	185 588	179 084
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,70 %, 17 oct. 2048	265 000	257 423	237 861
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2029	125 000	132 862	120 223
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 6,55 %, 17 oct. 2030	35 000	39 788	40 800
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 5,60 %, 17 oct. 2033	16 000	21 171	18 032
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,65 %, 17 oct. 2050	205 000	182 752	150 632
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,75 %, 2 juin 2030	120 000	115 086	106 616
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,25 %, 2 juin 2027	110 000	101 472	101 339
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,05 %, 2 juin 2031	160 000	146 007	141 928
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,15 %, 2 déc. 2052	91 000	82 024	73 860
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,85 %, 17 oct. 2027	100 000	100 329	100 607
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,10 %, 17 oct. 2054	113 000	101 581	109 372
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,15 %, 2 juin 2033	50 000	49 440	50 791
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,40 %, 1 ^{er} juin 2042	120 000	144 040	124 116
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,15 %, 1 ^{er} juin 2025	35 000	35 650	33 987
Province de la Nouvelle-Écosse, 5,80 %, 1 ^{er} juin 2033	40 000	54 254	46 272
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,50 %, 1 ^{er} juin 2037	145 000	163 767	152 323
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,70 %, 1 ^{er} juin 2041	125 000	142 650	133 761

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 31,5 % (suite)			
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,10 %, 1 ^{er} juin 2027	190 000	187 914	180 719
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,50 %, 2 juin 2062	137 000	149 521	122 934
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,90 %, 1 ^{er} juin 2035	48 000	56 868	52 250
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,45 %, 1 ^{er} juin 2045	70 000	72 201	63 209
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,15 %, 1 ^{er} déc. 2051	339 000	327 765	288 245
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,00 %, 1 ^{er} sept. 2030	240 000	224 212	217 363
Province de la Nouvelle-Écosse, 1,35 %, 21 avr. 2025	65 000	63 846	62 593
Province de la Nouvelle-Écosse, 1,10 %, 1 ^{er} juin 2028	190 000	171 254	171 239
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,40 %, 1 ^{er} déc. 2031	168 000	153 197	153 035
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,05 %, 1 ^{er} juin 2029	75 000	75 953	76 896
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,75 %, 1 ^{er} déc. 2054	85 000	88 649	95 255
Province d'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	1 499 000	1 751 249	1 615 262
Province d'Ontario, 7,50 %, 7 févr. 2024	40 000	45 028	40 083
Province d'Ontario, 7,60 %, 2 juin 2027	90 000	117 040	101 330
Province d'Ontario, 6,50 %, 8 mars 2029	473 000	618 910	538 818
Province d'Ontario, 6,20 %, 2 juin 2031	115 000	156 306	133 965
Province d'Ontario, 5,85 %, 8 mars 2033	675 000	869 019	781 339
Province d'Ontario, 5,60 %, 2 juin 2035	905 000	1 200 672	1 048 524
Province d'Ontario, 4,70 %, 2 juin 2037	1 215 000	1 471 975	1 311 726
Province d'Ontario, 4,60 %, 2 juin 2039	965 000	1 184 519	1 034 798
Province d'Ontario, 3,50 %, 2 juin 2043	1 537 000	1 565 229	1 427 074
Province d'Ontario, 3,45 %, 2 juin 2045	1 810 000	1 819 396	1 660 060
Province d'Ontario, 2,60 %, 2 juin 2025	1 760 000	1 823 461	1 720 030
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 déc. 2046	2 220 000	2 063 501	1 848 949
Province d'Ontario, 2,40 %, 2 juin 2026	1 311 000	1 323 176	1 267 776
Province d'Ontario, 2,80 %, 2 juin 2048	1 282 000	1 254 274	1 042 189
Province d'Ontario, 2,60 %, 2 juin 2027	1 686 000	1 734 627	1 630 902
Province d'Ontario, 2,65 %, 5 févr. 2025	330 000	341 365	323 535
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 juin 2049	2 035 000	1 914 001	1 680 645
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 juin 2028	1 539 000	1 572 358	1 500 325
Province d'Ontario, 8,50 %, 2 déc. 2025	80 000	97 958	86 356
Province d'Ontario, 2,70 %, 2 juin 2029	1 510 000	1 513 402	1 449 328
Province d'Ontario, 8,00 %, 2 déc. 2026	45 000	51 854	50 237
Province d'Ontario, 2,65 %, 2 déc. 2050	2 094 000	1 851 014	1 641 214
Province d'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	1 883 000	1 804 052	1 720 478
Province d'Ontario, 1,75 %, 8 sept. 2025	1 220 000	1 225 824	1 173 713
Province d'Ontario, 1,85 %, 1 ^{er} févr., 2027	501 000	493 665	474 818
Province d'Ontario, 1,90 %, 2 déc. 2051	2 061 000	1 523 077	1 360 652
Province d'Ontario, 1,05 %, 8 sept. 2027	235 000	224 840	214 628
Province d'Ontario, 1,35 %, 2 déc. 2030	1 195 000	1 063 702	1 031 404
Province d'Ontario, 2,15 %, 2 juin 2031	1 740 000	1 634 539	1 572 508
Province d'Ontario, 1,35 %, 8 sept. 2026	264 000	251 307	248 102
Province d'Ontario, 1,55 %, 1 ^{er} nov. 2029	908 000	827 985	814 412
Province d'Ontario, 2,55 %, 2 déc. 2052	938 000	825 810	716 791
Province d'Ontario, 2,25 %, 2 déc. 2031	731 000	705 237	660 064
Province d'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	1 581 000	1 548 375	1 585 743
Province d'Ontario, 3,75 %, 2 déc. 2053	2 034 000	1 873 726	1 974 261
Province d'Ontario, 3,60 %, 8 mars 2028	750 000	741 065	751 860
Province d'Ontario, 4,05 %, 2 févr. 2032	426 000	423 322	437 242
Province d'Ontario, 3,65 %, 2 juin 2033	1 490 000	1 401 860	1 477 603
Province d'Ontario, 3,40 %, 8 sept. 2028	400 000	383 880	398 084
Province d'Ontario, 4,15 %, 2 déc. 2054	510 000	483 416	531 394
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 2,65 %, 1 ^{er} déc. 2051	40 000	38 026	30 290
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 4,65 %, 19 nov. 2037	15 000	18 894	15 792
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 3,75 %, 1 ^{er} déc. 2032	29 000	28 999	28 795
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 1,85 %, 27 juill. 2031	25 000	21 170	21 883
Province de Québec, 8,50 %, 1 ^{er} avr. 2026	275 000	346 865	302 002
Province de Québec, 6,00 %, 1 ^{er} oct. 2029	265 000	340 223	298 909
Province de Québec, 6,25 %, 1 ^{er} juin 2032	448 000	623 302	528 743
Province de Québec, 5,75 %, 1 ^{er} déc. 2036	483 000	632 484	572 920
Province de Québec, 2,60 %, 6 juill. 2025	60 000	62 826	58 612
Province de Québec, 5,35 %, 1 ^{er} juin 2025	80 000	86 221	81 159
Province de Québec, 5,00 %, 1 ^{er} déc. 2038	550 000	708 421	614 757
Province de Québec, 5,00 %, 1 ^{er} déc. 2041	1 325 000	1 683 009	1 490 095
Province de Québec, 4,25 %, 1 ^{er} déc. 2043	895 000	1 056 516	921 546
Province de Québec, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2045	1 501 000	1 487 197	1 386 264
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2025	974 000	1 013 345	953 001
Province de Québec, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2048	1 785 000	1 776 405	1 646 430
Province de Québec, 2,50 %, 1 ^{er} sept. 2026	1 196 000	1 192 605	1 159 654
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2027	932 000	954 599	906 435
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2028	930 000	956 328	900 491
Province de Québec, 3,10 %, 1 ^{er} déc. 2051	2 024 000	2 011 515	1 739 547
Province de Québec, 2,30 %, 1 ^{er} sept. 2029	1 095 000	1 063 804	1 027 690
Province de Québec, 1,90 %, 1 ^{er} sept. 2030	1 622 000	1 516 457	1 463 449
Province de Québec, 1,85 %, 13 févr. 2027	60 000	60 441	56 916
Province de Québec, 1,50 %, 1 ^{er} sept. 2031	1 651 000	1 454 626	1 417 681
Province de Québec, 2,85 %, 1 ^{er} déc. 2053	1 521 000	1 335 465	1 239 706
Province de Québec, 2,10 %, 27 mai 2031	67 000	64 884	60 579
Province de Québec, 3,25 %, 1 ^{er} sept. 2032	1 131 000	1 081 080	1 093 587
Province de Québec, 3,65 %, 20 mai 2032	124 000	123 820	123 960
Province de Québec, 4,40 %, 1 ^{er} déc. 2055	1 575 000	1 605 136	1 719 081

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 31,5 % (suite)			
Province de Québec, 3,90 %, 22 nov. 2032	171 000	171 069	173 861
Province de Québec, 3,60 %, 1 ^{er} sept. 2033	1 497 000	1 412 824	1 478 392
Province de la Saskatchewan, 5,75 %, 5 mars 2029	50 000	58 109	55 202
Province de la Saskatchewan, 6,40 %, 5 sept. 2031	68 000	91 394	80 254
Province de la Saskatchewan, 5,80 %, 5 sept. 2033	65 000	87 019	75 317
Province de la Saskatchewan, 4,75 %, 1 ^{er} juin 2040	123 000	159 344	133 715
Province de la Saskatchewan, 3,40 %, 3 févr. 2042	100 000	106 352	91 439
Province de la Saskatchewan, 3,90 %, 2 juin 2045	265 000	282 092	258 370
Province de la Saskatchewan, 2,75 %, 2 déc. 2046	455 000	398 618	365 979
Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	194 000	200 493	188 194
Province de la Saskatchewan, 3,30 %, 2 juin 2048	305 000	309 785	269 605
Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	205 000	204 889	198 540
Province de la Saskatchewan, 3,05 %, 2 déc. 2028	207 000	216 990	202 531
Province de la Saskatchewan, 5,00 %, 5 mars 2037	90 000	105 576	99 634
Province de la Saskatchewan, 3,10 %, 2 juin 2050	511 000	477 620	435 244
Province de la Saskatchewan, 5,60 %, 5 sept. 2035	55 000	69 271	63 639
Province de la Saskatchewan, 3,75 %, 5 mars 2054	58 000	67 543	55 716
Province de la Saskatchewan, 2,20 %, 2 juin 2030	170 000	172 021	156 638
Province de la Saskatchewan, 2,95 %, 2 juin 2058	60 000	61 455	48 455
Province de la Saskatchewan, 0,80 %, 2 sept. 2025	160 000	154 586	151 568
Province de la Saskatchewan, 2,80 %, 2 déc. 2052	195 000	178 754	156 117
Province de la Saskatchewan, 2,15 %, 2 juin 2031	230 000	220 515	207 607
Province de la Saskatchewan, 3,90 %, 2 juin 2033	150 000	143 186	151 394
South Coast British Columbia Transportation Authority, 4,65 %, 20 juin 2041	25 000	30 776	26 074
South Coast British Columbia Transportation Authority, 2,65 %, 29 oct. 2050	20 000	18 757	14 921
South Coast British Columbia Transportation Authority, 4,45 %, 9 juin 2044	73 000	78 778	74 348
South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,25 %, 23 nov. 2028	45 000	49 278	44 396
South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,05 %, 4 juin, 2025	45 000	46 573	44 217
South Coast British Columbia Transportation Authority, 1,60 %, 3 juill. 2030	43 000	41 190	37 998
South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,85 %, 9 févr. 2052	15 000	17 329	14 089
South Coast British Columbia Transportation Authority, 4,15 %, 12 déc. 2053	38 000	37 459	37 559
	110 609 517	103 595 362	
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS	339 201 087	327 439 689	
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,5 %			1 783 941
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			329 223 630

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice largement diversifié de titres à revenu fixe canadiens qui suit les rendements d'obligations de qualité supérieure libellées en dollars canadiens et émises par des gouvernements et des sociétés.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de taux d'intérêt selon le terme à courir du portefeuille du Fonds, déduction faite des positions vendeur, compte non tenu des fonds sous-jacents, des actions privilégiées, de la trésorerie et des découverts, selon le cas.

Exposition au risque de taux d'intérêt	31 décembre 2023 (\$)	31 décembre 2022 (\$)
Moins de un an	4 377 857	4 945 813
De 1 à 3 ans	75 547 425	54 132 633
De 3 à 5 ans	54 744 174	36 464 784
De 5 à 10 ans	101 644 753	66 234 867
Plus de 10 ans	91 125 480	63 080 598
	327 439 689	224 858 695

Au 31 décembre 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient fluctué de 0,25 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux et toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 5 115 411 \$, ou environ 1,6 % (4 057 000 \$ ou environ 1,8 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de change

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait pas d'exposition directe importante au risque de change.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait pas d'exposition directe importante au risque de prix lié aux actions, aux fonds sous-jacents, aux instruments dérivés et aux produits de base.

Risque de crédit

Ci-dessous, un résumé des notations des obligations, des débetures, des instruments du marché monétaire et des actions privilégiées détenus par le Fonds, s'il y a lieu.

Notation	31 décembre 2023		31 décembre 2022	
	Pourcentage du total des instruments notés (%)	Pourcentage de l'actif net (%)	Pourcentage du total des instruments notés (%)	Pourcentage de l'actif net (%)
AAA/A-1+	46,4	46,2	46,4	46,3
AA	17,6	17,5	14,5	14,4
A/A-1	26,3	26,1	29,0	28,8
BBB/A-2	9,7	9,6	10,1	10,0
	100,0	99,4	100,0	99,5

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES	99,5	99,5
Obligations et débetures canadiennes		
Obligations fédérales	44,9	45,0
Obligations provinciales	31,5	31,0
Obligations de sociétés	23,1	23,5
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,2	0,2

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Obligations et débetures	–	327 439 689	–	327 439 689
	–	327 439 689	–	327 439 689
31 décembre 2022				
Obligations et débetures	–	224 858 695	–	224 858 695
	–	224 858 695	–	224 858 695

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	64 003 200	84 828 343
Trésorerie	516 577	545 777
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	162 148	225 940
Total de l'actif	64 681 925	85 600 060
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	1 725	2 367
Charges à payer	1 265	1 688
Distributions à verser	413 718	462 375
Total du passif	416 708	466 430
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	64 265 217	85 133 630
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	27,35	25,22

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	1 671 472	1 568 439
Intérêts à distribuer	444	—
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	1 698 487	(501 090)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	3 871 663	(1 884 688)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	7 242 066	(817 339)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(1 088)	508
Revenu tiré du prêt de titres	283	102
Total des revenus (pertes), montant net	7 241 261	(816 729)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	14 176	14 110
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	9 451	9 406
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 115
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	2 221	2 178
Coûts de transactions	697	1 020
Total des charges	27 683	27 829
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	7 213 578	(844 558)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	3,99	(0,47)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	1 810 137	1 802 397

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	85 133 630	32 941 358
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	7 213 578	(844 558)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(1 715 138)	(1 310 480)
Remboursement de capital	(13 205)	(14 770)
	(1 728 343)	(1 325 250)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	23 336 650	56 846 970
Paieement au rachat	(49 690 298)	(2 484 890)
	(26 353 648)	54 362 080
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	(20 868 413)	52 192 272
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	64 265 217	85 133 630

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 213 578	(844 558)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(1 698 487)	501 090
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(3 871 663)	1 884 688
(Gain) perte de change latent	551	51
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(5 787 925)	(3 631 266)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	5 807 426	3 588 746
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	63 792	(141 186)
Charges à payer et autres montants à payer	(1 065)	2 430
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	1 726 207	1 359 995
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	(46 591)	7 289
Montant payé au rachat de parts rachetables*	68 735	206
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(1 777 000)	(1 034 425)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(1 754 856)	(1 026 930)
Gain (perte) de change latent	(551)	(51)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(28 649)	333 065
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	545 777	212 763
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	516 577	545 777
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	444	—
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	1 735 264	1 427 253

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 %			
Services de communication – 4,3 %			
BCE Inc.	24 101	1 397 705	1 257 349
Rogers Communications Inc., cat. B	9 799	560 008	607 832
TELUS Corp.	37 947	992 200	894 791
	2 949 913	2 759 972	
Consommation discrétionnaire – 3,8 %			
Dollarama Inc.	7 288	585 809	695 931
Magna International, Inc.	7 014	561 857	549 126
RB Global, Inc.	4 802	387 557	425 793
Restaurant Brands International, Inc.	7 418	619 222	767 986
	2 154 445	2 438 836	
Consommation de base – 4,2 %			
Alimentation Couche-Tard Inc.	19 300	1 197 222	1 505 979
George Weston Limitée	1 615	246 771	265 667
Les Compagnies Loblaw Limitée	3 839	410 331	492 467
Metro inc.	6 071	419 520	416 410
	2 273 844	2 680 523	
Énergie – 17,6 %			
ARC Resources Ltd.	16 127	316 593	317 218
Corporation Cameco	11 406	457 339	651 625
Canadian Natural Resources Ltd.	28 473	2 073 294	2 471 741
Cenovus Energy Inc.	35 895	808 533	792 561
Enbridge, Inc.	56 100	2 731 812	2 675 970
Imperial Oil Ltée	4 695	332 286	354 379
Pembina Pipeline Corp.	14 529	615 190	662 813
Suncor Énergie Inc.	34 593	1 407 723	1 468 473
Corporation TC Énergie	27 418	1 509 111	1 419 156
Tourmaline Oil Corp.	8 386	554 027	499 722
	10 805 908	11 313 658	
Finance – 36,7 %			
Banque de Montréal	18 848	2 240 327	2 471 161
La Banque de Nouvelle-Écosse	31 665	2 129 755	2 042 392
Brookfield Asset Management Ltd., cat. A	9 238	324 587	491 646
Brookfield Corp.	39 082	1 894 514	2 077 208
Banque Canadienne Impériale de Commerce	24 252	1 427 963	1 547 278
Fairfax Financial Holdings Ltd., à droit de vote subalterne	619	521 111	756 734
Great-West Lifeco Inc.	7 253	263 208	318 117
Intact Corporation financière	4 620	879 925	941 833
Société Financière Manuvie	48 762	1 185 689	1 427 751
Banque Nationale du Canada	8 883	802 962	897 183
Power Corp. du Canada	14 022	484 881	531 294
Banque Royale du Canada	36 623	4 485 636	4 907 482
Financière Sun Life Inc.	15 490	978 029	1 064 473
La Banque Toronto-Dominion	48 287	4 072 609	4 134 333
	21 691 196	23 608 885	
Industrie – 13,0 %			
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	15 301	2 325 039	2 548 382
Canadien Pacifique Kansas City Limitée	24 606	2 407 644	2 579 693
GFL Environmental Inc.	4 375	172 381	199 981
TFI International Inc.	2 048	298 363	369 132
Thomson Reuters Corp.	3 745	572 133	725 519
Waste Connections, Inc.	6 786	1 190 951	1 342 678
Groupe WSP Global Inc.	3 279	541 048	609 041
	7 507 559	8 374 426	
Technologies de l'information – 9,4 %			
CGI, Inc.	5 468	647 279	776 183
Constellation Software, Inc.	527	1 231 976	1 731 337
Open Text Corp.	7 039	337 741	392 002
Shopify Inc., cat. A	30 520	2 492 709	3 148 443
	4 709 705	6 047 965	
Matériaux – 8,4 %			
Mines Agnico Eagle Limitée	13 057	848 460	948 591
Société aurifère Barrick	46 087	1 034 198	1 103 323
First Quantum Minerals Ltd.	14 853	380 269	161 155
Franco-Nevada Corp.	5 032	867 938	738 547
Nutrien Ltd.	13 108	1 212 468	978 512
Ressources Teck Limitée, cat. B, à droit de vote subalterne	12 104	547 695	677 945
Wheaton Precious Metals Corp.	11 955	630 943	781 498
	5 521 971	5 389 571	
Services aux collectivités – 2,2 %			
Emera, Inc.	7 171	377 904	360 701
Fortis, Inc.	12 789	698 027	697 128
Hydro One Ltd.	8 351	283 910	331 535
	1 359 841	1 389 364	
TOTAL DES ACTIONS	58 974 382		64 003 200
COÛTS DE TRANSACTIONS		(430)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS	58 973 952		64 003 200
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,4 %			262 017
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			64 265 217

FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice diversifié d'actions canadiennes à grande capitalisation qui suit les rendements de titres de capitaux propres à grande capitalisation cotés en bourse au Canada.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	43 167	–	43 167	0,1
	43 167	–	43 167	0,1

31 décembre 2022				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	56 729	–	56 729	0,1
	56 729	–	56 729	0,1

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 4 000 \$ ou environ 0,0 % (6 000 \$ ou environ 0,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,6 % (99,6 % au 31 décembre 2022) de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué

de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 6 400 000 \$ (8 483 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débetures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,6	99,6
Services de communication	4,3	5,8
Consommation discrétionnaire	3,8	3,4
Consommation de base	4,2	4,1
Énergie	17,6	18,5
Finance	36,7	35,9
Industrie	13,0	13,8
Technologies de l'information	9,4	5,6
Matériaux	8,4	10,0
Services aux collectivités	2,2	2,5
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT		
TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,8	0,6

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	64 003 200	–	–	64 003 200
	64 003 200	–	–	64 003 200

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2022				
Actions	84 828 343	–	–	84 828 343
	84 828 343	–	–	84 828 343

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	100 878 869	80 633 367
Instruments dérivés	47 035	—
Trésorerie	1 350 942	15 479 967
Dépôt de garantie sur les instruments dérivés	1 657	1 473 283
Montant à recevoir pour la vente de titres	64 036	—
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	146 569	22 185
Total de l'actif	102 489 108	97 608 802
PASSIF		
Passif courant		
Instruments dérivés	—	442 335
Frais de gestion à payer (note 5)	15 180	6 842
Montant à payer pour l'achat de titres	67 550	—
Charges à payer	8 654	3 574
Distributions à verser	—	125 300
Total du passif	91 384	578 051
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	102 397 724	97 030 751
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	22,63	21,68

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	3 992 870	39 348
Intérêts à distribuer	59 199	4
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(597 424)	1 047 129
Gain (perte) net réalisé sur les instruments dérivés	372 188	(12 973)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	4 299 493	(593 817)
Variation du gain (perte) latent sur les instruments dérivés	489 370	(442 335)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	8 615 696	37 356
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(439 922)	(194 282)
Autres revenus	—	37 368
Total des revenus (pertes), montant net	8 175 774	(119 558)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	162 545	6 753
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	91 432	3 798
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	138
Retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts	368 893	5 318
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	33 017	1 372
Coûts de transactions	47 103	—
Total des charges	704 128	17 379
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	7 471 646	(136 937)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	1,64	(0,09)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	4 548 356	1 536 957

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	97 030 751	—
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	7 471 646	(136 937)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(3 227 033)	(1 097 413)
Remboursement de capital	(15 817)	(3 437)
	(3 242 850)	(1 100 850)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	10 038 430	97 292 988
Distributions réinvesties	—	975 550
Paieement au rachat	(8 900 253)	—
	1 138 177	98 268 538
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	5 366 973	97 030 751
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	102 397 724	97 030 751

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	7 471 646	(136 937)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	597 424	(1 047 129)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(4 299 493)	593 817
Variation (du gain) de la perte latent sur les instruments dérivés	(489 370)	442 335
(Gain) perte de change latent	3 404	75 103
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(36 886 535)	(90 964 645)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	20 346 616	10 784 590
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(124 384)	(22 185)
Dépôt de garantie sur les instruments dérivés	1 471 626	(1 473 283)
Charges à payer et autres montants à payer	13 418	10 416
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	(11 895 648)	(81 737 918)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	10 038 430	97 292 988
Montant payé au rachat de parts rachetables	(8 900 253)	—
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(3 368 150)	—
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(2 229 973)	97 292 988
Gain (perte) de change latent	(3 404)	(75 103)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	(14 125 621)	15 555 070
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	15 479 967	—
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	1 350 942	15 479 967
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	59 195	8
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	3 505 747	11 845

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 %			
Australie – 0,0 %			
Yancoal Australia Ltd.	2 600	14 918	11 635
Brésil – 6,2 %			
Ambev SA	44 800	178 297	166 971
Atacadao SA	5 800	22 040	19 601
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	58 400	183 798	230 657
Banco Bradesco SA, priv.	53 200	200 203	246 800
Banco Bradesco SA	16 100	57 604	66 779
Banco BTG Pactual SA	15 200	87 941	155 181
Banco do Brasil SA	8 700	78 130	130 810
Banco Santander Brasil SA	3 800	27 503	33 318
BB Seguridade Participacoes SA	7 100	59 809	64 854
Braskem SA, série A, priv.	2 100	12 190	12 461
Caixa Seguridade Participacoes SA	5 600	11 211	19 610
CCR SA	10 400	28 926	40 031
Centrais Eletricas Brasileiras SA, priv.	2 300	26 519	29 331
Centrais Eletricas Brasileiras SA	12 300	125 380	141 667
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	3 500	51 659	71 607
Cia Energetica de Minas Gerais, priv.	15 900	44 433	49 548
Cia Energetica de Minas Gerais	3 000	12 710	12 321
Cia Siderurgica Nacional SA	6 600	23 238	35 222
Companhia Paranaense de Energia, priv.	9 600	24 781	26 997
Companhia Paranaense de Energia	9 300	21 522	23 957
Cosan SA	12 200	51 438	64 115
CPFL Energia SA	2 100	17 072	21 953
CSN Mineracao SA	3 600	7 097	7 652
Energisa SA	3 300	36 562	48 220
Eneva SA	6 700	20 284	24 753
Engie Brasil Energia SA	2 000	19 157	24 610
Equatorial Energia SA	10 255	70 376	99 435
Gerdau SA, priv.	11 930	89 858	76 945
Hapvida Participacoes e Investimentos SA	48 792	57 551	58 939
Hypera SA	4 500	50 287	43 670
Itaú Unibanco Holding SA, priv.	50 000	322 068	461 059
Itaú Unibanco Holding SA	4 700	31 412	36 795
Itaúsa SA, priv.	55 184	121 405	155 341
JBS SA	6 700	35 494	45 304
Klabin SA	8 500	43 125	51 269
Localiza Rent a Car SA	8 754	121 133	151 131
Localiza Rent a Car SA	31	0	168
Lojas Renner SA	9 300	48 226	43 977
Magazine Luiza SA	31 700	21 373	18 587
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	3 200	17 343	24 687
Natura & Co. Holding SA	8 300	23 263	38 054
Neoenergia SA	2 700	10 281	15 640
NU Holdings Ltd.	23 800	146 032	261 418
PagSeguro Digital Ltd., cat. A	2 200	23 589	36 174
Petroleo Brasileiro SA	38 300	265 377	405 258
Petroleo Brasileiro SA, priv.	47 300	288 066	478 148
Porto Seguro SA	2 000	11 046	15 603
Prio SA	7 500	70 404	93 752
Raia Drogasil SA	13 104	78 981	104 579
Raizen SA, priv.	11 900	10 267	13 018
Rede D'Or Sao Luiz SA	10 100	71 295	78 850
Rumo SA	12 500	57 459	77 872
Sendas Distribuidora SA	13 500	60 646	49 582
StoneCo Ltd., cat. A	2 500	35 135	59 436
Suzano SA	7 100	91 809	107 216
Telefonica Brasil SA	4 200	40 365	60 927
TIM SA	7 800	24 985	37 964
TOTVS SA	5 500	38 288	50 299
Ultrapar Participacoes SA	7 300	22 912	52 532
Vale SA	40 600	897 629	850 814
Vibra Energia SA	11 600	44 073	71 667
WEG SA	15 300	152 153	153 295
XP Inc., cat. A	4 100	84 042	140 941
	5 007 252		6 289 372
Canada – 0,0 %			
Bank of Shanghai Co. Ltd.	10 600	12 324	11 766
Îles Caïmans – 0,0 %			
Zhen Ding Technology Holding Ltd.	7 000	35 872	32 782
Chili – 0,5 %			
Banco de Chile	464 455	61 097	72 577
Banco de Credito e Inversiones SA	978	36 236	35 220
Banco Santander Chile	617 563	33 257	40 096
Cencosud SA	14 188	29 455	35 455
Cia Cervecerias Unidas SA	1 359	11 375	11 512
Cia Sud Americana de Vapores SA	125 941	13 555	10 288
Empresas CMPC SA	11 875	26 173	30 482
Empresas Copec SA	4 340	40 162	42 005
Enel Americas SA	181 329	31 491	26 695
Enel Chile SA	273 158	15 543	23 505
Falabella SA	11 304	28 631	37 550
Latam Airlines Group SA	4 563 554	49 425	65 806
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, priv.	1 422	163 392	113 046
	539 792		544 237

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 %			
Security Technology, Inc.	4 700	6 083	7 873
Interactive Entertainment Network Technology Group Co. Ltd.	1 300	5 164	4 546
Accelink Technologies Co. Ltd.	900	4 651	4 769
ACM Research Shanghai, Inc.	220	4 926	4 271
Advanced Micro-Fabrication Equipment, Inc. China	466	9 713	13 308
AECG Aviation Power Co. Ltd.	1 800	14 769	12 510
Agricultural Bank of China Ltd.	288 000	132 670	146 387
Agricultural Bank of China Ltd.	60 800	34 366	41 147
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd.	6 240	32 739	18 354
Air China Ltd., série H	18 000	21 790	15 016
Air China Ltd.	4 900	10 980	6 687
Akeso, Inc.	5 000	37 214	39 177
Alibaba Group Holding Ltd.	164 600	2 251 676	2 101 330
Aluminum Corp. of China Ltd.	38 000	22 939	25 026
Aluminum Corp. of China Ltd.	10 900	9 847	11 430
Angang Steel Co. Ltd.	26 000	9 718	6 761
Angel Yeast Co. Ltd.	1 100	9 805	7 195
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	11 500	56 707	35 033
Anhui Conch Cement Co. Ltd., série A	2 900	16 334	12 164
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd.	300	16 025	12 985
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd.	1 500	30 522	30 092
Anhui Jianghuai Automobile Group Corp. Ltd.	1 300	4 480	3 903
Anhui Yingjia Distillery Co. Ltd.	800	9 504	9 860
Anjoy Foods Group Co. Ltd.	300	9 615	5 835
Anker Innovations Technology Co. Ltd.	300	5 178	4 942
ANTA Sports Products Ltd.	13 200	228 152	168 849
Asymchem Laboratories Tianjin Co. Ltd.	400	10 120	8 634
Autobio Diagnostics Co. Ltd.	600	6 190	6 360
Autohome Inc., CAAE	700	29 387	25 900
Avary Holding Shenzhen Co. Ltd.	1 800	9 877	7 470
AviChina Industry & Technology Co. Ltd.	23 000	14 815	13 011
BAIC BluePark New Energy Technology Co. Ltd.	3 900	5 292	4 445
Baidu, Inc., CAAE parrainé	2 900	457 179	455 393
Bank of Beijing Co. Ltd.	15 500	13 089	13 055
Bank of Chengdu Co. Ltd.	3 500	9 939	7 327
Bank of China Ltd., série H	862 000	419 439	433 777
Bank of China Ltd.	28 900	17 830	21 439
Bank of Communications Co. Ltd.	69 000	52 907	56 744
Bank of Communications Co. Ltd.	28 200	26 073	30 095
Bank of Hangzhou Co. Ltd.	4 300	10 826	8 003
Bank of Jiangsu Co. Ltd.	10 600	15 009	13 184
Bank of Nanjing Co. Ltd.	7 300	14 523	10 016
Bank of Ningbo Co. Ltd.	4 500	27 771	16 825
Baoshan Iron & Steel Co. Ltd.	15 900	18 062	17 530
BeiGene, Ltd., CAAE	500	135 717	118 911
Beijing Dabeinong Technology Group Co. Ltd.	5 400	8 982	5 984
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	5 500	23 758	25 216
Beijing Kingsoft Office Software, Inc.	267	12 957	15 697
Beijing New Building Materials PLC	2 000	10 381	8 686
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co. Ltd.	1 000	4 610	3 570
Beijing Tiantan Biological Products Corp. Ltd.	1 400	7 937	8 053
Beijing Tongrentang Co. Ltd.	1 100	9 937	10 982
Beijing United Information Technology Co. Ltd.	725	9 618	2 967
Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co. Ltd.	560	12 136	7 822
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd.	27 500	30 063	25 155
Bethel Automotive Safety Systems Co. Ltd.	300	4 281	3 865
Bilibili, Inc., cat. Z	2 620	67 543	41 411
Bloomage Biotechnology Corp. Ltd.	400	9 896	4 978
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	37 000	168 711	132 459
BOE Technology Group Co. Ltd.	29 000	20 115	21 028
BYD Co. Ltd., série H	10 500	379 451	380 152
BYD Co. Ltd.	1 200	62 779	44 175
By-health Co. Ltd.	2 200	10 006	6 966
C&D International Investment Group Ltd.	6 607	25 962	18 565
CALB Group Co. Ltd.	1 500	5 118	4 458
Cambricon Technologies Corp. Ltd.	241	4 940	6 047
Cathay Biotech, Inc.	689	6 806	7 043
CGN Power Co. Ltd.	122 000	38 892	42 027
Changchun High & New Technology Industry Group, Inc.	300	9 868	8 132
Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co. Ltd.	200	5 703	4 875
Chaozhou Three-Circle Group Co. Ltd.	1 700	10 066	9 308
China Cinda Asset Management Co. Ltd.	97 000	18 128	12 776
China CITIC Bank Corp. Ltd.	119 000	71 245	73 950
China Coal Energy Co. Ltd.	26 000	30 700	31 173
China Communications Services Corp. Ltd.	24 000	14 176	13 131
China Construction Bank Corp., série H	970 000	796 237	761 671
China Construction Bank Corp.	9 300	10 191	11 256
China CSSC Holdings Ltd.	3 100	13 661	16 968
China Eastern Airlines Corp. Ltd.	18 000	10 473	6 839
China Eastern Airlines Corp. Ltd.	9 000	10 057	6 492
China Energy Engineering Corp. Ltd.	80 000	12 553	10 537
China Energy Engineering Corp. Ltd.	24 800	11 202	9 683
China Everbright Bank Co. Ltd.	77 000	31 316	30 166
China Everbright Bank Co. Ltd.	30 500	18 470	16 445

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
China Feihe Ltd.	33 000	38 827	23 795
China Galaxy Securities Co. Ltd.	47 000	31 545	32 779
China Greatwall Technology Group Co. Ltd.	2 400	4 887	4 516
China Hongqiao Group Ltd.	26 000	34 533	28 055
China International Capital Corp. Ltd.	15 200	39 571	29 415
China International Capital Corp. Ltd.	1 300	9 592	9 197
China Jinmao Holdings Group Ltd.	74 372	23 282	9 419
China Jushi Co. Ltd.	3 600	9 962	6 579
China Lesso Group Holdings Ltd.	11 000	16 194	7 579
China Life Insurance Co. Ltd., série H	77 000	163 437	131 587
China Life Insurance Co. Ltd.	1 500	10 307	7 906
China Literature Ltd.	4 000	20 135	19 622
China Longyuan Power Group Corp. Ltd.	32 000	49 010	31 990
China Medical System Holdings Ltd.	14 000	30 753	32 719
China Merchants Bank Co. Ltd.	38 000	274 480	174 540
China Merchants Bank Co. Ltd.	13 900	99 324	71 896
China Merchants Energy Shipping Co. Ltd.	8 300	9 617	9 074
China Merchants Securities Co. Ltd.	5 700	14 787	14 455
China Merchants Securities Co. Ltd.	5 600	5 877	6 043
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co. Ltd.	5 100	13 972	9 036
China Minsheng Banking Corp. Ltd.	66 000	30 945	29 535
China Minsheng Banking Corp. Ltd.	25 700	17 632	17 870
China National Building Material Co. Ltd., série H	44 000	51 326	24 817
China National Chemical Engineering Co. Ltd.	5 800	9 614	6 858
China National Nuclear Power Co. Ltd.	14 200	17 268	19 801
China National Software & Service Co. Ltd.	700	4 537	4 719
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co. Ltd.	2 600	13 066	9 349
China Oilfield Services Ltd.	22 000	35 456	29 646
China Overseas Property Holdings Ltd.	15 000	21 635	14 843
China Pacific Insurance Group Co. Ltd.	25 000	78 025	66 533
China Pacific Insurance Group Co. Ltd.	4 900	23 477	21 664
China Petroleum & Chemical Corp., série H	244 000	159 384	168 522
China Petroleum & Chemical Corp.	24 200	21 103	25 106
China Power International Development Ltd.	47 000	23 531	22 778
China Railway Group Ltd., série H	34 000	25 057	19 980
China Railway Group Ltd.	15 100	17 624	15 946
China Railway Signal & Communication Corp. Ltd., série H	16 000	6 689	7 025
China Railway Signal & Communication Corp. Ltd.	5 618	4 958	4 575
China Rare Earth Resources & Technology Co. Ltd.	900	5 122	4 630
China Resources Building Materials Technology Holdings Ltd.	24 000	17 688	6 890
China Resources Microelectronics Ltd.	906	9 756	7 528
China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd.	6 000	41 177	28 218
China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd.	1 100	10 045	10 171
China Ruyi Holdings Ltd.	60 000	19 515	17 528
China Shenhua Energy Co. Ltd.	4 600	25 802	26 812
China Southern Airlines Co. Ltd.	18 000	16 376	10 061
China Southern Airlines Co. Ltd.	6 700	10 040	7 175
China State Construction Engineering Corp. Ltd.	28 500	31 456	25 487
China State Construction International Holdings Ltd.	20 000	29 349	30 497
China Suntien Green Energy Corp. Ltd.	22 000	11 792	10 551
China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd.	20 200	22 339	16 412
China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd.	1 300	55 288	20 228
China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd.	900	32 728	11 649
China Tower Corp. Ltd., série H	442 000	64 879	61 204
China United Network Communications Ltd.	21 500	19 825	17 508
China Vanke Co. Ltd., série H	20 700	61 022	25 238
China Vanke Co. Ltd.	6 800	25 713	13 224
China Yangtze Power Co. Ltd.	15 400	62 076	66 827
China Zhenhua Group Science & Technology Co. Ltd.	500	11 027	5 470
China Zheshang Bank Co. Ltd.	22 360	11 923	10 476
China Zheshang Bank Co. Ltd.	22 000	7 604	7 504
Chongqing Brewery Co. Ltd.	400	9 888	4 942
Chongqing Changan Automobile Co. Ltd.	5 700	15 067	17 836
Chongqing Changan Automobile Co. Ltd.	40 300	26 237	29 807
Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd., série H	40 000	19 628	20 467
Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd.	1 650	22 488	18 747
CITIC Securities Co. Ltd., série H	19 500	53 723	52 489
CITIC Securities Co. Ltd.	8 700	34 403	32 949
CMOC Group Ltd.	39 000	25 050	28 121
CMOC Group Ltd.	14 500	13 298	14 019
CNGR Advanced Material Co. Ltd.	500	5 166	4 567
CNPC Capital Co. Ltd.	4 500	5 081	4 518
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd.	2 680	171 965	81 348
COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd., série H	12 000	14 662	14 935
COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd.	3 700	9 592	8 420
COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd.	31 000	43 452	41 094
COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd.	9 000	20 543	16 030
Country Garden Services Holdings Co. Ltd.	24 000	84 409	27 356
CRRC Corp. Ltd., série H	38 000	21 239	22 074
CRRC Corp. Ltd.	18 200	18 672	17 799
CSC Financial Co. Ltd.	3 000	14 152	13 197
CSC Financial Co. Ltd.	9 000	10 663	10 487
CSPC Innovation Pharmaceutical Co. Ltd.	900	5 016	6 128
CSSC Science & Technology Co. Ltd.	1 500	5 022	5 171

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
Dagun Railway Co. Ltd.	10 500	13 589	14 075
DaShenLin Pharmaceutical Group Co. Ltd.	1 400	6 468	6 481
Datang International Power Generation Co. Ltd.	48 000	9 985	9 970
Dong-E-E-Jiao Co. Ltd.	800	7 311	7 336
Dongfang Electric Corp. Ltd.	2 500	9 775	6 795
Dongfang Electric Corp. Ltd., série H	4 400	9 556	5 305
Dongfeng Motor Group Co. Ltd., série H	28 000	21 013	18 393
East Buy Holding Ltd.	4 500	24 794	21 125
East Money Information Co. Ltd.	10 800	40 177	28 192
Eastroc Beverage Group Co. Ltd.	300	10 181	10 180
Ecovacs Robotics Co. Ltd.	600	9 284	4 623
Empyrean Technology Co. Ltd.	300	5 833	5 904
ENN Energy Holdings Ltd.	7 700	143 215	74 765
ENN Natural Gas Co. Ltd.	3 000	9 751	9 382
Eoptolink Technology, Inc. Ltd.	800	4 658	7 336
Eve Energy Co. Ltd.	1 300	23 718	10 200
Everbright Securities Co. Ltd.	3 300	9 799	9 461
Far East Horizon Ltd.	14 000	14 562	14 516
Flat Glass Group Co. Ltd.	4 000	12 948	8 903
Flat Glass Group Co. Ltd.	1 500	9 780	7 446
Focus Media Information Technology Co. Ltd.	10 300	13 269	12 103
Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd.	2 760	40 499	19 474
Founder Securities Co. Ltd.	4 800	8 673	7 193
Foxconn Industrial Internet Co. Ltd.	6 300	11 593	17 710
Fujian Kuncai Material Technology Co. Ltd.	600	6 534	6 585
Full Truck Alliance Co. Ltd.	8 000	93 851	73 947
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd., série H	6 400	38 241	41 068
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd.	1 700	12 062	11 818
Ganfeng Lithium Group Co. Ltd.	1 200	18 465	9 549
Ganfeng Lithium Group Co. Ltd.	3 800	43 147	18 930
GD Power Development Co. Ltd.	13 200	10 317	10 209
GDS Holdings Ltd., CAAE	1 000	20 758	12 026
GEM Co. Ltd.	6 600	9 954	6 700
Gemdale Corp.	4 700	9 969	3 810
Genscript Biotech Corp.	12 000	44 977	40 244
GF Securities Co. Ltd.	10 200	20 338	16 088
GF Securities Co. Ltd.	4 600	13 930	12 221
Giant Biogene Holding Co. Ltd.	4 400	23 413	26 451
Giant Network Group Co. Ltd.	2 300	5 343	4 764
GigaDevice Semiconductor, Inc.	500	9 876	8 589
Guilong Technologies Co. Ltd.	300	9 929	3 899
GoerTek, Inc.	2 900	9 921	11 328
Goldwind Science & Technology Co. Ltd.	7 600	9 621	4 505
Goldwind Science & Technology Co. Ltd.	4 600	9 784	6 842
GoodWe Technologies Co. Ltd.	236	14 274	5 730
Gotion High-tech Co. Ltd.	1 600	9 713	6 396
Great Wall Motor Co. Ltd.	1 900	11 272	8 909
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai	4 000	25 761	23 925
Greentown China Holdings Ltd.	10 000	24 470	13 425
Guangdong Haid Group Co. Ltd.	1 200	13 963	10 020
Guanghui Energy Co. Ltd.	5 200	9 732	6 903
Guangzhou Automobile Group Co. Ltd., série H	30 000	29 157	18 390
Guangzhou Automobile Group Co. Ltd.	4 300	9 931	6 995
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	2 000	8 005	7 346
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	1 600	9 801	8 508
Guangzhou Great Power Energy & Technology Co. Ltd.	700	11 573	3 682
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd.	500	5 846	5 817
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co. Ltd.	800	9 463	6 806
Guangzhou Tinci Materials Technology Co. Ltd.	1 400	13 632	6 528
Guolian Securities Co. Ltd.	2 400	4 810	4 837
Guosen Securities Co. Ltd.	5 700	9 940	9 050
Guotai Junan Securities Co. Ltd.	8 400	13 018	12 468
Guotai Junan Securities Co. Ltd.	6 100	16 472	16 876
H World Group Ltd., CAAE	2 000	115 629	88 188
Haidilao International Holding Ltd.	17 000	61 071	41 740
Haier Smart Home Co. Ltd.	4 600	22 347	17 960
Haier Smart Home Co. Ltd., série H	23 800	109 729	88 619
Hainan Airlines Holding Co. Ltd.	37 400	10 254	9 526
Hainan Airport Infrastructure Co. Ltd.	9 300	6 612	6 398
Haitong Securities Co. Ltd.	12 800	11 017	9 013
Haitong Securities Co. Ltd.	13 200	22 769	22 996
Hangzhou Chang Chuan Technology Co. Ltd.	600	4 549	4 238
Hangzhou First Applied Material Co. Ltd.	1 260	13 190	5 686
Hangzhou Oxygen Plant Group Co. Ltd.	800	5 031	4 345
Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd.	1 400	9 686	5 942
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd.	600	10 991	6 132
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd.	1 300	17 271	7 760
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.	12 000	29 804	31 936
Henan Shenhua Coal & Power Co. Ltd.	1 600	4 986	4 998
Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd.	2 200	10 857	10 925
Hengli Petrochemical Co. Ltd.	4 100	13 261	10 039
Hengtong Optic-electric Co. Ltd.	1 900	4 720	4 218
Hisense Home Appliances Group Co. Ltd.	2 000	7 696	5 694
Hisense Home Appliances Group Co. Ltd.	1 100	4 916	4 172
Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd.	400	9 132	11 666

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
Horizon Construction Development Ltd.	518	390	401
Hoshine Silicon Industry Co. Ltd.	500	8 837	4 741
Hoyuan Green Energy Co. Ltd.	558	10 109	3 453
Hua Hong Semiconductor Ltd.	8 000	39 057	25 506
Huadian Power International Corp. Ltd.	26 000	13 284	15 235
Huadong Medicine Co. Ltd.	1 300	11 101	10 021
Huagong Tech Co. Ltd.	900	4 786	4 980
Huaibei Mining Holdings Co. Ltd.	2 800	8 590	8 657
Hualan Biological Engineering, Inc.	2 300	9 851	9 463
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc.	3 600	5 043	5 776
Huaneng Power International, Inc.	38 000	22 604	26 566
Huaneng Power International, Inc.	7 400	10 129	10 594
Huatai Securities Co. Ltd.	13 200	20 757	21 978
Huatai Securities Co. Ltd.	6 100	15 250	15 821
Huaxia Bank Co. Ltd.	9 800	10 046	10 240
Huayu Automotive Systems Co. Ltd.	2 800	9 705	8 475
Huizhou Desay Sv Automotive Co. Ltd.	400	9 066	9 632
Humanwell Healthcare Group Co. Ltd.	1 100	4 856	5 084
Hundsun Technologies, Inc.	1 400	10 585	7 486
Hygeia Healthcare Holdings Co. Ltd.	3 800	34 037	22 652
IEIT Systems Co. Ltd.	900	5 075	5 555
Iflytek Co. Ltd.	1 800	11 764	15 522
Imeik Technology Development Co. Ltd.	100	10 181	5 472
Industrial & Commercial Bank of China Ltd., série H	708 000	475 472	456 709
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	44 000	36 848	39 103
Industrial Bank Co. Ltd., cat. A	14 000	47 789	42 193
Industrial Securities Co. Ltd.	8 500	9 832	9 277
Ingenic Semiconductor Co. Ltd.	300	4 180	3 606
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co. Ltd.	32 300	12 243	8 768
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd.	4 400	27 027	21 883
Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd.	12 500	24 402	25 400
Innovent Biologics, Inc.	12 500	72 427	90 238
iQIYI, Inc., CAAE	4 400	23 637	28 313
Isoltstone Information Technology Group Co. Ltd.	700	4 446	6 013
JA Solar Technology Co. Ltd.	2 240	22 261	8 629
JCET Group Co. Ltd.	2 000	9 501	11 103
JD Health International, Inc.	10 200	113 168	67 347
JD Logistics, Inc.	18 900	51 101	31 214
JD.com, Inc., cat. A	25 350	445 760	481 585
Jiangsu Eastern Shenghong Co. Ltd.	3 500	9 664	6 247
Jiangsu Expressway Co. Ltd.	14 000	16 884	16 596
Jiangsu Hengli Hydraulic Co. Ltd., série A	900	11 489	9 150
Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co. Ltd.	4 400	32 565	37 001
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd.	1 000	9 619	9 064
Jiangsu Pacific Quartz Co. Ltd.	300	5 257	4 846
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd., cat. A	1 000	31 627	20 433
Jiangsu Yoke Technology Co. Ltd.	500	5 295	5 181
Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co. Ltd.	1 100	6 864	7 072
Jiangsu Zhongtian Technology Co. Ltd.	3 300	9 527	7 663
Jiangxi Copper Co. Ltd., série H	14 000	28 639	26 100
Jiangxi Special Electric Motor Co. Ltd.	1 800	6 531	4 518
Jinko Solar Co. Ltd.	2 918	5 095	4 807
Jiuguai Liquor Co. Ltd.	400	10 764	5 440
Joinn Laboratories China Co. Ltd.	2 240	12 224	4 864
Juneyao Airlines Co. Ltd.	2 000	5 244	4 462
Kanzhun Ltd.	2 900	76 368	63 516
KE Holdings Inc., CAAE	9 200	191 341	196 645
Kingdee International Software Group Co. Ltd.	28 000	75 590	53 808
Kingnet Network Co. Ltd.	2 500	5 148	5 192
Kingsoft Corp. Ltd.	9 400	41 297	38 255
Kuaishou Technology	21 100	216 670	188 665
Kuang-Chi Technologies Co. Ltd.	2 900	9 591	7 969
Kunlun Tech Co. Ltd.	700	4 823	4 867
Kweichow Moutai Co. Ltd., cat. A	800	275 628	256 722
Lao Feng Xiang Co. Ltd.	1 100	5 183	5 006
Lao Feng Xiang Co. Ltd.	400	4 691	5 131
LB Group Co. Ltd.	2 700	10 409	8 599
Lens Technology Co. Ltd.	4 600	9 666	11 289
Lepu Medical Technology Beijing Co. Ltd., série A	2 200	9 410	6 610
Li Auto, Inc., cat. A	10 300	170 853	255 854
Li Ning Co. Ltd.	24 500	257 613	86 468
Liaoning Port Co. Ltd.	49 100	15 595	13 237
Livzon Pharmaceutical Group, Inc.	900	6 084	5 858
Livzon Pharmaceutical Group, Inc.	1 300	5 136	5 302
Longfor Group Holdings Ltd.	21 515	89 872	45 414
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd.	5 100	44 821	21 714
Lufax Holding Ltd., CAAE	1 500	15 871	6 072
Luxshare Precision Industry Co. Ltd.	4 800	29 263	30 744
Luzhou Laojiao Co. Ltd.	1 000	42 518	33 358
Mango Excellent Media Co. Ltd.	1 900	10 317	8 902
Maxscend Microelectronics Co. Ltd.	400	8 896	10 486
Meihua Holdings Group Co. Ltd.	2 800	5 044	4 972
Meituan, cat. B	47 190	1 435 270	652 644
Metallurgical Corp. of China Ltd.	31 000	9 384	7 957
Metallurgical Corp. of China Ltd.	15 400	9 799	8 761
Microport Scientific Corp.	7 300	23 811	10 380
Ming Yang Smart Energy Group Ltd.	2 100	10 199	4 896
MINISO Group Holding Ltd.	4 600	40 797	31 188
Mintn Group Ltd.	8 000	23 707	21 318

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
Montage Technology Co. Ltd.	798	10 171	8 718
Muyuan Foods Co. Ltd.	3 600	33 681	27 563
NARI Technology Co. Ltd.	5 520	26 999	22 907
National Silicon Industry Group Co. Ltd.	1 441	4 925	4 640
NAURA Technology Group Co. Ltd.	400	18 413	18 273
NetEase, Inc.	18 400	435 506	436 864
New China Life Insurance Co. Ltd.	8 400	27 135	21 589
New China Life Insurance Co. Ltd.	1 800	9 990	10 418
New Hope Liuhe Co. Ltd.	3 800	9 664	6 585
New Oriental Education & Technology Group, Inc., CAAE	1 600	84 424	154 603
Ninestar Corp.	1 000	10 139	4 207
Ningbo Deye Technology Co. Ltd.	360	16 781	5 616
Ningbo Orient Wires & Cables Co. Ltd.	800	10 566	6 359
Ningbo Shanshan Co. Ltd.	2 700	9 693	6 837
Ningbo Tuopu Group Co. Ltd.	800	9 697	10 932
Ningbo Zhoushan Port Co. Ltd.	14 100	9 969	9 333
Ningxia Baofeng Energy Group Co. Ltd.	4 200	10 879	11 534
NIO, Inc., CAAE	13 900	210 923	166 240
Nongfu Spring Co. Ltd.	18 600	141 459	141 812
OFILM Group Co. Ltd.	2 500	4 626	4 048
Onewo, Inc.	1 200	9 137	5 046
OPPEIN Home Group Inc., cat. A	400	9 784	5 177
Orient Securities Co. Ltd.	5 700	9 851	9 220
Orient Securities Co. Ltd.	7 600	4 957	4 428
Pacific Securities Co. Ltd.	7 000	5 022	4 815
Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co. Ltd.	9 800	9 527	5 976
PDD Holdings, Inc., CAAE	6 700	815 098	1 292 593
People.cn Co. Ltd.	800	4 987	4 162
People's Insurance Co. Group of China Ltd.	81 000	37 167	32 828
People's Insurance Co. Group of China Ltd.	9 800	9 950	8 819
PetroChina Co. Ltd.	216 000	135 169	188 211
PetroChina Co. Ltd.	16 700	16 776	21 921
Pharmaron Beijing Co. Ltd.	1 200	11 223	6 466
PICC Property & Casualty Co. Ltd.	72 000	95 182	112 830
Ping An Bank Co. Ltd.	13 200	33 970	23 045
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd., série H	63 500	554 699	379 058
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	7 500	68 160	56 195
Poly Developments & Holdings Group Co. Ltd.	8 100	25 183	14 909
Poly Property Services Co. Ltd.	1 600	13 668	7 781
Pop Mart International Group Ltd.	7 200	26 835	24 621
Postal Savings Bank of China Co. Ltd.	114 000	93 638	71 805
Postal Savings Bank of China Co. Ltd.	19 700	17 545	15 933
Power Construction Corp. of China Ltd.	10 400	14 583	9 455
Pylon Technologies Co. Ltd.	226	14 580	4 454
Qi An Xin Technology Group, Inc.	569	4 935	4 241
Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd.	3 800	18 286	11 269
Range Intelligent Computing Technology Group Co. Ltd.	1 100	4 789	5 189
Remegen Co. Ltd.	1 500	14 123	9 486
Rongsheng Petrochemical Co. Ltd.	6 600	16 137	12 700
SAIC Motor Corp. Ltd.	5 800	17 195	14 590
Sailun Group Co. Ltd.	2 300	4 915	5 025
Sanan Optoelectronics Co. Ltd.	1 700	4 830	4 378
Sangfor Technologies, Inc.	500	10 509	6 720
Sany Heavy Equipment International Holdings Co. Ltd.	11 000	19 204	14 024
Sany Heavy Industry Co. Ltd.	5 900	18 875	15 105
Satellite Chemical Co. Ltd.	3 400	10 036	9 324
SDIC Power Holdings Co. Ltd.	3 500	7 852	8 577
Sealand Securities Co. Ltd.	13 200	8 660	8 688
Seazen Holdings Co. Ltd.	2 300	10 163	4 879
SenseTime Group, Inc.	196 000	71 129	38 393
Seres Group Co. Ltd.	800	9 969	11 334
SF Holding Co. Ltd.	3 300	37 560	24 787
SG Micro Corp.	390	11 581	6 454
Shaanxi Coal Industry Co. Ltd.	6 500	24 258	25 245
Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co. Ltd.	3 700	6 586	6 714
Shandong Gold Mining Co. Ltd.	3 100	11 610	13 181
Shandong Gold Mining Co. Ltd.	8 000	20 846	20 021
Shandong Hi-Speed Holdings Group Ltd.	33 000	32 662	33 826
Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co. Ltd.	1 600	10 140	8 207
Shandong Nanshan Aluminum Co. Ltd.	14 700	9 758	8 035
Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd.	2 300	5 211	5 204
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd.	27 200	56 439	34 954
Shanghai Aiko Solar Energy Co. Ltd.	1 300	4 789	4 264
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co. Ltd.	1 300	9 640	5 948
Shanghai Baosight Software Co. Ltd.	1 560	12 419	14 154
Shanghai Baosight Software Co. Ltd.	6 480	25 865	18 114
Shanghai Electric Group Co. Ltd., série H	32 000	10 043	8 808
Shanghai Electric Group Co. Ltd.	12 500	9 868	9 691
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd.	5 000	22 004	14 354
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd.	1 700	12 420	7 911
Shanghai Fudan Microelectronics Group Co. Ltd.	3 000	15 868	7 143
Shanghai International Airport Co. Ltd., cat. A	1 700	19 528	10 361
Shanghai International Port Group Co. Ltd.	9 400	9 784	8 564
Shanghai Jinjiang International Hotels Co. Ltd.	900	10 064	5 003
Shanghai Junshi Biosciences Co. Ltd.	794	8 490	6 175

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
Shanghai Junshi Biosciences Co. Ltd.	1 600	9 038	5 252
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co. Ltd.	9 100	5 098	3 912
Shanghai M&G Stationery, Inc.	1 000	10 367	6 981
Shanghai MicroPort MedBot Group Co. Ltd.	2 500	13 444	8 802
Shanghai Moons' Electric Co. Ltd.	400	5 010	4 897
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd.	6 900	16 059	13 306
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd.	2 700	9 947	8 398
Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd.	20 100	28 651	24 739
Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd.	1 450	14 498	5 642
Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd.	5 800	8 028	8 627
Shanghai Rural Commercial Bank Co. Ltd.	8 800	10 127	9 391
Shanghai Zhangjiang High-Tech Park Development Co. Ltd.	1 100	4 691	3 947
Shanxi Coal International Energy Group Co. Ltd.	1 500	5 077	4 883
Shanxi Coking Coal Energy Group Co. Ltd.	3 100	5 591	5 694
Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co. Ltd.	2 800	9 760	11 406
Shanxi Meijin Energy Co. Ltd.	5 400	9 703	6 687
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd.	800	44 386	34 318
Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd.	16 600	13 040	13 703
Shenzhen Capchem Technology Co. Ltd.	800	6 930	7 035
Shenzhen Dynanonic Co. Ltd.	320	12 405	3 631
Shenzhen Goodix Technology Co. Ltd.	300	4 225	3 854
Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd.	1 800	24 821	21 130
Shenzhen Kaifa Technology Co. Ltd.	1 700	5 410	5 123
Shenzhen Longsys Electronics Co. Ltd.	300	5 682	5 134
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd.	800	48 643	43 223
Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co. Ltd.	500	5 918	7 270
Shenzhen Overseas Chinese Town Co. Ltd.	9 300	10 155	5 377
Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd.	1 200	7 047	7 287
Shenzhen SC New Energy Technology Corp.	400	8 731	5 504
Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd.	652	10 218	16 777
Shenzhen International Group Holdings Ltd.	8 100	110 753	109 972
Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co. Ltd.	1 200	9 584	5 147
Sichuan Changhong Electric Co. Ltd.	4 300	4 782	4 229
Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd.	4 400	9 851	12 369
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co. Ltd.	900	4 700	4 861
Sichuan Road & Bridge Group Co. Ltd.	6 580	13 222	9 163
Sieyuan Electric Co. Ltd.	500	4 633	4 838
Sinoma Science & Technology Co. Ltd.	2 200	9 933	6 512
Sinopec Shanghai Petrochemical Co. Ltd.	72 000	17 911	13 739
Sinopharm Group Co. Ltd.	14 400	49 798	49 728
Sinotrans Ltd., série H	24 000	10 960	13 253
Smoores International Holdings Ltd.	17 000	32 471	18 660
Songcheng Performance Development Co. Ltd.	3 500	10 070	6 423
Spring Airlines Co. Ltd., cat. A	500	4 890	4 667
StarPower Semiconductor Ltd.	200	12 513	6 730
Sungrow Power Supply Co. Ltd.	1 000	19 110	16 285
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	7 000	118 303	83 749
Sunwoda Electronic Co. Ltd.	2 200	10 075	6 037
SUPCON Technology Co. Ltd.	835	13 028	7 040
Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co. Ltd.	2 000	9 501	6 760
Suzhou Maxwell Technologies Co. Ltd.	160	10 122	3 853
Suzhou TFC Optical Communication Co. Ltd.	300	3 906	5 105
TAL Education Group, cat. A, CAAE	4 600	36 941	76 608
Talkweb Information System Co. Ltd.	1 500	4 669	4 194
TBEA Co. Ltd.	3 640	13 526	9 339
TCL Technology Group Corp.	14 520	10 827	11 608
TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co. Ltd.	2 875	20 316	8 360
Tencent Holdings Ltd.	63 600	3 597 293	3 153 231
Tencent Music Entertainment Group, CAAE	6 600	72 195	78 412
Thunder Software Technology Co. Ltd.	500	10 312	7 442
Tianqi Lithium Corp.	1 000	17 154	10 373
Tianqi Lithium Corp.	1 200	13 594	8 744
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	20 000	47 861	32 152
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	12 000	37 633	29 261
TongFu Microelectronics Co. Ltd.	1 300	5 033	5 588
Tongkun Group Co. Ltd.	3 300	8 801	9 283
Tongwei Co. Ltd.	3 100	24 794	14 426
Topchoice Medical Corp.	300	8 578	4 264
Topsports International Holdings Ltd.	26 000	25 442	26 694
TravelSky Technology Ltd., série H	10 000	28 046	22 797
Trina Solar Co. Ltd.	1 466	15 838	7 776
Trip.com Group Ltd.	5 846	276 966	274 044
Tsinghua Tongfang Co. Ltd.	3 100	4 795	4 236
Tsingtao Brewery Co. Ltd., série H	6 000	78 864	53 092
Tsingtao Brewery Co. Ltd.	500	10 498	6 949
Unigroup Guoxin Microelectronics Co. Ltd.	600	14 981	7 524
Uni-President China Holdings Ltd.	13 000	17 603	12 184
Unisplendour Corp. Ltd.	2 600	9 824	9 354
Verisilicon Microelectronics Shanghai Co. Ltd.	485	4 910	4 505
Vipshop Holdings Ltd., AAAE	3 800	70 339	88 990
Walvax Biotechnology Co. Ltd.	1 300	10 044	5 682
Wanhua Chemical Group Co. Ltd., série A	2 100	37 539	29 993
Want Want China Holdings Ltd.	48 000	43 982	38 258
Weibo Corp., CAAE parrainé	900	21 404	12 995

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Chine – 23,1 % (suite)			
Weichai Power Co. Ltd.	18 000	33 742	39 636
Weichai Power Co. Ltd.	5 900	12 282	14 973
Wens Foodstuffs Group Co. Ltd.	4 700	17 236	17 529
Western Superconducting Technologies Co. Ltd.	749	12 028	7 413
Will Semiconductor Co. Ltd. Shanghai	800	12 833	15 872
Wingtech Technology Co. Ltd.	900	9 597	7 080
Wuhan Guide Infrared Co. Ltd.	5 850	11 790	7 940
Wuhan Jingce Electronic Group Co. Ltd.	300	4 740	4 887
Wuliangye Yibin Co. Ltd.	2 400	84 480	62 608
WUS Printed Circuit Kunshan Co. Ltd.	1 300	4 734	5 346
WuXi AppTec Co. Ltd., série H	3 500	46 035	46 957
WuXi AppTec Co. Ltd.	1 800	27 368	24 350
Wuxi Biologics Cayman, Inc.	38 000	333 960	189 941
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co. Ltd.	1 200	9 926	5 712
XCMG Construction Machinery Co. Ltd.	9 700	9 963	9 847
Xiamen C & D, Inc.	3 600	10 174	6 446
Xiaomi Corp.	164 200	319 407	432 554
Xinjiang Daqo New Energy Co. Ltd.	736	4 932	4 046
XPeng, Inc.	11 700	79 978	112 024
Yadea Group Holdings Ltd.	12 000	26 785	27 802
Yankuang Energy Group Co. Ltd., série H	23 000	80 779	57 637
Yankuang Energy Group Co. Ltd.	2 400	14 424	8 839
Yealink Network Technology Corp. Ltd.	1 120	11 688	6 153
Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd.	1 120	11 424	8 338
Yihai Kerry Arawana Holdings Co. Ltd.	1 100	9 538	6 827
Yintai Gold Co. Ltd.	2 000	5 120	5 578
Yonghui Superstores Co. Ltd.	8 800	5 022	4 614
YongXing Special Materials Technology Co. Ltd.	650	12 032	6 310
Yonyou Network Technology Co. Ltd.	2 400	10 431	7 938
YSB, Inc.	3 000	11 597	4 174
YTO Express Group Co. Ltd.	2 400	9 705	5 484
Yunda Holding Co. Ltd.	3 600	10 096	4 993
Yunnan Aluminium Co. Ltd.	4 400	9 816	9 997
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd.	1 200	13 329	10 966
Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co. Ltd.	400	10 492	5 070
Yunnan Energy New Material Co. Ltd.	600	16 438	6 338
Yunnan Yuntianhua Co. Ltd.	2 200	9 937	6 381
Yutong Bus Co. Ltd., série A	1 900	4 853	4 681
Zai Lab Ltd., CAAE	900	37 575	32 434
Zangge Mining Co. Ltd.	1 600	7 264	7 538
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co. Ltd.	400	22 159	17 997
Zhaojin Mining Industry Co. Ltd., série H	14 000	31 619	22 956
Zhejiang Century Huatong Group Co. Ltd.	4 500	4 919	4 317
Zhejiang China Commodities City Group Co. Ltd.	3 100	4 998	4 219
Zhejiang Chint Electrics Co. Ltd.	1 800	9 650	7 199
Zhejiang Dahua Technology Co. Ltd.	2 500	10 004	8 576
Zhejiang Expressway Co. Ltd.	22 080	20 778	19 426
Zhejiang Huayou Cobalt Co. Ltd.	1 100	13 186	6 735
Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd.	900	12 311	7 378
Zhejiang Juhua Co. Ltd.	3 200	9 904	9 811
Zhejiang Leapmotor Technology Co. Ltd.	6 800	39 997	40 994
Zhejiang NHU Co. Ltd.	2 600	9 758	8 198
Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co. Ltd.	2 500	11 435	13 665
Zhejiang Zheneng Electric Power Co. Ltd.	6 900	5 900	5 914
Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co. Ltd.	3 600	5 062	5 204
Zheshang Securities Co. Ltd.	5 000	9 810	9 696
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.	7 300	27 126	21 992
Zhongji Innolight Co. Ltd.	400	7 990	8 397
Zhongjin Gold Corp. Ltd.	2 400	4 942	4 444
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	8 000	59 069	25 235
Zhongtai Securities Co. Ltd.	10 300	13 400	13 137
Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.	5 500	36 760	20 711
Zijin Mining Group Co. Ltd.	58 000	111 076	124 583
Zijin Mining Group Co. Ltd.	14 900	29 637	34 517
ZJLD Group, Inc.	3 800	8 532	6 301
Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co. Ltd.	8 900	9 823	10 805
Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co. Ltd., série H	15 200	9 804	11 037
ZTE Corp.	8 000	24 793	23 560
ZTE Corp.	3 100	15 725	15 262
ZTO Express (Cayman) Inc., CAAE	4 200	154 254	117 851
	27 075 036	23 641 656	
Colombie – 0,1 %			
Bancolombia SA, priv.	4 446	38 858	45 278
Bancolombia SA	2 487	30 200	28 104
Ecopetrol SA	51 300	33 066	40 859
Interconexión Eléctrica SA ESP	4 693	24 603	24 727
	126 727	138 968	
République tchèque – 0,1 %			
CEZ AS	1 689	77 383	95 513
Komerční Banka AS	820	31 955	35 051
	109 338	130 564	
Égypte – 0,2 %			
Abou Kir Fertilizers & Chemical Industries	3 426	7 046	12 176
Commercial International Bank – Egypt (CIB)	24 416	59 439	75 935
EFG Holding S.A.E.	12 376	11 801	8 797
ElSewedy Electric Co.	7 098	4 461	8 659

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Égypte – 0,2 % (suite)			
Ezz Steel Co. SAE	1 449	4 738	5 557
Misr Fertilizers Production Co. SAE	3 112	15 702	72 582
Telecom Egypt Co.	4 032	4 990	6 304
	108 177		190 010
Grèce – 0,4 %			
Alpha Services & Holdings SA	20 526	30 389	46 013
Eurobank Ergasias Services & Holdings SA	24 667	36 805	57 847
Hellenic Telecommunications Organization SA	1 765	37 916	33 164
JUMBO SA	1 079	24 696	39 480
Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	572	17 494	19 796
Mytilineos SA	1 083	30 344	57 894
National Bank of Greece SA	5 347	28 916	48 989
OPAP SA	2 089	41 100	46 768
Piraeus Financial Holdings SA	6 879	16 505	32 064
Public Power Corp. SA	1 998	18 969	32 479
Star Bulk Carriers Corp.	800	20 853	22 427
Terna Energy SA	600	17 515	13 896
	321 502		450 817
Hong Kong – 1,1 %			
Beijing Enterprises Water Group Ltd.	46 000	16 302	13 516
China Everbright Environment Group Ltd.	39 000	23 877	16 728
China Merchants Port Holdings Co. Ltd.	14 769	28 972	26 536
China Overseas Land & Investment Ltd.	38 500	138 595	89 458
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	16 000	154 555	92 404
China Resources Gas Group Ltd.	9 800	50 168	42 365
China Resources Land Ltd.	30 000	185 858	141 848
China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	18 000	20 470	15 593
China Resources Power Holdings Co. Ltd.	18 000	44 313	47 539
China Shenhua Energy Co. Ltd., série H	34 500	137 291	155 842
China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd.	15 600	25 442	17 703
CITIC Ltd.	64 000	88 919	84 298
Country Garden Holdings Co. Ltd.	146 000	74 701	19 230
Great Wall Motor Co. Ltd., cat. H	22 000	40 859	37 671
Guangdong Investment Ltd.	32 000	44 071	30 693
Haitian International Holdings Ltd.	6 000	20 085	19 575
Hengan International Group Co. Ltd.	6 500	45 224	31 886
Kunlun Energy Co. Ltd.	40 000	40 826	47 553
Lenovo Group Ltd.	72 000	81 078	132 769
Orient Overseas International Ltd.	1 500	32 799	27 610
Sinotruk Hong Kong Ltd.	7 500	14 304	19 403
Xinyi Solar Holdings Ltd.	46 000	69 868	35 421
Yuexiu Property Co. Ltd.	18 000	31 348	19 332
	1 409 925		1 164 973
Hongrie – 0,2 %			
MOL Hungarian Oil & Gas PLC	4 423	42 307	47 634
OTP Bank Nyrt	2 347	89 558	141 319
Richter Gedeon Nyrt	1 431	45 332	47 718
	177 197		236 671
Inde – 17,9 %			
ABB India Ltd.	559	39 622	41 375
ACC Ltd.	729	21 042	25 506
Adani Energy Solutions Ltd.	3 035	37 618	50 165
Adani Enterprises Ltd.	3 259	126 565	147 130
Adani Green Energy Ltd.	3 200	52 312	81 283
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	7 551	89 823	122 405
Adani Power Ltd.	8 112	34 344	67 228
Adani Total Gas Ltd.	2 918	29 961	45 628
Adani Wilmar Ltd.	1 653	10 665	9 299
Aditya Birla Capital Ltd.	4 862	14 572	12 789
Alkem Laboratories Ltd.	327	19 028	26 939
Ambuja Cements Ltd.	6 390	43 172	52 622
APL Apollo Tubes Ltd.	1 638	42 197	39 868
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	1 068	89 550	96 599
Ashok Leyland Ltd.	15 141	42 050	43 462
Asian Paints Ltd.	4 199	234 216	225 877
Astral Ltd.	1 251	37 772	37 882
AU Small Finance Bank Ltd.	4 823	59 722	59 994
Aurobindo Pharma Ltd.	2 977	35 996	51 202
Avenue Supermarts Ltd.	1 518	91 224	97 660
Axis Bank Ltd.	23 576	366 858	410 980
Bajaj Auto Ltd.	709	56 386	76 621
Bajaj Finance Ltd.	2 748	332 498	318 529
Bajaj Finserv Ltd.	4 022	105 043	107 580
Bajaj Holdings & Investment Ltd.	282	33 713	34 399
Balkrishna Industries Ltd.	851	32 995	34 697
Bandhan Bank Ltd.	8 017	27 813	30 629
Bank of Baroda	10 912	35 276	39 916
Bank of India	6 997	11 861	12 490
Berger Paints India Ltd.	2 578	23 455	24 696
Bharat Electronics Ltd.	37 685	76 782	109 578
Bharat Forge Ltd.	2 689	36 891	52 751
Bharat Heavy Electricals Ltd.	12 310	25 552	37 667
Bharat Petroleum Corp. Ltd.	10 059	63 093	71 887
Bharti Airtel Ltd.	24 812	353 011	404 965
Biocon Ltd.	4 721	20 037	18 672
Bosch Ltd.	92	28 401	32 435
Britannia Industries Ltd.	1 249	101 579	105 703

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Inde – 17,9 % (suite)			
Canara Bank	3 828	20 698	26 505
CG Power & Industrial Solutions Ltd.	6 746	44 653	48 317
Cholamandalam Investment & Finance Co. Ltd.	4 189	78 274	83 637
Cipla Ltd.	5 420	90 402	107 356
Coal India Ltd.	21 062	78 106	125 556
Colgate-Palmolive India Ltd.	1 406	41 147	56 292
Container Corp. of India Ltd.	2 898	31 885	39 421
Cummins India Ltd.	1 433	44 201	44 661
Dabur India Ltd.	6 243	58 044	55 067
Dalmia Bharat Ltd.	848	27 806	30 637
Deepak Nitrite Ltd.	781	24 759	30 692
Delhivery Ltd.	3 213	20 907	19 800
Divi's Laboratories Ltd.	1 332	77 969	82 490
DLF Ltd.	6 488	53 415	74 433
Dr Reddy's Laboratories Ltd.	1 227	103 452	112 847
Eicher Motors Ltd.	1 456	78 271	95 332
Embassy Office Parks REIT	6 423	31 378	32 925
FSN E-Commerce Ventures Ltd.	10 803	25 173	29 469
GAIL India Ltd.	28 169	50 890	72 400
General Insurance Corp. of India	2 688	10 508	13 119
Gland Pharma Ltd.	646	12 170	19 695
Godrej Consumer Products Ltd.	3 968	67 399	70 988
Godrej Properties Ltd.	1 217	31 468	38 704
Grasim Industries Ltd.	3 262	95 405	110 225
Gujarat Fluorochemicals Ltd.	362	16 079	21 224
Gujarat Gas Ltd.	1 839	13 826	13 446
Havells India Ltd.	2 316	49 656	50 195
HCL Technologies Ltd.	10 967	203 853	255 113
HDFC Asset Management Co. Ltd.	832	32 310	42 273
HDFC Bank Ltd.	28 809	711 228	780 008
HDFC Life Insurance Co. Ltd.	10 271	109 374	105 171
Hero MotoCorp Ltd.	1 360	68 449	89 348
Hindalco Industries Ltd.	14 755	103 160	143 616
Hindustan Aeronautics Ltd.	1 754	54 207	77 962
Hindustan Petroleum Corp. Ltd.	6 749	32 156	42 564
Hindustan Unilever Ltd.	9 266	398 244	390 520
Honeywell Automation India Ltd.	23	15 892	13 429
ICICI Bank Ltd.	53 514	835 874	846 623
ICICI Lombard General Insurance Co. Ltd.	2 488	54 970	56 180
ICICI Prudential Life Insurance Co. Ltd.	4 042	36 888	34 273
IDFC First Bank Ltd.	29 999	39 558	42 212
Indian Bank	2 304	16 705	15 385
Indian Hotels Co. Ltd.	8 906	57 152	61 833
Indian Oil Corp. Ltd.	39 111	62 800	80 506
Indian Railway Catering & Tourism Corp. Ltd.	3 172	31 790	44 383
Indian Railway Finance Corp. Ltd.	18 314	23 416	28 759
Indraprastha Gas Ltd.	3 693	29 287	24 461
Indus Towers Ltd.	8 811	23 633	27 644
IndusInd Bank Ltd.	5 803	131 043	146 749
Info Edge India Ltd.	726	53 646	59 028
Infosys Ltd.	37 191	850 140	909 124
InterGlobe Aviation Ltd.	1 142	49 866	53 474
ITC Ltd.	30 437	234 714	222 824
Jindal Stainless Ltd.	3 201	24 582	28 912
Jindal Steel & Power Ltd.	4 016	40 856	47 537
JSW Financial Services Ltd.	35 099	138 276	129 561
JSW Energy Ltd.	3 914	18 920	25 367
JSW Steel Ltd.	9 601	123 133	133 576
Jubilant Foodworks Ltd.	4 029	30 835	36 008
Kotak Mahindra Bank Ltd.	11 294	346 515	340 748
L&T Technology Services Ltd.	287	18 567	23 876
Larsen & Toubro Ltd.	7 114	293 084	396 803
Life Insurance Corp. of India	2 029	20 599	26 639
Linde India Ltd.	206	14 800	18 437
LTIMindtree Ltd.	913	72 326	90 855
Lupin Ltd.	2 534	38 254	53 204
MacroTech Developers Ltd.	2 542	28 220	41 207
Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd.	5 642	24 097	24 765
Mahindra & Mahindra Ltd.	9 198	229 932	251 420
Mankind Pharma Ltd.	301	8 786	9 463
Marico Ltd.	5 495	47 226	47 647
Maruti Suzuki India Ltd.	1 368	214 214	223 316
Max Financial Services Ltd.	2 334	30 855	35 228
Max Healthcare Institute Ltd.	7 766	76 586	84 419
Mazagon Dock Shipbuilders Ltd.	248	7 946	8 956
Mphasis Ltd.	880	29 627	38 169
MRF Ltd.	24	39 424	49 173
Muthoot Finance Ltd.	1 125	23 325	26 205
Nestle India Ltd.	367	136 155	154 941
NHPC Ltd.	29 085	22 176	29 819
NMDC Ltd.	12 121	21 707	40 190
NTPC Ltd.	49 063	154 246	241 398
Oberoi Realty Ltd.	1 238	21 077	27 994
Oil & Natural Gas Corp. Ltd.	39 271	106 507	127 880
One 97 Communications Ltd.	2 123	28 930	21 379
Oracle Financial Services Software Ltd.	244	15 287	16 355
Page Industries Ltd.	55	32 129	33 641
Patanjali Foods Ltd.	704	14 699	17 514
PB Fintech Ltd.	2 494	30 097	31 420

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Inde – 17,9 % (suite)			
Persistent Systems Ltd.	523	41 679	61 244
Petronet LNG Ltd.	7 913	28 768	27 943
PI Industries Ltd.	853	50 014	47 457
Pidilite Industries Ltd.	1 600	68 307	68 709
Polycab India Ltd.	460	31 579	40 090
Power Finance Corp. Ltd.	15 101	46 971	91 504
Power Grid Corp. of India Ltd.	46 511	141 318	174 414
Procter & Gamble Hygiene & Health Care Ltd.	87	26 037	23 953
Punjab National Bank	23 234	23 567	35 233
Rail Vikas Nigam Ltd.	4 934	12 608	14 179
REC Ltd.	12 969	37 079	84 566
Reliance Industries Ltd.	35 441	1 552 783	1 452 849
Samvardhana Motherson International Ltd.	21 631	33 138	34 825
SBI Cards & Payment Services Ltd.	3 089	42 306	37 250
SBI Life Insurance Co. Ltd.	4 691	99 046	106 453
Schaeffler India Ltd.	427	21 205	21 652
Shree Cement Ltd.	105	40 326	47 933
Shriram Finance Ltd.	2 514	72 886	81 890
Siemens Ltd.	939	56 203	59 755
Solar Industries India Ltd.	256	15 146	27 321
Sona Blw Precision Forgings Ltd.	2 867	25 472	29 234
SRF Ltd.	1 540	55 179	60 477
State Bank of India	18 307	176 955	186 152
Steel Authority of India Ltd.	15 252	22 083	29 812
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	11 132	195 540	222 269
Supreme Industries Ltd.	589	43 466	42 186
Suzlon Energy Ltd.	97 296	50 723	58 895
Tata Communications Ltd.	1 183	30 627	33 227
Tata Consultancy Services Ltd.	10 455	574 165	629 543
Tata Consumer Products Ltd.	6 336	88 017	109 335
Tata Elxsi Ltd.	368	44 318	50 878
Tata Motors Ltd.	17 068	170 337	210 795
Tata Motors Ltd.	5 895	34 640	48 425
Tata Power Co. Ltd.	17 905	63 658	94 054
Tata Steel Ltd.	83 975	157 174	185 361
Tech Mahindra Ltd.	6 284	123 091	126 740
Thermax Ltd.	329	15 754	16 032
Titan Co. Ltd.	3 831	187 892	223 755
Torrent Pharmaceuticals Ltd.	977	30 262	35 654
Trent Ltd.	1 899	54 124	91 801
Tube Investments of India Ltd.	1 062	54 821	59 572
TVS Motor Co. Ltd.	2 407	53 421	77 350
UltraTech Cement Ltd.	1 191	159 621	197 828
Union Bank of India Ltd.	14 605	21 143	27 540
United Breweries Ltd.	729	17 546	20 666
United Spirits Ltd.	2 848	43 840	50 364
UPL Ltd.	5 484	56 462	51 071
Varun Beverages Ltd.	4 866	66 441	95 381
Vedant Fashions Ltd.	387	7 858	7 744
Vedanta Ltd.	11 801	53 313	48 245
Vodafone Idea Ltd.	88 247	18 946	22 374
Voltas Ltd.	2 433	30 199	37 715
Wipro Ltd.	14 378	94 526	107 264
WNS Holdings Ltd., CAAE parrainé	500	51 145	41 668
Yes Bank Ltd.	133 872	37 665	45 396
Zomato Ltd.	39 856	51 605	78 123
Zyklus Lifesciences Ltd.	2 667	25 968	29 107
	16 373 589		18 313 278

Indonésie – 1,9 %			
Adaro Energy Indonesia Tbk. PT	119 700	41 430	24 398
Adaro Minerals Indonesia Tbk. PT	73 800	11 021	8 595
Amman Mineral Internasional PT	139 000	80 247	77 971
Aneka Tambang Tbk. PT	93 300	16 719	13 623
Astra International Tbk. PT	205 400	102 616	99 386
PT Bank Central Asia Tbk PT	540 200	412 014	434 870
Bank Mandiri Persero Tbk. PT	374 100	167 283	193 830
Bank Negara Indonesia Persero Tbk. PT	153 700	64 069	70 750
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk. PT	724 400	316 110	355 166
Barito Pacific Tbk. PT	284 856	18 830	32 445
Chandra Asri Petrochemical Tbk. PT	74 200	15 597	33 361
Charoen Pokphand Indonesia Tbk. PT	80 400	40 764	34 599
Dayamitra Telekomunikasi PT	201 900	13 568	12 190
Elang Mahkota Teknologi Tbk. PT	121 200	10 806	6 124
GoTo Gojek Tokopedia Tbk. PT	7 954 900	67 772	58 588
Gudang Garam Tbk. PT	6 000	10 041	10 444
Indah Kiat Pulp & Paper Tbk. PT	28 300	23 679	20 177
Indocement Tungal Prakarsa Tbk. PT	15 600	13 536	12 558
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk. PT	22 600	20 494	20 468
Indofood Sukses Makmur Tbk. PT	47 000	28 900	25 962
Indosat Tbk. PT	15 500	7 761	12 445
Kalbe Farma Tbk. PT	215 400	41 005	29 699
Mayora Indah Tbk. PT	35 500	8 105	7 570
Merdeka Battery Materials Tbk. PT	139 600	8 847	6 695
Merdeka Copper Gold Tbk. PT	138 600	52 296	32 048
Pantai Indah Kapuk Dua Tbk. PT	14 500	5 260	6 085
Sarana Menara Nusantara Tbk. PT	188 400	18 165	15 973
Semen Indonesia Persero Tbk. PT	39 600	24 157	21 705
Sumber Alfaria Trijaya Tbk. PT	190 100	43 407	47 701
Telkom Indonesia Persero Tbk. PT	488 200	160 308	165 147

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Indonésie – 1,9 % (suite)			
Tower Bersama Infrastructure Tbk. PT	51 500	10 495	9 218
Trimegah Bangun Persada Tbk. PT	55 500	4 573	4 753
Unilever Indonesia Tbk. PT	57 700	22 426	17 443
United Tractors Tbk. PT	14 300	33 997	27 708
Vale Indonesia Tbk. PT	22 900	14 736	8 453
	1 931 034		1 958 148
Koweït – 0,8 %			
Agility Public Warehousing Co. KSC	14 966	41 037	32 692
Boubyan Bank KSCP	14 963	40 229	38 529
Gulf Bank KSCP	23 603	27 389	28 464
Kuwait Finance House KSCP	105 878	355 608	329 886
Mabane Co. KPSC	7 497	28 330	27 123
Mobile Telecommunications Co. KSCP	21 881	50 435	47 610
National Bank of Kuwait SAKP	76 621	321 374	293 972
	864 402		798 276
Luxembourg – 0,1 %			
Reinet Investments SCA	1 361	35 574	45 751
Malaisie – 1,3 %			
AMMB Holdings Bhd.	19 800	25 168	22 784
Axiata Group Bhd.	47 600	44 819	32 510
CELCOMDIGI Bhd.	32 000	40 108	37 466
CIMB Group Holdings Bhd.	67 900	121 586	113 986
Dialog Group Bhd.	41 100	29 168	24 414
Gamuda Bhd.	18 518	22 402	24 391
Genting Bhd.	22 400	30 833	29 697
Genting Malaysia Bhd.	30 100	24 542	23 235
Hong Leong Bank Bhd.	6 500	41 574	35 254
IHH Healthcare Bhd.	23 300	42 121	40 318
Inari Amertron Bhd.	25 800	21 579	22 285
IOI Corp. Bhd.	25 800	30 854	29 096
Kuala Lumpur Kepong Bhd.	4 800	31 340	30 056
Malayan Banking Bhd.	50 700	136 253	129 341
Malaysia Airports Holdings Bhd.	9 042	18 545	19 097
Maxis Bhd.	20 100	23 249	22 207
MISC Bhd.	17 900	39 951	37 446
MR DIY Group M Bhd.	23 900	15 264	9 945
Nestle Malaysia Bhd.	600	24 125	20 248
Petronas Chemicals Group Bhd.	20 600	51 980	42 326
Petronas Dagangan Bhd.	2 300	15 739	14 415
Petronas Gas Bhd.	6 800	34 846	33 954
PPB Group Bhd.	5 300	28 586	22 023
Press Metal Aluminium Holdings Bhd.	37 400	56 766	51 623
Public Bank Bhd.	123 800	166 750	152 407
QL Resources Bhd.	10 500	18 457	17 205
RHB Bank Bhd.	19 874	34 648	31 082
Sime Darby Bhd.	27 800	18 999	18 747
Sime Darby Plantation Bhd.	21 600	29 161	27 645
Telekom Malaysia Bhd.	27 000	43 159	43 002
Tenaga Nasional Bhd.	34 000	96 872	97 958
TIME dotCom Bhd.	8 200	12 660	12 707
YTL Corp. Bhd.	31 700	14 727	17 193
YTL Power International Bhd.	22 000	14 503	16 036
	1 401 334		1 302 099

Mexique – 2,8 %			
Alfa SAB de CV	48 200	43 963	51 004
America Movil SAB de CV	334 100	447 233	409 470
Arca Continental SAB de CV	5 000	58 243	72 013
Becle SAB de CV	17 700	52 261	45 825
Cemex SAB de CV	156 800	94 565	161 283
Coca-Cola Femsa SAB de CV	5 470	52 198	68 671
El Puerto de Liverpool SAB de CV	2 200	17 622	19 900
Fibra Uno Administracion SA de CV	29 500	48 461	70 059
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	22 300	240 486	384 539
Gruma SAB de CV, série B	1 815	32 111	43 917
Grupo Aeroportuario del Pacífico SAB de CV	3 800	77 814	88 130
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, série B	1 865	65 196	72 462
Grupo Bimbo SAB de CV, série A	14 100	84 433	94 265
Grupo Carso SAB de CV	5 141	34 161	75 745
Grupo Comercial Chedraui SA de CV	4 600	36 786	36 810
Grupo Elektra SAB de CV	545	39 269	49 866
Grupo Financiero Banorte SAB de CV, série O	29 900	312 203	398 347
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	19 800	49 024	71 706
Grupo Mexico SAB de CV, série B	32 300	169 659	237 369
Industrias Penoles SAB de CV	2 000	35 015	38 576
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	17 500	41 569	51 848
Orbia Advance Corp. SAB de CV	10 300	26 449	30 148
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	51 400	256 196	285 720
	2 314 917		2 857 673

Philippines – 0,6 %			
ACEN Corp.	81 300	14 428	8 479
Ayala Corp.	2 400	41 508	38 919
Ayala Land, Inc.	63 400	46 611	52 009
Bank of the Philippine Islands	20 438	50 364	50 517
BDO Unibank, Inc.	21 550	57 455	66 966
International Container Terminal Services, Inc.	7 920	37 998	46 545
JG Summit Holdings, Inc.	32 400	36 864	29 433
Jollibee Foods Corp.	4 840	28 113	28 974

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Philippines – 0,6 % (suite)			
Manila Electric Co.	3 120	23 091	29 643
Metropolitan Bank & Trust Co.	19 620	26 623	23 967
PLDT, Inc.	955	30 164	29 085
SM Investments Corp.	5 090	114 489	105 690
SM Prime Holdings, Inc.	117 800	99 498	92 287
Universal Robina Corp.	9 550	30 922	26 880
		638 128	629 394
Qatar – 0,9 %			
Commercial Bank PSQC	33 564	64 636	72 324
Dukhan Bank	16 810	20 701	24 333
Industries Qatar QSC	19 725	98 656	92 151
Masraf Al Rayan QSC	73 237	88 227	68 748
Mesaieed Petrochemical Holding Co.	48 729	40 375	31 236
Ooredoo QPSC	6 620	22 984	26 132
Qatar Electricity & Water Co. QSC	5 225	34 567	34 212
Qatar Fuel QSC	6 378	44 773	37 765
Qatar Gas Transport Co. Ltd.	38 035	52 961	47 660
Qatar International Islamic Bank QSC	11 850	48 281	45 233
Qatar Islamic Bank SAQ	16 937	132 658	128 196
Qatar National Bank QPSC	45 753	307 964	265 942
		956 783	873 932
Arabie saoudite – 3,9 %			
ACWA Power Co.	1 400	76 550	126 515
Advanced Petrochemical Co.	1 445	21 025	20 045
Al Rajhi Bank	20 274	545 597	620 212
Alinma Bank	10 155	117 662	138 367
Almarai Co. JSC	2 612	51 332	51 617
Arab National Bank	7 062	78 994	62 949
Arabian Internet & Communications Services Co.	271	24 607	32 990
Bank AlBilad	5 093	78 935	80 498
Banque Saudi Fransi	6 132	88 599	86 247
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	729	36 106	54 651
Co. for Cooperative Insurance	771	35 141	35 352
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co.	863	68 896	86 120
Elm Co.	275	44 258	78 808
Etihad Etisalat Co.	3 863	46 280	67 102
Jarir Marketing Co.	6 520	36 000	35 856
Mouwasset Medical Services Co.	929	53 134	36 521
Nahdi Medical Co.	435	28 047	20 955
Rabigh Refining & Petrochemical Co.	4 795	18 595	17 569
Riyadh Bank	15 385	173 204	154 449
SABIC Agri-Nutrients Co.	2 419	119 019	117 551
Sahara International Petrochemical Co.	3 572	42 679	42 767
Saudi Arabian Mining Co.	12 575	258 958	195 218
Saudi Arabian Oil Co.	45 004	521 296	523 003
Saudi Aramco Base Oil Co.	559	24 481	27 833
Saudi Awwal Bank	10 150	139 795	134 195
Saudi Basic Industries Corp.	9 305	282 517	272 548
Saudi Electricity Co.	8 031	65 175	53 541
Saudi Industrial Investment Group	4 132	31 791	32 255
Saudi Kayan Petrochemical Co.	8 177	39 012	31 225
Saudi National Bank	30 412	492 671	413 845
Saudi Tadawul Group Holding Co.	467	29 621	30 149
Saudi Telecom Co.	18 598	245 415	264 525
Savola Group	2 835	27 862	37 233
Yanbu National Petrochemical Co.	3 081	44 363	41 168
		3 987 617	4 023 879
Singapour – 0,0 %			
BOC Aviation Ltd.	2 300	26 926	23 187
Afrique du Sud – 2,7 %			
Absa Group Ltd.	8 139	124 874	96 074
African Rainbow Minerals Ltd.	932	11 239	13 440
Anglo American Platinum Ltd.	557	58 298	38 716
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	3 606	39 230	52 911
Bid Corp. Ltd.	3 517	95 334	108 194
Bidvest Group Ltd.	3 408	60 105	61 995
Capitec Bank Holdings Ltd.	1 006	137 526	146 985
Clicks Group Ltd.	2 450	55 791	57 538
Discovery Ltd.	5 924	58 629	61 372
Exxaro Resources Ltd.	2 396	41 694	35 326
FirstRand Ltd.	51 767	252 288	274 384
Gold Fields Ltd.	9 144	133 565	183 145
Impala Platinum Holdings Ltd.	9 161	120 220	60 288
Investec Ltd.	2 026	16 450	18 347
Kumba Iron Ore Ltd.	521	19 415	23 095
MTN Group Ltd.	17 441	169 984	145 249
MultiChoice Group	3 802	34 997	22 211
Naspers Ltd., cat. N	1 913	432 165	431 460
Nedbank Group Ltd.	4 669	78 589	72 794
Northam Platinum Holdings Ltd.	3 525	51 857	35 693
Old Mutual Ltd.	49 740	41 784	46 839
OUTsurance Group Ltd.	8 627	22 698	26 250
Pepkor Holdings Ltd.	16 906	25 136	23 929
Remgro Ltd.	5 385	59 297	63 088
Sanlam Ltd.	16 884	67 440	88 627
Sasol Ltd.	5 871	119 666	78 437
Shoprite Holdings Ltd.	4 922	92 567	97 614

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Afrique du Sud – 2,7 % (suite)			
Sibanye Stillwater Ltd.	27 624	99 078	49 596
Standard Bank Group Ltd.	13 946	188 703	209 257
Vodacom Group Ltd.	6 027	58 474	46 064
Woolworths Holdings Ltd.	9 288	49 791	48 352
		2 816 884	2 717 270
Corée du Sud – 12,9 %			
Alteogen, Inc.	369	14 312	37 213
Amorepacific Corp.	285	39 594	42 310
AMOREPACIFIC Group	337	11 831	10 092
BGF retail Co. Ltd.	66	14 707	8 872
BNK Financial Group, Inc.	3 763	28 224	27 508
Celltrion Pharm, Inc.	212	14 707	20 012
Celltrion, Inc.	1 595	270 406	329 054
Cheil Worldwide, Inc.	876	20 668	17 068
Chunbo Co. Ltd.	50	12 592	5 641
CJ CheilJedang Corp.	79	30 257	26 206
CJ Corp.	127	10 812	12 275
CJ ENM Co. Ltd.	104	10 804	7 688
CJ Logistics Corp.	104	9 794	13 544
CosmoAM&T Co. Ltd.	223	37 142	33 631
Coway Co. Ltd.	534	31 553	31 273
CS Wind Corp.	223	17 462	16 028
Daewoo Engineering & Construction Co. Ltd.	2 137	9 793	9 069
DB HiTek Co. Ltd.	352	15 132	21 119
DB Insurance Co. Ltd.	421	28 112	36 078
DL E&C Co. Ltd.	256	9 808	9 449
Dongsuh Cos., Inc.	492	10 651	9 168
Doosan Bobcat, Inc.	456	17 302	23 530
Doosan Co. Ltd.	111	9 894	10 671
Doosan Enerbility Co. Ltd.	4 340	70 996	70 651
Doosan Fuel Cell Co. Ltd.	439	15 665	10 428
Ecopro BM Co. Ltd.	474	60 202	139 766
Ecopro Co. Ltd.	198	34 968	131 160
E-MART, Inc.	179	18 795	14 038
F&F Co. Ltd.	164	23 616	14 978
Fila Holdings Corp.	430	15 299	17 038
Green Cross Corp.	68	9 756	8 737
GS Engineering & Construction Corp.	609	14 082	9 365
GS Holdings Corp.	500	23 464	20 937
GS Retail Co. Ltd.	337	10 219	7 953
Hana Financial Group, Inc.	3 031	140 864	134 681
Hanjin Kal Corp.	243	10 063	18 112
Hankook Tire & Technology Co. Ltd.	723	25 090	33 607
Hanmi Pharm Co. Ltd.	58	17 412	20 932
Hanmi Science Co. Ltd.	299	10 784	12 000
Hanmi Semiconductor Co. Ltd.	408	22 001	25 774
Hanon Systems	1 445	12 834	10 785
Hansol Chemical Co. Ltd.	86	17 536	19 987
Hanssem Co. Ltd.	121	6 293	6 628
Hanwha Aerospace Co. Ltd.	333	27 086	42 447
Hanwha Corp.	344	9 889	9 069
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.	3 831	9 926	11 100
Hanwha Ocean Co. Ltd.	2 031	68 827	52 193
Hanwha Solutions Corp.	1 090	34 625	44 081
Hanwha Systems Co. Ltd.	850	10 096	15 108
HD Hyundai Co. Ltd.	430	29 234	27 868
HD Hyundai Heavy Industries Co. Ltd.	204	25 154	26 943
HD Hyundai Infracore Co. Ltd.	1 181	10 278	9 818
HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd.	470	37 546	58 177
Hite Jinro Co. Ltd.	354	9 935	8 155
HL Mando Co. Ltd.	263	12 246	10 596
HLB, Inc.	1 265	40 512	65 664
HMM Co. Ltd.	2 398	56 105	48 072
Hotel Shilla Co. Ltd.	351	29 126	23 503
Hugel, Inc.	75	10 568	11 472
HYBE Co. Ltd.	190	36 719	45 423
Hyosung Advanced Materials Corp.	26	9 783	10 635
Hyosung TNC Corp.	26	9 469	9 716
Hyundai Autoever Corp.	92	9 718	19 922
Hyundai Department Store Co. Ltd.	162	9 995	8 592
Hyundai Elevator Co. Ltd.	221	6 655	10 035
Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd.	657	24 971	23 476
Hyundai Glovis Co. Ltd.	193	34 541	37 841
Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd.	527	16 839	16 726
Hyundai Mipo Dockyard Co. Ltd.	250	20 538	21 731
Hyundai Mobis Co. Ltd.	634	136 645	153 840
Hyundai Motor Co., priv., série 2	345	28 859	40 338
Hyundai Motor Co., priv.	230	19 171	26 727
Hyundai Motor Co.	1 414	246 014	294 608
Hyundai Rotem Co. Ltd.	733	21 264	19 963
Hyundai Steel Co.	807	27 072	30 158
Industrial Bank of Korea	2 599	29 788	31 559
JYP Entertainment Corp.	261	28 096	27 070
Kakao Corp.	3 103	182 694	172 509
Kakao Games Corp.	426	19 930	11 275
KakaoBank Corp.	2 211	59 921	64 516
Kakaopay Corp.	231	15 005	11 660
Kangwon Land, Inc.	1 211	30 727	19 838

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Corée du Sud – 12,9 % (suite)			
KB Financial Group, Inc.	3 866	208 292	214 136
KCC Corp.	41	9 912	9 592
KEPCO Engineering & Construction Co., Inc.	162	9 620	10 300
KEPCO Plant Service & Engineering Co. Ltd.	272	9 878	9 482
Kia Corp.	2 571	176 909	263 229
KIWOOM Securities Co. Ltd.	131	12 227	13 345
Korea Aerospace Industries Ltd.	761	38 599	38 957
Korea Electric Power Corp.	2 533	56 016	49 015
Korea Gas Corp.	294	11 418	7 435
Korea Investment Holdings Co. Ltd.	449	27 645	28 180
Korea Zinc Co. Ltd.	99	61 124	50 477
Korean Air Lines Co. Ltd.	1 992	51 555	48 744
Krafton, Inc.	288	55 046	57 086
KT Corp.	638	22 109	22 470
KT&G Corp.	1 163	117 555	103 474
Kum Yang Co. Ltd.	323	24 512	36 112
Kumho Petrochemical Co. Ltd.	173	25 446	23 540
L&F Co. Ltd.	253	50 749	52 842
LEENO Industrial, Inc.	102	17 111	21 147
LG Chem Ltd.	485	326 442	247 784
LG Chem Ltd., priv.	84	26 796	26 747
LG Corp.	945	79 178	83 110
LG Display Co. Ltd.	2 213	31 364	28 866
LG Electronics, Inc.	1 112	106 905	115 900
LG Electronics, Inc., priv.	223	9 861	10 457
LG Energy Solution Ltd.	419	219 810	183 392
LG H&H Co. Ltd.	90	64 791	32 712
LG Innotek Co. Ltd.	129	38 082	31 632
LG Uplus Corp.	2 649	31 614	27 745
Lotte Chemical Corp.	169	30 246	26 508
Lotte Corp.	322	10 898	8 918
Lotte Energy Materials Corp.	208	12 308	8 955
Lotte Shopping Co. Ltd.	109	10 070	8 370
LS Corp.	191	14 535	18 226
Meritz Financial Group, Inc.	1 081	51 453	65 410
Mirae Asset Securities Co. Ltd.	2 593	17 499	20 256
NAVER Corp.	1 407	273 997	322 681
NCSOFT Corp.	136	63 354	33 488
Netmarble Corp.	190	10 205	11 302
NH Investment & Securities Co. Ltd.	1 489	14 978	15 748
NongShim Co. Ltd.	29	10 304	12 084
OCL Holdings Co. Ltd.	129	17 890	14 026
Orion Corp.	216	26 441	25 675
Pan Ocean Co. Ltd.	2 172	13 424	8 306
Pearl Abyss Corp.	285	13 510	11 307
Posco DX Co. Ltd.	509	24 688	38 668
POSCO Future M Co. Ltd.	293	61 982	107 694
POSCO Holdings, Inc.	739	233 537	377 930
Posco International Corp.	485	15 371	30 985
S-1 Corp.	184	12 068	11 303
Samsung Biologics Co. Ltd.	184	157 789	143 173
Samsung C&T Corp.	842	104 286	111 638
Samsung Card Co. Ltd.	354	11 220	11 725
Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd.	566	83 773	88 778
Samsung Electronics Co. Ltd.	50 334	3 173 645	4 045 405
Samsung Electronics Co. Ltd., priv.	8 494	482 197	541 790
Samsung Engineering Co. Ltd.	1 538	37 379	45 665
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	310	69 195	83 473
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd., priv.	50	9 809	9 726
Samsung Heavy Industries Co. Ltd.	6 577	35 059	52 187
Samsung Life Insurance Co. Ltd.	810	61 843	57 305
Samsung SDI Co. Ltd.	536	365 911	259 023
Samsung SDS Co. Ltd.	382	52 050	66 488
Samsung Securities Co. Ltd.	699	26 011	27 553
SD Biosensor, Inc.	392	13 617	4 591
Shinhan Financial Group Co. Ltd.	4 668	183 476	191 888
Shinsegae, Inc.	63	14 068	11 301
SK Biopharmaceuticals Co. Ltd.	256	19 514	26 315
SK Bioscience Co. Ltd.	270	22 493	19 903
SK Chemicals Co. Ltd.	114	9 634	7 855
SK Hynix, Inc.	5 529	473 677	801 003
SK IE Technology Co. Ltd.	275	17 983	22 215
SK Innovation Co. Ltd.	577	100 891	82 883
SK Networks Co. Ltd.	1 867	7 855	10 991
SK Square Co. Ltd.	964	35 731	51 915
SK Telecom Co. Ltd.	1 062	54 932	54 474
SK, Inc.	370	78 141	67 430
SKC Co. Ltd.	184	19 320	17 068
S-Oil Corp.	443	38 824	31 568
Soulbrain Co. Ltd.	46	10 734	14 317
SSANGYONG C&E Co. Ltd.	1 597	9 987	9 402
Studio Dragon Corp.	128	11 678	6 749
Wemade Co. Ltd.	163	6 356	10 163
WONIK IPS Co. Ltd.	336	9 730	11 679
Woori Financial Group, Inc.	6 568	87 187	87 419
Yuhan Corp.	581	35 327	40 926
	11 471 709		13 209 212

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Taiwan – 16,0 %			
Accton Technology Corp.	5 000	57 216	112 352
Acer, Inc.	32 000	32 922	73 968
Advantech Co. Ltd.	4 499	62 638	71 906
Airtac International Group	2 000	87 937	86 788
Alchip Technologies Ltd.	1 000	55 660	140 709
ASE Technology Holding Co. Ltd.	37 000	158 821	214 607
Asia Cement Corp.	28 000	51 563	49 864
Asia Vital Components Co. Ltd.	3 000	36 614	43 373
Asustek Computer, Inc.	7 000	83 246	147 218
AUO Corp.	61 000	41 117	47 568
Catcher Technology Co. Ltd.	7 000	53 497	58 346
Cathay Financial Holding Co. Ltd.	106 000	193 670	208 356
Chailease Holding Co. Ltd.	15 340	146 343	127 201
Chang Hwa Commercial Bank Ltd.	61 500	46 884	47 297
Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd.	22 000	36 101	42 440
Chicony Electronics Co. Ltd.	6 000	23 448	45 113
China Airlines Ltd.	31 000	26 108	28 836
China Development Financial Holding Corp.	168 000	95 417	90 586
China Steel Corp.	125 000	159 388	145 005
Chroma ATE, Inc.	4 000	32 529	36 606
Chunghwa Telecom Co. Ltd.	39 000	194 949	201 074
Compal Electronics, Inc.	41 000	41 383	70 197
CTBC Financial Holding Co. Ltd.	183 000	179 873	222 902
Delta Electronics, Inc.	20 000	259 350	269 387
E Ink Holdings, Inc.	9 000	68 513	76 176
E.Sun Financial Holding Co. Ltd.	154 142	162 255	170 864
Eclat Textile Co. Ltd.	2 000	41 665	48 292
Elite Material Co. Ltd.	3 000	46 553	49 237
eMemory Technology, Inc.	1 000	98 249	105 263
Eva Airways Corp.	25 000	31 097	33 781
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	10 000	71 549	61 654
Far Eastern New Century Corp.	29 000	40 409	38 874
Far EasTone Telecommunications Co. Ltd.	16 000	46 941	54 857
Feng TAY Enterprise Co. Ltd.	6 600	50 430	49 624
First Financial Holding Co. Ltd.	111 390	127 985	131 131
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	44 000	137 177	117 774
Formosa Petrochemical Corp.	14 000	50 178	48 541
Formosa Plastics Corp.	55 000	212 409	187 153
Formosa Sumco Technology Corp.	1 000	7 104	7 239
Foxconn Technology Co. Ltd.	10 000	23 127	22 814
Fubon Financial Holding Co. Ltd.	86 150	210 991	239 850
Giant Manufacturing Co. Ltd.	3 000	28 786	23 716
Gigabyte Technology Co. Ltd.	6 000	58 388	68 571
Global Unichip Corp.	1 000	49 766	74 758
Globalwafers Co. Ltd.	2 000	40 595	50 440
Gold Circuit Electronics Ltd.	3 000	22 699	28 099
Highwealth Construction Corp.	19 500	32 795	33 596
Hiwin Technologies Corp.	3 000	26 703	30 290
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	122 000	552 871	547 754
Hotai Motor Co. Ltd.	3 060	79 567	93 213
Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	106 000	107 607	101 787
Innolux Corp.	88 800	49 917	54 558
Inventec Corp.	32 000	45 385	72 593
Largan Precision Co. Ltd.	1 000	100 263	123 308
Lite-On Technology Corp.	22 000	64 238	110 590
Lotes Co. Ltd.	1 025	38 840	47 121
Macronix International Co. Ltd.	19 000	29 646	25 592
MediaTek, Inc.	15 000	447 418	654 134
Mega Financial Holding Co. Ltd.	111 928	156 051	188 510
Merida Industry Co. Ltd.	2 000	15 195	15 682
Micro-Star International Co. Ltd.	7 000	38 434	61 353
momo.com, Inc.	1 100	26 913	24 056
Nan Ya Plastics Corp.	57 000	184 574	162 857
Nan Ya Printed Circuit Board Corp.	2 000	25 021	21 611
Nanya Technology Corp.	12 000	28 720	40 215
Nien Made Enterprise Co. Ltd.	2 000	25 266	30 333
Novatek Microelectronics Corp.	6 000	82 148	133 276
Oneness Biotech Co. Ltd.	3 413	37 407	28 521
Parade Technologies Ltd.	1 000	41 254	51 557
Pegatron Corp.	20 000	58 486	75 016
PharmaEssentia Corp.	3 000	58 654	44 597
Phison Electronics Corp.	2 000	27 940	44 683
Polaris Group	3 000	12 660	9 744
Pou Chen Corp.	24 000	35 390	31 862
Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp.	32 000	47 153	40 490
Powertech Technology, Inc.	7 000	24 892	42 406
President Chain Store Corp.	6 000	71 410	69 473
Quanta Computer, Inc.	24 000	83 389	231 492
Realtek Semiconductor Corp.	5 000	66 017	101 289
Ruentex Development Co. Ltd.	18 000	39 650	29 194
Ruentex Industries Ltd.	8 000	23 885	22 101
Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd.	46 000	96 255	92 494
Shin Kong Financial Holding Co. Ltd.	142 000	55 659	53 993
Sino-American Silicon Products, Inc.	6 000	41 263	50 526
SinoPac Financial Holdings Co. Ltd.	117 033	86 433	99 057
Synnex Technology International Corp.	14 000	38 224	42 225
TA Chen Stainless Pipe	21 600	35 344	36 750
Taishin Financial Holding Co. Ltd.	129 956	86 199	101 061
Taiwan Business Bank	75 992	44 078	44 730

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Taiwan – 16,0 % (suite)			
Taiwan Cement Corp.	62 000	94 164	92 833
Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.	108 150	122 124	124 064
Taiwan Fertilizer Co. Ltd.	7 000	17 262	20 331
Taiwan High Speed Rail Corp.	19 000	24 559	25 061
Taiwan Mobile Co. Ltd.	18 000	75 496	76 253
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	248 000	5 237 245	6 318 522
Tatung Co. Ltd.	22 000	33 595	39 699
Teco Electric & Machinery Co. Ltd.	19 000	27 598	38 204
Tripod Technology Corp.	5 000	22 452	41 890
Unimicron Technology Corp.	13 000	83 396	98 303
Uni-President Enterprises Corp.	48 000	139 569	153 641
United Microelectronics Corp.	115 000	224 074	259 892
Vanguard International Semiconductor Corp.	10 000	37 716	35 016
VisEra Technologies Co. Ltd.	1 000	10 608	11 880
Volttronic Power Technology Corp.	1 000	73 303	73 469
Walsin Lihwa Corp.	29 000	61 456	48 157
Walsin Technology Corp.	3 000	10 762	15 854
Wan Hai Lines Ltd.	16 000	47 419	37 809
Win Semiconductors Corp.	3 000	19 585	20 494
Winbond Electronics Corp.	31 206	29 205	40 826
Wistron Corp.	27 000	35 876	114 380
Wiwynn Corp.	1 000	38 011	78 410
WPG Holdings Ltd.	17 000	36 770	59 600
WT Microelectronics Co. Ltd.	6 000	30 181	29 001
Yageo Corp.	4 000	84 131	102 599
Yang Ming Marine Transport Corp.	17 000	48 258	37 469
Yuanta Financial Holding Co. Ltd.	112 920	111 243	133 903
Yulon Finance Corp.	3 300	25 729	26 372
Yulon Motor Co. Ltd.	6 560	19 046	21 082
	13 873 587		16 361 111
Thaïlande – 1,8 %			
Advanced Info Service PCL	600	5 042	5 030
Advanced Info Service PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	10 600	77 379	88 861
Airports of Thailand PCL	2 200	5 084	5 078
Airports of Thailand PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	42 200	122 322	97 408
Asset World Corp. PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	85 200	20 765	11 717
B Grimm Power PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	10 200	15 838	10 738
Bangkok Bank PCL	10 000	56 314	60 459
Bangkok Dusit Medical Services PCL	10 800	10 975	11 578
Bangkok Dusit Medical Services PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	60 200	66 852	64 536
Bangkok Expressway & Metro PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	75 800	28 350	23 280
Bangkok Life Assurance PCL	3 900	4 484	3 013
Banpu PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	42 600	22 544	11 191
Berli Jucker PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	10 200	13 933	9 851
BTS Group Holdings PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	82 200	26 820	23 023
Bumrungrad Hospital PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	5 300	44 235	45 454
Carabao Group PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	3 800	14 378	12 111
Central Pattana PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	16 300	45 457	44 079
Central Plaza Hotel PCL	5 900	10 030	9 972
Central Retail Corp. PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	31 900	56 134	50 526
Charoen Pokphand Foods PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	38 800	36 548	29 379
Com7 PCL	6 000	5 186	5 517
CP ALL PCL	5 200	11 278	11 250
CP ALL PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	50 900	131 395	110 116
CP Axtra PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	15 500	23 612	16 167
Delta Electronics Thailand PCL, CAAE	2 900	12 938	9 859
Electricity Generating PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	2 400	15 991	11 868
Energy Absolute PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	15 300	57 828	26 155
Global Power Synergy PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	8 800	25 079	16 488
Gulf Energy Development PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	46 600	99 234	80 111
Gulf Energy Development PCL	2 900	5 040	4 985
Home Product Center PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	54 200	32 030	24 498
Indorama Ventures PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	14 200	21 074	14 949
Intouch Holdings PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	9 200	27 127	25 412
IRPC PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	112 200	12 702	8 756

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Thaïlande – 1,8 % (suite)			
JMT Network Services PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	8 000	21 239	7 881
Kasikornbank PCL	1 000	5 023	5 215
Kasikornbank PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	14 300	81 361	74 579
KCE Electronics PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	7 400	13 817	15 723
Krung Thai Bank PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	48 800	34 043	34 688
Krungthai Card PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	11 500	26 897	19 325
Land & Houses PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	65 000	25 040	20 465
Minor International PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	34 200	41 714	38 976
Muangthai Capital PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	7 700	11 578	13 386
Ngern Tid Lor PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	14 175	14 364	12 321
Osotsa PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	20 400	22 853	17 338
PTT Exploration & Production PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	13 600	89 455	78 546
PTT Global Chemical PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	18 500	33 675	27 515
PTT Oil & Retail Business PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	30 300	27 873	22 357
PTT PCL	3 700	4 946	5 110
PTT PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	96 200	118 684	132 860
Ratch Group PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	7 800	13 031	9 492
SCB X PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	10 800	43 870	44 226
SCG Packaging PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	12 800	28 180	17 801
Siam Cement PCL	500	5 615	5 911
Siam Cement PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	3 700	48 051	43 739
Siam Global House PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	14 270	11 686	9 482
Srisawad Corp. PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	9 000	17 070	14 081
Thai Beverage PCL	89 700	59 043	47 075
Thai Life Insurance PCL	23 200	9 532	8 201
Thai Oil PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	13 600	28 926	28 240
Thai Union Group PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	29 000	19 379	16 805
Tisco Financial Group PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	6 600	26 176	25 433
TMBThanachart Bank PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	447 400	23 743	28 864
TOA Paint Thailand PCL	7 800	10 349	6 810
True Corp. PCL, certificat d'actions étrangères sans droit de vote	95 406	29 285	18 613
WHA Corp. PCL	74 200	14 264	15 192
	2 124 760		1 849 665
Turquie – 1,0 %			
AG Anadolu Grubu Holding AS	1 300	10 750	11 660
Akbank TAS	28 802	41 055	46 962
Aksa Akirlik Kimya Sanayii AS	1 565	10 040	7 197
Aksa Enerji Uretim AS	2 933	10 723	3 894
Alarko Holding AS	1 603	10 042	6 484
Alfa Solar Enerji Sanayi VE Ticaret AS	795	4 716	2 982
Anadolu Anonim Turk Sigorta Sirketi	1 661	4 845	4 457
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	2 172	10 975	13 334
Arcelik AS	1 374	10 636	7 883
Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS	13 076	27 290	26 259
Astor Transformator Enerji Turizm Insaat Ve Petrol Sanayi Ticaret AS	2 251	13 571	9 477
Aygaz AS	557	3 046	3 357
Bera Holding AS	9 346	10 248	4 790
BIM Birlesik Magazalar AS	4 381	41 921	58 826
Borusan Birlesik Boru Fabrikalari Sanayi ve Ticaret AS	281	13 055	7 415
Borusan Yatirim ve Pazarlama AS	60	5 451	6 295
Can2 Termik AS	2 560	12 070	1 934
Cimsa Cimento Sanayi VE Ticaret AS	3 848	6 716	5 041
Coca-Cola Icecek AS, cat. C	773	11 831	18 136
CW Enerji Muhendislik Ticaret VE Sanayi AS	319	4 721	3 863
Dogan Sirketler Grubu Holding AS	15 385	11 321	7 597
Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret AS	615	7 598	7 057
EGE Endustri VE Ticaret AS	11	4 783	5 109
Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	22 807	13 869	7 006
Enerjisa Enerji AS	2 632	5 899	5 351
Enka Insaat ve Sanayi AS	6 884	13 402	10 450
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	18 622	56 924	34 088
Europower Enerji VE Otomasyon Teknolojileri Sanayi Ticaret AS	557	4 970	4 029

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Turquie – 1,0 % (suite)			
Ford Otomotiv Sanayi AS	556	18 523	18 357
Girisim Elektrik Taahhut Ticaret Ve Sanayi AS	1 924	9 379	5 721
Gubre Fabrikalari TAS	611	10 621	4 196
Haci Omer Sabanci Holding AS	12 099	36 720	32 654
Hektas Ticaret TAS	11 573	32 615	10 386
Investco Holding AS	322	6 306	3 777
Is Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	4 545	4 724	3 147
Is Yatirim Menkul Degerler AS	4 347	7 490	6 211
Kaleseramik Canakkale Kalebodur Seramik Sanayi AS	1 326	4 645	3 810
Kardemir Karabuk Demir Celik Sanayi ve Ticaret AS	11 128	14 923	11 805
Kiler Holding AS	2 202	5 223	3 366
KOC Holding AS	7 211	42 740	45 652
Kontrolmatik Enerji Ve Muhendislik AS	818	10 381	7 925
Konya Cimento Sanayii AS	12	4 578	3 860
Koza Altin Isletmeleri AS	10 920	36 878	9 522
Koza Anadolu Metal Madencilik Isletmeleri AS	2 525	10 060	4 782
Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret AS	1 042	4 912	5 420
MIA Teknoloji AS	2 392	6 633	3 855
Migros Ticaret AS	1 054	10 852	15 764
MLP Saglik Hizmetleri AS	1 059	6 261	7 045
Nuh Cimento Sanayi AS	380	6 642	5 242
ODAS Elektrik Uretim ve Sanayi Ticaret AS	12 707	10 844	4 681
Otokar Otomotiv Ve Savunma Sanayi AS	469	10 519	8 910
Oyak Cimento Fabrikalari AS	3 302	11 381	8 175
Pegasus Hava Tasimaciligi AS	399	14 238	11 570
Penta Teknoloji Urunleri Dagitim Ticaret AS	2 481	10 440	1 993
Petkim Petrokimya Holding AS	11 103	16 202	9 027
Politeknik Metal Sanayi ve Ticaret AS	11	5 553	7 561
Sarkuysan Elektrolitik Bakir Sanayi ve Ticaret AS	5 458	12 081	6 891
Sasa Polyester Sanayi AS	13 707	67 357	22 300
Smart Gunes Enerjisi Teknolojileri ArGE Uretim Sanayi ve Ticaret AS	1 245	4 509	3 071
Sok Marketler Ticaret AS	3 742	7 343	9 013
TAV Havalimanlari Holding AS	1 975	13 671	9 479
Tekfen Holding AS	3 030	10 045	4 995
Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	1 403	15 198	13 154
Turk Hava Yollari AO	7 454	78 575	76 078
Turk Telekomunikasyon AS	6 369	10 028	6 927
Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	378	12 384	12 016
Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	13 220	34 077	33 112
Turkiye Halk Bankasi AS	10 526	11 862	5 630
Turkiye Is Bankasi AS, série C	33 630	31 406	35 074
Turkiye Petrol Rafinerileri AS	9 499	89 498	60 646

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 98,5 % (suite)			
Turquie – 1,0 % (suite)			
Turkiye Sigorta AS	2 564	4 565	4 643
Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS	15 607	5 106	4 564
Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	14 859	44 498	30 397
Ulker Biskuvi Sanayi AS	1 941	6 058	7 093
Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret AS	1 890	10 029	3 902
Yapi ve Kredi Bankasi AS	30 272	27 443	26 409
YEO Teknoloji Enerji VE Endustri AS	406	4 910	2 982
Zorlu Enerji Elektrik Uretim AS	18 518	4 639	3 497
	1 258 033		977 220
Émirats arabes unis – 2,0 %			
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	30 917	103 579	101 897
Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	14 965	59 294	54 372
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	30 721	39 330	38 603
Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC	28 260	48 877	37 540
ADNOC Drilling Co. PJSC	19 931	23 224	27 048
Adnoc Gas PLC	78 129	98 666	86 675
Aldar Properties PJSC	36 699	61 969	70 490
Alpha Dhabi Holding PJSC	13 972	141 417	94 306
Borouge PLC	34 733	33 091	30 801
Dubai Electricity & Water Authority PJSC	91 486	79 925	80 800
Dubai Islamic Bank PJSC	31 236	65 994	64 147
Emaar Properties PJSC	64 297	140 403	182 826
Emirates NBD Bank PJSC	25 527	126 148	158 551
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	36 131	321 390	254 767
First Abu Dhabi Bank PJSC	46 020	293 833	230 650
International Holding Co. PJSC	3 712	561 271	532 410
Multiply Group PJSC	36 986	49 606	42 227
	2 248 017		2 088 110
États-Unis – 0,0 %			
Pharmaron Beijing Co. Ltd.	2 700	16 464	7 213
TOTAL DES ACTIONS	97 277 818		100 878 869
COÛTS DE TRANSACTIONS		(104 625)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS	97 173 193		100 878 869
GAIN (PERTE) LATENT SUR LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS – 0,0 %			
			47 035
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 1,4 %			
			1 471 820
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			
			102 397 724

Gain latent sur les contrats à terme normalisés

Contrats à terme normalisés	Nombre de contrats achetés (vendus)	Prix (\$)	Date d'échéance	Coût notionnel	Valeur comptable	Gain latent
MSCI EMGMKT MAR24 IFUS 20240315	14	1 363,037	USD 15 mars 2024	938 200	954 126	38 376
MSCI INDIA MAR24 XEUR 20240315	2	1 497,270	USD 15 mars 2024	299 980	299 454	8 659
				1 238 180	1 253 580	47 035

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice général d'actions qui suit les rendements de titres cotés en bourse émis par des sociétés à grande et à moyenne capitalisation dans les marchés émergents.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Roupie indienne	18 275 905	—	18 275 905	17,8
Dollar de Hong Kong	17 265 431	—	17 265 431	16,9
Nouveau dollar taiwanais	16 421 400	—	16 421 400	16,0
Won sud-coréen	13 209 787	—	13 209 787	12,9
Réal brésilien	5 885 163	—	5 885 163	5,7
Dollar américain	4 788 258	—	4 788 258	4,7
Yuan chinois	4 464 074	—	4 464 074	4,4
Riyal saoudien	4 136 609	—	4 136 609	4,0
Peso mexicain	2 858 609	—	2 858 609	2,8
Rand sud-africain	2 767 972	—	2 767 972	2,7
Dirham des Émirats arabes unis	2 088 739	—	2 088 739	2,0
Roupie indonésienne	1 964 680	—	1 964 680	1,9
Baht thaïlandais	1 803 139	—	1 803 139	1,8
Ringgit malais	1 304 040	—	1 304 040	1,3
Nouvelle livre turque	979 334	—	979 334	1,0
Riyal qatarien	875 550	—	875 550	0,9
Dinar koweïtien	798 607	—	798 607	0,8
Peso philippin	630 478	—	630 478	0,6
Peso chilien	545 078	—	545 078	0,5
Euro	519 184	—	519 184	0,5
Forint hongrois	236 883	—	236 883	0,2
Livre égyptienne	236 396	—	236 396	0,2
Peso colombien	144 264	—	144 264	0,1
Couronne tchèque	135 645	—	135 645	0,1
Dollar de Singapour	49 232	—	49 232	—
	102 384 457	—	102 384 457	99,8

31 décembre 2022				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	23 741 386	—	23 741 386	24,6
Dollar de Hong Kong	16 996 660	—	16 996 660	17,5
Nouveau dollar taiwanais	13 281 020	—	13 281 020	13,7
Won sud-coréen	10 584 331	—	10 584 331	10,9
Riyal saoudien	5 087 443	—	5 087 443	5,2
Réal brésilien	5 059 623	—	5 059 623	5,2
Yuan Renminbi	4 696 318	—	4 696 318	4,8
Rand sud-africain	2 967 610	—	2 967 610	3,1
Dirham des Émirats arabes unis	2 258 206	—	2 258 206	2,3
Peso mexicain	2 232 981	—	2 232 981	2,3
Baht thaïlandais	2 196 187	—	2 196 187	2,3
Roupie indonésienne	1 978 607	—	1 978 607	2,0
Nouvelle livre turque	1 159 940	—	1 159 940	1,2
Riyal qatarien	1 100 575	—	1 100 575	1,1
Ringgit malais	1 100 483	—	1 100 483	1,1
Peso philippin	739 515	—	739 515	0,8
Peso chilien	544 207	—	544 207	0,6
Euro	323 667	—	323 667	0,3
Forint hongrois	185 630	—	185 630	0,2
Peso colombien	136 069	—	136 069	0,1
Couronne tchèque	133 088	—	133 088	0,1
Livre égyptienne	92 066	—	92 066	0,1
Dollar de Singapour	55 319	—	55 319	0,1
	96 650 931	—	96 650 931	99,6

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 10 238 000 \$, ou environ 10,0 % de l'actif net. Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 98,5 % (83,1 % au 31 décembre 2022) de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 10 088 000 \$ (8 063 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débetures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	98,5	83,1
Australie	0,0	0,0
Brésil	6,2	5,5
Canada	0,0	—
Îles Caïmans	0,0	0,0
Chili	0,5	0,6
Chine	23,1	28,8
Colombie	0,1	0,1
République tchèque	0,1	0,1
Égypte	0,2	0,1
Grèce	0,4	0,4
Hong Kong	1,1	1,0
Hongrie	0,2	0,2
Inde	17,9	0,1
Indonésie	1,9	2,0
Koweït	0,8	0,0
Luxembourg	0,1	0,0
Malaisie	1,3	1,1
Mexique	2,8	2,3
Philippines	0,6	0,8
Qatar	0,9	1,1
Arabie saoudite	3,9	5,2
Singapour	0,0	2,1
Afrique du Sud	2,7	3,1
Corée du Sud	12,9	10,9
Taiwan	16,0	13,7
Thaïlande	1,8	0,3
Turquie	1,0	1,2
Émirats arabes unis	2,0	2,3
États-Unis	0,0	0,1
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT		
TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	1,3	17,5

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	100 878 869	—	—	100 878 869
Gain latent sur les contrats à terme normalisés	47 035	—	—	47 035
	102 132 449	—	—	102 132 449
31 décembre 2022				
Actions	80 633 367	—	—	80 633 367
Perte latente sur les contrats à terme normalisés	(442 335)	—	—	(442 335)
	80 191 032	—	—	80 191 032

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	267 461 398	224 066 737
Instruments dérivés	10 727	—
Trésorerie	2 211 562	1 816 238
Montant à recevoir pour la vente de titres	234 572	—
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	784 398	514 808
Total de l'actif	270 702 657	226 397 783
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	35 920	32 017
Montant à payer pour l'achat de titres	14 182	12 170
Charges à payer	12 089	10 782
Distributions à verser	1 949 992	1 582 350
Total du passif	2 012 183	1 637 319
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	268 690 474	224 760 464
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	24,37	21,87

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	8 457 626	7 945 635
Intérêts à distribuer	9 020	(434)
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(1 666 818)	(2 919 370)
Gain (perte) net réalisé sur les instruments dérivés	161 141	309
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	27 814 134	(22 063 081)
Variation du gain (perte) latent sur les instruments dérivés	10 727	—
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	34 785 830	(17 036 941)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(95 947)	(14 710)
Revenu tiré du prêt de titres	23 627	18 901
Total des revenus (pertes), montant net	34 713 510	(17 032 750)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	366 532	316 832
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	122 177	105 611
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 115
Retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts	792 041	691 980
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	45 010	41 688
Coûts de transactions	1 920	11 113
Total des charges	1 328 818	1 168 339
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	33 384 692	(18 201 089)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	3,21	(1,85)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	10 394 384	9 840 890

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	224 760 464	193 945 588
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	33 384 692	(18 201 089)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(6 891 368)	(6 518 165)
Remboursement de capital	(106 099)	(6 910)
	(6 997 467)	(6 525 075)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	38 847 365	58 736 288
Paieement au rachat	(21 304 580)	(3 195 248)
	17 542 785	55 541 040
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	43 930 010	30 814 876
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	268 690 474	224 760 464

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	33 384 692	(18 201 089)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	1 666 818	2 919 370
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(27 814 134)	22 063 081
Variation (du gain) de la perte latent sur les instruments dérivés	(10 727)	—
(Gain) perte de change latent	3 465	(70)
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés	(54 843 985)	(75 515 896)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés	37 364 080	19 391 643
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(269 590)	(327 314)
Charges à payer et autres montants à payer	5 210	6 859
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	(10 514 171)	(49 663 416)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables	38 847 365	59 359 230
Montant payé au rachat de parts rachetables	(21 304 580)	(3 195 248)
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(6 629 825)	(6 340 025)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	10 912 960	49 823 957
Gain (perte) de change latent	(3 465)	70
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	398 789	160 541
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	1 816 238	1 655 627
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	2 211 562	1 816 238
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	9 002	(416)
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	7 396 013	6 926 368

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 %			
Australie – 7,8 %			
AGL Energy Ltd.	7 790	62 025	66 446
Ampol Ltd.	3 035	85 338	98 716
ANZ Group Holdings Ltd.	37 316	870 054	870 262
APA Group, parts	16 236	146 139	124 755
Arcadium Lithium PLC	6 495	74 910	65 510
Aristocrat Leisure Ltd.	7 166	255 709	263 190
ASX Ltd.	2 424	175 611	137 533
Atlas Arteria Ltd., titres agrafés	13 283	76 839	69 079
Aurizon Holdings Ltd.	20 880	71 646	71 389
BHP Group Ltd.	62 956	2 523 609	2 855 446
BlueScope Steel Ltd.	5 358	101 491	112 808
Brambles Ltd.	17 425	178 412	213 222
CAR Group Ltd.	4 272	88 401	119 693
Charter Hall Group	6 008	97 179	65 084
Cochlear Ltd.	820	174 750	220 356
Coles Group Ltd.	15 730	247 450	228 005
Commonwealth Bank of Australia	20 740	1 820 423	2 086 271
Computershare Ltd.	6 646	116 504	145 845
CSL Ltd.	5 955	1 556 976	1 535 868
Dexus	13 541	125 211	93 569
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	700	69 447	37 122
EBOS Group Ltd.	1 919	57 867	56 875
Endeavour Group Ltd.	17 308	104 111	81 134
Evolution Mining Ltd.	22 986	91 589	81 899
Fortescue Ltd.	19 655	364 758	513 205
Goodman Group	22 894	444 393	521 150
GPT Group	22 599	98 424	94 347
IDP Education Ltd.	3 620	102 396	65 239
IGO Ltd.	7 750	75 864	63 106
Insurance Australia Group Ltd.	30 739	139 396	156 540
Lendlease Corp. Ltd.	8 969	90 797	60 282
Lottery Corp. Ltd.	28 097	118 151	122 356
Lynas Rare Earths Ltd.	11 911	94 206	76 733
Macquarie Group Ltd.	4 506	712 406	744 483
Medibank Pvt Ltd.	34 947	104 208	111 939
Mineral Resources Ltd.	2 124	108 918	133 774
Mirvac Group	46 793	113 256	87 993
National Australia Bank Ltd.	38 806	975 002	1 071 908
Northern Star Resources Ltd.	14 154	143 421	173 833
Orica Ltd.	5 800	78 515	83 183
Origin Energy Ltd.	21 536	103 830	164 123
Pilbara Minerals Ltd.	34 746	105 500	123 487
Pro Medicus Ltd.	684	47 376	58 976
Qantas Airways Ltd.	21 811	102 622	105 383
QBE Insurance Group Ltd.	18 678	201 854	248 889
Ramsay Health Care Ltd.	2 311	139 169	109 393
REA Group Ltd.	643	87 238	104 802
Reece Ltd.	3 584	64 517	72 201
Rio Tinto Ltd.	4 613	473 729	563 061
Santos Ltd.	40 592	259 820	277 571
Scentre Group	66 376	168 303	178 568
SEEK Ltd.	4 012	104 590	96 489
Seven Group Holdings Ltd.	1 943	39 368	64 509
Sonic Healthcare Ltd.	5 670	191 200	163 658
South32 Ltd.	56 913	177 689	170 520
Stockland	30 239	115 624	121 073
Suncorp Group Ltd.	15 871	167 547	197 776
Telstra Group Ltd.	143 699	489 904	511 999
TPG Telecom Ltd.	5 208	29 804	24 273
Transurban Group	38 341	483 598	472 956
Treasury Wine Estates Ltd.	9 130	94 205	88 554
Vicinity Ltd.	49 027	77 001	89 988
Washington H. Soul Pattinson & Co. Ltd.	2 649	72 881	78 105
Wesfarmers Ltd.	13 986	690 991	717 783
Westpac Banking Corp.	43 403	918 164	894 284
Whitehaven Coal Ltd.	9 543	79 470	63 882
WiseTech Global Ltd.	2 161	91 752	146 546
Woodside Energy Group Ltd.	23 593	608 172	659 333
Woolworths Group Ltd.	15 053	536 279	503 832
Worley Ltd.	4 707	68 406	73 945
	19 726 405	20 926 107	
Autriche – 0,3 %			
ANDRITZ AG	809	48 055	66 461
BAWAG Group AG	962	64 937	67 232
CA Immobilien Anlagen AG	514	24 125	24 295
Erste Group Bank AG	4 102	188 498	219 460
EVN AG	271	9 847	11 230
OMV AG	1 805	116 293	104 561
Raiffeisen Bank International AG	1 953	50 376	53 111
Telekom Austria AG	1 864	18 217	20 770
Verbund AG	365	40 861	44 686
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	567	21 439	21 886
voestalpine AG	1 360	65 684	56 576
Wienerberger AG	1 385	62 667	60 965
	710 999	751 233	

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Belgique – 0,8 %			
Ackermans & van Haaren NV	287	61 947	66 385
Ageas SA	1 821	116 259	104 268
Anheuser-Busch InBev SA	10 611	830 597	902 933
Azelis Group NV	1 439	48 992	46 490
Colruyt Group NV	627	37 908	37 262
D'ieren Group	266	48 853	68 541
Elia Group SA	357	62 391	58 916
Groupe Bruxelles Lambert NV	1 156	141 444	119 922
KBC Group NV	3 128	295 040	267 541
Proximus SADP	1 664	39 826	20 626
Sofina SA	184	84 349	60 410
Solvay SA	817	118 516	33 000
Syensqo SA	888	117 060	121 921
UCB SA	1 513	196 472	173 882
Umicore SA	2 420	147 267	87 771
Warehouses De Pauw CVA	2 007	90 351	83 316
	2 437 272	2 253 184	
Bermudes – 0,1 %			
Hafnia Ltd.	3 134	28 677	28 565
Liberty Global Ltd., cat. A	1 900	58 104	44 520
Liberty Global Ltd., cat. C	2 600	81 024	63 905
Seadrill Ltd.	860	46 166	53 430
	213 971	190 420	
Îles Caimans – 0,0 %			
Futu Holdings Ltd., CAAE	900	66 856	64 832
Chine – 0,1 %			
BYD Electronic International Co. Ltd.	10 000	55 148	61 805
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	100 000	151 199	122 597
Fosun International Ltd.	26 500	43 187	20 540
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	34 800	40 288	51 832
	289 822	256 774	
Danemark – 3,2 %			
AP Moller – Maersk AS, série B	44	146 417	104 373
AP Moller – Maersk AS, série A	34	94 546	79 589
Bakkafrost P	595	55 431	41 099
Carlsberg AS, série B	1 145	228 675	189 453
Chr Hansen Holding AS	1 296	141 286	143 380
Coloplast AS, série B	1 511	291 651	227 928
Danske Bank AS	8 375	201 874	295 214
Demant AS	1 041	59 059	60 208
DSV AS	2 206	570 403	511 002
Genmab AS	809	390 118	340 652
Novo Nordisk AS, cat. B	39 419	2 736 704	5 376 984
Novozymes AS, actions de cat. B	2 574	209 766	186 644
Orsted AS	2 375	380 725	173 700
Pandora AS	1 113	188 473	202 948
Tryg AS	4 039	116 238	115 934
Vestas Wind Systems AS	12 538	556 929	525 008
	6 368 295	8 574 116	
Finlande – 1,1 %			
Elisa OYJ, série A	1 756	128 361	107 094
Fortum OYJ	5 480	159 560	104 247
Huhtamaki OYJ	1 343	75 670	71 851
Kesko OYJ, série B	3 442	121 844	89 869
KONE OYJ, série B	4 153	359 715	273 183
Metso OYJ	8 825	113 817	117 875
Neste OYJ	5 394	357 917	253 069
Nokia OYJ	66 059	418 784	293 666
Nordea Bank Abp	39 632	551 941	648 051
Orion OYJ, série B	1 203	65 533	68 812
Sampo OYJ, série A	5 521	334 574	318 537
Stora Enso OYJ, série R	7 213	159 381	131 593
UPM-Kymmene OYJ	6 595	305 436	327 188
Wartsila OYJ Abp	6 175	95 901	118 052
	3 248 434	2 923 087	
France – 9,6 %			
Aéroports de Paris SA	356	58 041	60 774
Air Liquide SA	6 327	1 255 696	1 623 096
AXA SA	22 107	745 226	949 604
BioMérieux	538	84 695	78 835
BNP Paribas SA	13 318	1 023 601	1 214 176
Bolloré SE	9 800	62 766	80 723
Bouygues SA	2 463	112 124	122 408
Capgemini SE	1 970	488 521	541 615
Carrefour SA	6 841	163 691	165 063
Cie de Saint-Gobain SA	5 792	449 727	562 382
Compagnie Générale des Établissements Michelin SCA	8 375	382 047	395 978
Crédit Agricole SA	13 874	232 564	259 723
Danone SA	7 843	642 435	670 363
Dassault Systèmes SE	8 452	522 802	544 582
Engie SA	21 800	407 879	505 455
EssilorLuxottica SA	3 563	804 111	942 474
Hermès International SCA	402	767 723	1 123 553
Kering SA	888	797 987	516 088
Legrand SA	3 193	397 350	437 649
L'Oréal SA	2 781	1 476 994	1 825 485

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
France – 9,6 % (suite)			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3 228	2 997 586	3 449 298
Orange SA	23 372	341 532	350 784
Pernod Ricard SA	2 414	633 647	561 715
Safran SA	4 403	748 624	1 022 677
Sanofi SA	13 722	1 760 676	1 794 065
Sartorius Stedim Biotech	292	172 095	101 865
Schneider Electric SE	6 681	1 388 127	1 768 990
Société Générale SA	9 333	329 874	326 605
Sodexo SA	1 023	115 082	148 443
Thales SA	1 218	166 974	237 645
TotalEnergies SE	27 938	1 772 211	2 506 766
Vinci SA	6 024	799 167	997 662
	22 101 575	25 886 541	

Allemagne – 7,8 %			
adidas AG	2 063	743 672	553 391
Allianz SE	4 987	1 477 537	1 757 530
BASF SE	11 115	957 221	789 749
Bayer AG	12 232	882 470	599 187
Bayerische Motoren Werke AG	3 788	458 449	556 061
Bayerische Motoren Werke AG, priv.	748	80 481	98 003
Beiersdorf AG	1 226	179 331	242 330
BioNTech SE, CAAE	1 143	271 633	159 066
Carl Zeiss Meditec AG	409	101 857	58 883
Continental AG	1 362	197 468	152 600
Daimler Truck Holding AG	5 379	223 494	266 547
Delivery Hero SE	2 540	279 042	92 530
Deutsche Bank AG	24 296	376 173	437 554
Deutsche Boerse AG	2 286	499 728	621 002
Deutsche Post AG	11 753	801 531	767 887
Deutsche Telekom AG	40 092	1 000 497	1 270 149
Dr. Ing. hc F. Porsche AG, priv.	1 434	225 972	166 891
E.ON SE	27 573	424 367	487 976
Evonik Industries AG	2 589	91 677	69 766
Fresenius Medical Care AG	2 515	212 261	139 060
Fresenius SE & Co. KGaA	5 014	252 108	205 005
Hannover Rueck SE	753	181 425	237 241
Hapag-Lloyd AG	84	21 363	16 518
Heidelberg Materials AG	1 581	149 104	186 394
Henkel AG & Co. KGaA	1 221	116 326	115 567
Henkel AG & Co. KGaA, sans droit de vote, priv.	2 068	241 965	219 471
Infineon Technologies AG	16 187	782 544	891 243
Knorr-Bremse AG	761	106 453	65 178
Mercedes-Benz Group AG	9 771	967 664	890 234
Merck KGaA	1 614	401 929	338 770
MTU Aero Engines AG	675	190 353	191 970
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1 694	648 395	925 547
Porsche Automobil Holding SE	1 926	204 969	129 946
Puma SE	1 200	175 207	88 304
RWE AG	9 263	482 460	555 617
SAP SE	12 751	2 113 990	2 590 562
Sartorius AG, priv.	311	210 791	150 940
Siemens AG	9 183	1 791 451	2 272 830
Siemens Energy AG	6 399	213 122	111 849
Siemens Healthineers AG	3 372	262 339	258 352
Symrise AG	1 663	273 604	241 359
Talanx AG	564	28 475	53 111
Volkswagen AG	326	110 762	56 246
Volkswagen AG, priv, sans droit de vote	2 285	580 371	372 105
Vonovia SE	8 687	528 969	361 128
	20 521 000	20 811 649	

Hong Kong – 2,2 %			
AIA Group Ltd.	143 600	2 013 814	1 650 157
Alibaba Health Information Technology Ltd.	54 000	99 739	38 664
Budweiser Brewing Co. APAC Ltd.	18 700	68 918	46 167
Cathay Pacific Airways Ltd.	9 000	9 464	12 402
China Gas Holdings Ltd.	28 000	83 089	36 455
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	38 000	229 088	134 755
Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd.	20 800	45 242	40 814
CK Asset Holdings Ltd.	23 878	186 278	158 062
CK Hutchison Holdings Ltd.	33 500	288 643	236 746
CK Infrastructure Holdings Ltd.	7 500	56 404	54 713
CLP Holdings Ltd.	23 500	280 391	255 760
DFI Retail Group Holdings Ltd.	4 600	13 460	14 557
ESR Group Ltd.	34 400	124 148	62 737
Galaxy Entertainment Group Ltd.	24 000	202 135	177 309
Geely Automobile Holdings Ltd.	72 000	208 939	104 440
Hang Lung Properties Ltd.	20 000	58 705	36 745
Hang Seng Bank Ltd.	9 100	206 277	139 915
Henderson Land Development Co. Ltd.	15 000	79 347	60 918
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd., parts	24 500	31 500	19 486
HKT Trust & HKT Ltd., parts	41 000	70 929	64 527
Hong Kong & China Gas Co. Ltd.	118 100	201 428	119 260
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	14 800	1 034 924	669 791
Hongkong Land Holdings Ltd.	12 800	78 765	58 736
Jardine Matheson Holdings Ltd.	2 500	172 206	135 849
Link REIT	31 906	320 564	236 257

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Hong Kong – 2,2 % (suite)			
MTR Corp. Ltd.	19 955	132 680	102 103
New World Development Co. Ltd.	16 000	91 010	32 747
Power Assets Holdings Ltd.	16 000	117 253	122 259
Sands China Ltd.	30 400	129 472	117 301
Sino Biopharmaceutical Ltd.	117 000	104 815	68 558
Sino Land Co. Ltd.	39 015	66 710	55 935
Sun Hung Kai Properties Ltd.	18 500	311 897	263 824
Swire Pacific Ltd., cat. A	5 000	37 005	55 810
Swire Pacific Ltd., cat. B	10 000	15 854	17 258
Swire Properties Ltd.	13 200	46 913	35 219
Techtronic Industries Co. Ltd.	17 000	349 283	267 121
WH Group Ltd.	97 358	93 225	82 860
Wharf Holdings Ltd.	12 000	44 489	50 964
Wharf Real Estate Investment Co. Ltd.	18 000	120 293	80 245
Xinyi Glass Holdings Ltd.	18 782	73 630	27 784
	7 898 926	5 945 210	

Irlande – 0,9 %			
AIB Group PLC	14 547	88 645	82 213
Bank of Ireland Group PLC	13 298	185 145	159 181
DCC PLC	1 257	119 404	122 086
Flutter Entertainment PLC	2 200	480 060	512 720
ICON PLC	1 004	316 415	374 749
James Hardie Industries PLC	5 512	229 238	280 157
Kerry Group PLC, série A	1 928	301 702	220 902
Kingspan Group PLC	1 921	229 999	219 372
Ryanair Holdings PLC, CAAE parrainé	2 099	249 339	369 106
Smurfit Kappa Group PLC	3 256	201 079	170 167
	2 401 026	2 510 653	

Israël – 0,9 %			
Airport City Ltd.	761	18 864	17 249
Amot Investments Ltd.	2 895	25 294	20 651
Ashtrom Group Ltd.	426	12 110	8 768
Azrieli Group Ltd.	399	38 587	34 219
Bank Hapoalim BM	15 626	175 638	186 023
Bank Leumi Le-Israel BM	18 450	195 628	196 671
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	22 725	37 034	40 992
Big Shopping Centers Ltd.	131	22 745	17 831
Camtek Ltd.	356	26 340	33 164
Check Point Software Technologies Ltd.	1 100	172 927	221 616
CyberArk Software Ltd.	451	91 329	130 266
Delek Group Ltd.	104	21 663	17 823
Elbit Systems Ltd.	316	71 245	88 869
Energix-Renewable Energies Ltd.	2 800	12 743	13 626
Enlight Renewable Energy Ltd.	1 235	35 564	31 714
Fattal Holdings 1998 Ltd.	73	12 441	10 666
First International Bank Of Israel Ltd.	613	28 848	33 177
Global-e Online Ltd.	800	38 658	41 805
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	1 057	13 263	10 985
ICL Group Ltd.	8 759	83 119	58 728
Inmode Ltd.	900	41 861	26 393
Israel Corp. Ltd.	44	20 329	14 822
Israel Discount Bank Ltd., série A	15 166	101 860	100 520
Melison Ltd.	246	22 346	25 223
Mivne Real Estate KD Ltd.	6 611	27 091	26 024
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	1 917	76 968	98 277
Monday.com Ltd.	300	51 794	74 294
Nice Ltd.	794	235 548	211 987
Nova Ltd.	326	43 479	59 927
OPC Energy Ltd.	908	11 631	7 814
Phoenix Holdings Ltd.	1 770	23 472	23 755
Plus500 Ltd.	900	20 985	25 159
Shapir Engineering & Industry Ltd.	1 583	15 890	13 454
Strauss Group Ltd.	701	25 399	17 458
Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	13 789	170 808	193 895
Tower Semiconductor Ltd.	1 194	49 451	48 401
Wix.com Ltd.	714	142 914	115 821
	2 215 866	2 298 067	

Italie – 2,1 %			
A2A SpA	20 296	45 913	54 958
Amplifon SpA	1 682	89 393	76 783
Assicurazioni Generali SpA	12 816	317 880	356 646
Banca Mediolanum SpA	2 573	29 053	31 984
Banco BPM SpA	16 248	116 273	113 150
Davide Campari-Milano NV	6 316	99 953	93 976
DiaSorin SpA	291	58 099	39 521
Enel SpA	95 438	979 500	935 566
Eni SpA	26 408	432 998	590 371
FinecoBank Banca Fineco SpA	7 729	157 987	152 940
Hera SpA	8 689	42 437	37 615
Infrastrutture Wireless Italiane SpA	3 776	53 081	62 976
Interpump Group SpA	819	71 111	55 914
Intesa Sanpaolo SpA	192 944	625 443	742 931
Leonardo SpA	5 087	54 076	110 664
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	7 428	103 916	121 233
Moncler SpA	2 438	188 817	197 800
Nexi SpA	5 975	114 090	64 455
Pirelli & C SpA	3 299	23 828	23 676
Poste Italiane SpA	5 826	89 291	87 195

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Italie – 2,1 % (suite)			
PRADA SpA	5 900	43 013	44 485
Prysmian SpA	3 131	137 569	187 759
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	1 143	83 344	81 296
Snam SpA	25 622	178 542	173 728
Stevanato Group SpA	242	7 712	8 708
Telecom Italia SpA	140 547	77 405	60 229
Telecom Italia SpA	64 311	33 403	28 374
Terna – Rete Elettrica Nazionale	17 626	173 121	193 941
UniCredit SpA	21 330	374 503	763 212
UnipolSai Assicurazioni SpA	3 525	12 060	11 604
	4 813 811		5 503 690
Japon – 24,5 %			
ABC-Mart, Inc.	1 200	22 947	27 666
Acom Co. Ltd.	3 500	17 430	11 533
Advantest Corp.	9 100	259 918	408 288
Aeon Co. Ltd.	9 500	298 719	279 980
Aeon Mall Co. Ltd.	1 400	25 687	23 203
AGC, Inc.	2 400	128 310	117 535
Air Water, Inc.	2 100	39 756	37 839
Aisin Corp.	1 900	89 062	87 664
Ajinomoto Co., Inc.	6 600	230 372	335 814
Alfresa Holdings Corp.	2 400	51 378	53 795
Amada Co. Ltd.	4 400	58 198	60 496
ANA Holdings, Inc.	5 700	162 348	163 137
Asahi Group Holdings Ltd.	6 000	310 092	295 072
Asahi Intecc Co. Ltd.	2 400	80 793	64 390
Asahi Kasei Corp.	17 200	213 628	167 147
Asics Corp.	2 200	87 640	90 908
Astellas Pharma, Inc.	22 300	447 877	351 656
Azbil Corp.	1 700	87 573	74 191
Bandai Namco Holdings, Inc.	7 200	226 071	190 343
BayCurrent Consulting, Inc.	1 600	64 345	74 092
Bridgestone Corp.	6 800	358 569	371 430
Brother Industries Ltd.	2 800	69 216	58 938
Calbee, Inc.	1 000	30 411	26 502
Canon, Inc.	12 500	365 962	423 228
Capcom Co. Ltd.	2 100	78 667	89 487
Central Japan Railway Co.	11 600	407 961	388 849
Chiba Bank Ltd.	9 400	74 356	89 546
Chubu Electric Power Co., Inc.	8 900	129 451	151 626
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	8 000	369 098	399 714
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings, Inc.	1 500	27 076	28 403
Concordia Financial Group Ltd.	14 500	77 030	87 421
Cosmos Pharmaceutical Corp.	200	40 473	30 463
CyberAgent, Inc.	4 700	100 734	38 909
Dai Nippon Printing Co. Ltd.	3 000	97 124	117 091
Daifuku Co. Ltd.	4 300	158 816	114 723
Dai-ichi Life Holdings, Inc.	12 100	304 644	338 612
Daiichi Sankyo Co. Ltd.	23 800	795 937	861 922
Daikin Industries Ltd.	3 400	851 699	730 935
Daito Trust Construction Co. Ltd.	700	95 415	107 046
Daiwa House Industry Co. Ltd.	7 700	285 121	307 665
Daiwa House REIT Investment Corp.	30	94 211	70 625
Daiwa Securities Group, Inc.	18 000	125 012	159 786
Denso Corp.	22 200	457 813	441 648
Dentsu Group, Inc.	2 500	108 290	84 599
Disco Corp.	1 100	177 710	359 889
East Japan Railway Co.	4 600	365 309	349 744
Ebara Corp.	1 200	73 936	93 696
Eisai Co. Ltd.	3 500	300 321	230 853
Electric Power Development Co. Ltd.	1 800	32 827	38 528
ENEOS Holdings, Inc.	35 000	177 362	183 452
FANUC Corp.	11 700	591 616	453 811
Fast Retailing Co. Ltd.	2 100	607 268	687 256
Fuji Electric Co. Ltd.	1 600	91 559	90 822
FUJIFILM Holdings Corp.	3 800	320 684	301 145
Fujitsu Ltd.	2 400	462 681	477 569
Fukuoka Financial Group, Inc.	2 400	57 128	74 683
GLP J-Reit	61	116 522	80 161
GMO Payment Gateway, Inc.	500	76 639	45 821
Hakuhodo DY Holdings, Inc.	2 600	49 537	26 276
Hamamatsu Photonics KK	1 800	122 434	97 646
Hankyu Hanshin Holdings, Inc.	2 800	109 819	117 561
Haseko Corp.	2 800	43 807	47 978
Hikari Tsushin, Inc.	200	44 830	43 735
Hirose Electric Co. Ltd.	400	68 120	59 729
Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	800	41 507	32 257
Hitachi Construction Machinery Co. Ltd.	1 100	41 005	38 345
Hitachi Ltd.	11 400	775 766	1 084 380
Honda Motor Co. Ltd.	63 200	789 559	866 576
Hoshizaki Corp.	1 200	64 650	57 926
Hoya Corp.	4 300	717 689	708 848
Hulic Co. Ltd.	6 500	82 297	89 764
Ibiden Co. Ltd.	1 500	91 287	109 642
Idemitsu Kosan Co. Ltd.	15 000	96 167	107 678
IHI Corp.	1 800	52 283	46 483
Iida Group Holdings Co. Ltd.	1 700	47 197	33 573
Inpex Corp.	11 200	123 364	199 505
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	4 100	38 912	58 825

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Japon – 24,5 % (suite)			
Isuzu Motors Ltd.	7 600	117 576	129 088
Ito En Ltd.	600	45 057	24 030
ITOCHU Corp.	15 400	605 081	830 666
J Front Retailing Co. Ltd.	2 600	28 986	31 200
Japan Airlines Co. Ltd.	5 400	141 406	140 156
Japan Exchange Group, Inc.	6 700	188 113	186 932
Japan Metropolitan Fund Invest	80	91 493	76 246
Japan Post Bank Co. Ltd.	4 300	48 760	57 754
Japan Post Holdings Co. Ltd.	26 400	281 923	310 998
Japan Post Insurance Co. Ltd.	2 300	51 782	53 866
Japan Tobacco, Inc.	13 800	357 973	470 470
JFE Holdings, Inc.	6 700	106 581	137 081
JGC Holdings Corp.	2 500	30 558	38 055
JSR Corp.	2 600	103 231	97 759
JTEKT Corp.	2 700	30 882	30 140
Kajima Corp.	5 600	93 620	123 427
Kansai Electric Power Co., Inc.	9 200	117 861	161 083
Kansai Paint Co. Ltd.	2 500	71 452	56 329
Kao Corp.	5 500	408 387	298 364
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	1 900	49 346	55 427
Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	1 600	46 057	90 538
KDDI Corp.	19 200	762 347	805 594
Keihan Holdings Co. Ltd.	1 200	48 336	41 371
Keiryu Corp.	2 700	38 714	32 539
Keio Corp.	1 200	84 350	49 822
Keisei Electric Railway Co. Ltd.	1 900	76 342	118 425
Kewpie Corp.	1 200	33 243	27 885
Keyence Corp.	2 300	1 429 289	1 336 333
Kikkoman Corp.	1 900	159 587	153 434
Kintetsu Group Holdings Co. Ltd.	2 200	95 327	92 020
Kirin Holdings Co. Ltd.	10 200	229 624	197 100
Kobayashi Pharmaceutical Co. Ltd.	700	62 764	44 455
Kobe Bussan Co. Ltd.	1 700	67 981	66 241
Koei Tecmo Holdings Co. Ltd.	1 260	33 501	18 956
Koito Manufacturing Co. Ltd.	2 800	98 809	57 550
Komatsu Ltd.	11 200	367 843	386 335
Konami Group Corp.	1 200	84 365	82 865
Kose Corp.	400	63 435	39 564
Kubota Corp.	13 000	331 696	258 075
Kuraray Co. Ltd.	3 800	46 379	50 665
Kurita Water Industries Ltd.	1 300	75 277	67 118
Kyocera Corp.	16 800	315 164	323 378
Kyowa Kirin Co. Ltd.	3 200	111 013	70 934
Kyushu Electric Power Co., Inc.	6 000	60 345	57 297
Kyushu Railway Co.	1 600	46 591	46 496
Lasertec Corp.	1 000	230 530	347 655
Lawson, Inc.	500	28 750	34 059
Lion Corp.	2 700	53 673	33 044
Lixil Corp.	3 100	99 638	51 045
LY Corp.	32 400	208 185	151 429
M3, Inc.	5 200	373 220	113 468
Makita Corp.	3 100	172 512	112 789
Marubeni Corp.	20 900	255 331	435 627
Marui Group Co. Ltd.	1 900	46 097	42 019
MatsukiyoCocokara & Co.	4 200	61 603	98 090
Mazda Motor Corp.	7 300	78 856	104 021
McDonald's Holdings Co. Japan Ltd.	1 000	57 369	57 147
Mebuki Financial Group, Inc.	13 800	40 923	55 359
Medipal Holdings Corp.	2 100	49 236	44 891
MEIJ Holdings Co. Ltd.	3 400	129 539	106 500
Mercari, Inc.	1 200	60 149	29 322
MINEBEA MITSUMI, Inc.	4 900	148 332	132 839
MISUMI Group, Inc.	3 700	144 028	82 692
Mitsubishi Chemical Group Corp.	18 000	168 225	145 459
Mitsubishi Corp.	45 900	630 485	967 444
Mitsubishi Electric Corp.	24 400	411 118	456 203
Mitsubishi Estate Co. Ltd.	14 200	270 798	258 058
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	2 000	52 400	42 192
Mitsubishi HC Capital, Inc.	10 600	72 690	93 868
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	4 100	179 376	316 023
Mitsubishi Motors Corp.	7 300	25 692	30 657
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	141 900	1 061 146	1 607 909
Mitsui & Co. Ltd.	18 600	579 670	921 681
Mitsui Chemicals, Inc.	2 200	79 496	86 052
Mitsui Fudosan Co. Ltd.	11 300	317 139	365 476
Mitsui OSK Lines Ltd.	4 500	115 290	190 116
Miura Co. Ltd.	1 000	56 735	26 263
Mizuho Financial Group, Inc.	31 400	570 030	708 521
MonotaRO Co. Ltd.	2 700	80 168	38 878
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	5 300	216 732	274 923
Murata Manufacturing Co. Ltd.	23 000	721 614	643 858
Nagoya Railroad Co. Ltd.	2 100	50 946	44 449
NEC Corp.	3 200	209 203	249 915
Nexon Co. Ltd.	5 400	158 777	129 777
NGK Insulators Ltd.	3 400	68 217	53 600
NH Foods Ltd.	1 200	54 530	53 649
Nichirei Corp.	1 700	54 114	55 238
NIDEC Corp.	6 000	765 450	319 595
Nikon Corp.	3 600	46 417	47 005

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Japon – 24,5 % (suite)			
Nintendo Co. Ltd.	14 300	918 661	984 261
Nippon Building Fund, Inc.	19	138 954	108 580
NIPPON EXPRESS HOLDINGS, Inc.	1 100	91 588	82 451
Nippon Paint Holdings Co. Ltd.	11 300	177 444	120 487
Nippon Prologis REIT, Inc.	26	101 248	65 999
Nippon Sanso Holdings Corp.	2 400	64 690	84 762
Nippon Shinyaku Co. Ltd.	700	63 273	32 710
Nippon Steel Corp.	10 700	236 136	323 252
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	665 900	926 661	1 073 124
Nippon Television Holdings, Inc.	2 000	26 290	28 798
Nippon Yusen KK	6 200	162 123	253 471
Nissan Chemical Corp.	1 500	102 327	77 247
Nissan Motor Co. Ltd.	27 800	166 530	144 101
Nissin Seifun Group, Inc.	3 000	56 427	53 271
Nissin Foods Holdings Co. Ltd.	2 400	83 687	110 464
Niterra Co. Ltd.	2 600	64 230	81 441
Nitori Holdings Co. Ltd.	1 000	204 890	176 587
Nitto Denko Corp.	1 900	182 761	187 483
Nomura Holdings, Inc.	37 800	229 433	225 457
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	1 100	32 433	38 160
Nomura Real Estate Master Fund, Inc.	52	91 208	80 250
Nomura Research Institute Ltd.	4 900	195 205	187 950
NSK Ltd.	5 800	55 723	41 391
NTT Data Group Corp.	7 800	167 655	145 835
Obayashi Corp.	8 800	94 974	100 415
OBIC Business Consultants Co. Ltd.	400	22 241	24 131
Obic Co. Ltd.	800	176 982	181 787
Odakyu Electric Railway Co. Ltd.	3 900	111 504	78 462
Oji Holdings Corp.	12 100	77 288	61 453
Olympus Corp.	15 700	405 039	299 634
Omron Corp.	2 400	245 014	147 771
Ono Pharmaceutical Co. Ltd.	5 600	171 337	131 781
Open House Group Co. Ltd.	900	50 801	35 212
Oracle Corp.	400	42 708	40 667
Oriental Land Co. Ltd.	13 700	562 955	672 850
ORIX Corp.	14 400	326 911	357 722
Orix JREIT, Inc.	33	66 852	51 391
Osaka Gas Co. Ltd.	5 200	121 707	143 233
Otsuka Corp.	1 400	84 127	76 117
Otsuka Holdings Co. Ltd.	5 400	260 358	267 130
Pan Pacific International Holdings Corp.	4 800	120 870	151 026
Panasonic Holdings Corp.	27 700	385 063	361 806
Persol Holdings Co. Ltd.	20 000	54 291	45 288
Pola Orbis Holdings, Inc.	700	20 382	10 371
Rakus Co. Ltd.	1 200	35 602	29 322
Rakuten Group, Inc.	18 100	172 646	106 315
Recruit Holdings Co. Ltd.	17 900	1 057 079	998 328
Renesas Electronics Corp.	15 100	234 101	360 000
Resona Holdings, Inc.	29 900	166 591	200 375
Resonac Holdings Corp.	2 300	68 485	60 449
Ricoh Co. Ltd.	7 300	82 909	73 945
Rinnai Corp.	1 200	45 392	36 679
Rohm Co. Ltd.	4 400	125 841	111 218
Rohto Pharmaceutical Co. Ltd.	2 200	62 202	58 500
Ryohin Keikaku Co. Ltd.	3 000	70 528	66 206
Santen Pharmaceutical Co. Ltd.	4 700	81 168	61 763
SBI Holdings, Inc.	2 900	89 679	86 037
SCREEN Holdings Co. Ltd.	1 200	77 148	133 899
SCSK Corp.	1 700	40 696	44 457
Secom Co. Ltd.	2 600	251 329	246 950
Sega Sammy Holdings, Inc.	1 900	37 538	35 044
Seibu Holdings, Inc.	2 500	35 100	45 760
Seiko Epson Corp.	3 300	67 741	65 141
Sekisui Chemical Co. Ltd.	4 800	101 128	91 249
Sekisui House Ltd.	7 300	187 367	213 846
Seven & i Holdings Co. Ltd.	9 500	510 778	497 141
Seven Bank Ltd.	6 100	15 787	17 099
SG Holdings Co. Ltd.	5 800	157 683	109 798
Sharp Corp.	3 800	59 103	35 737
Shimadzu Corp.	3 500	154 518	129 045
Shimamura Co. Ltd.	300	35 934	44 221
Shimano, Inc.	1 000	298 711	204 225
Shimizu Corp.	6 400	58 266	56 065
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	24 300	1 000 707	1 344 818
Shinko Electric Industries Co. Ltd.	700	33 878	35 905
Shionogi & Co. Ltd.	3 700	265 579	235 255
Shiseido Co. Ltd.	4 800	368 068	190 893
Shizuoka Financial Group, Inc.	6 200	57 871	69 297
SMC Corp.	700	517 195	496 014
SoftBank Corp.	34 800	561 540	572 696
SoftBank Group Corp.	12 100	928 566	712 195
Sohgo Security Services Co. Ltd.	4 000	45 339	30 349
Sojitz Corp.	2 860	63 391	85 198
Sompo Holdings, Inc.	4 100	224 171	264 446
Sony Group Corp.	15 300	1 960 685	1 919 004
Square Enix Holdings Co. Ltd.	1 000	69 114	47 355
Stanley Electric Co. Ltd.	1 700	57 495	42 183
Subaru Corp.	7 700	181 591	186 241
Sugi Holdings Co. Ltd.	400	30 568	24 251

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Japon – 24,5 % (suite)			
SUMCO Corp.	4 300	104 875	85 042
Sumitomo Chemical Co. Ltd.	17 600	106 210	56 627
Sumitomo Corp.	14 700	285 486	422 921
Sumitomo Electric Industries Ltd.	9 200	157 339	154 500
Sumitomo Heavy Industries Ltd.	1 200	37 178	39 900
Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	3 200	162 184	127 082
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	16 200	783 751	1 042 459
Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	8 200	178 443	207 538
Sumitomo Realty & Development Co. Ltd.	5 300	198 407	207 903
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	2 000	27 366	28 658
Sundrug Co. Ltd.	800	29 200	33 911
Suntory Beverage & Food Ltd.	1 500	72 214	65 238
Suzuki Motor Corp.	4 800	252 114	270 851
Sysmex Corp.	2 000	245 981	146 993
T&D Holdings, Inc.	6 700	117 366	140 403
Taisei Corp.	2 000	84 949	90 201
Taisho Pharmaceutical Holdings Co. Ltd.	600	42 549	48 515
Taiyo Yuden Co. Ltd.	1 600	92 485	55 819
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	19 000	767 112	720 432
TBS Holdings, Inc.	1 800	40 913	50 490
TDK Corp.	4 600	239 513	288 994
Terumo Corp.	9 000	427 255	389 070
THK Co. Ltd.	1 700	50 009	43 956
TIS, Inc.	3 000	97 200	87 180
Tobu Railway Co. Ltd.	2 400	79 161	85 053
Toei Animation Co. Ltd.	100	20 254	17 705
Toho Co. Ltd.	1 200	65 967	53 526
Tohoku Electric Power Co., Inc.	5 300	50 185	47 534
Tokio Marine Holdings, Inc.	23 700	563 765	782 268
Tokyo Century Corp.	2 000	29 048	28 564
Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc.	18 800	76 275	129 857
Tokyo Electron Ltd.	5 600	1 028 962	1 322 790
Tokyo Gas Co. Ltd.	5 200	135 139	157 484
Tokyu Corp.	6 500	109 192	104 628
Tokyu Fudosan Holdings Corp.	7 700	56 085	64 918
TOPPAN Holdings, Inc.	3 300	78 751	121 455
Toray Industries, Inc.	19 100	145 872	130 964
Tosoh Corp.	3 400	71 471	57 273
TOTO Ltd.	1 700	109 888	59 038
Toy Suisan Kaisha Ltd.	1 100	61 713	74 900
Toyota Boshoku Corp.	600	13 586	12 557
Toyota Industries Corp.	2 100	205 444	225 877
Toyota Motor Corp.	141 400	3 032 332	3 426 010
Toyota Tsusho Corp.	2 900	164 689	225 346
Trend Micro, Inc.	1 700	113 907	120 015
Tsuruha Holdings, Inc.	500	72 822	60 444
Unicharm Corp.	5 200	273 264	247 947
United Urban Investment Corp.	39	61 000	52 563
USS Co. Ltd.	2 200	49 440	58 356
Welcia Holdings Co. Ltd.	1 000	41 892	23 065
West Japan Railway Co.	3 000	180 189	165 017
Workman Co. Ltd.	200	17 010	7 782
Yakult Honsha Co. Ltd.	3 400	116 765	100 712
Yamada Holdings Co. Ltd.	7 800	41 949	31 983
Yamaha Corp.	1 800	122 477	54 833
Yamaha Motor Co. Ltd.	10 800	109 184	127 226
Yamato Holdings Co. Ltd.	3 900	116 315	95 041
Yamazaki Baking Co. Ltd.	1 500	25 505	45 119
Yaskawa Electric Corp.	3 300	187 749	181 796
Yokogawa Electric Corp.	2 800	60 272	70 421
Yokohama Rubber Co. Ltd.	1 400	29 479	42 334
Zensho Holdings Co. Ltd.	1 100	80 973	76 021
ZOZO, Inc.	1 500	56 981	44 544
		63 392 738	65 669 282
Jordanie – 0,0 %			
Hikma Pharmaceuticals PLC	2 051	75 693	61 678
Luxembourg – 0,2 %			
ArcelorMittal SA	5 670	198 470	212 047
B&M European Value Retail SA	10 663	106 429	100 410
Eurofins Scientific SE	1 609	200 053	138 229
Millicom International Cellular SA, CAAE	1 516	39 080	35 754
Tenaris SA	5 889	85 386	135 058
		629 418	621 498
Pays-Bas – 7,3 %			
Adyen NV	374	998 330	635 523
AerCap Holdings NV	2 200	155 336	215 596
Airbus SE	7 269	1 121 806	1 479 986
Akzo Nobel NV	2 139	274 154	233 113
Argenx SE, CAAE	723	345 284	362 682
ASM International NV	574	323 385	392 917
ASML Holding NV	4 902	4 024 776	4 867 483
EXOR NV	1 230	134 029	162 141
Ferrari NV	1 624	479 216	721 952
Ferrovial SE	5 894	225 188	283 482
HAL Trust	1 136	217 160	188 304
Heineken Holding NV	1 397	158 425	155 870
Heineken NV	3 581	475 662	479 564
ING Groep NV	43 697	696 420	860 912

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Pays-Bas – 7,3 % (suite)			
JDE Peet's NV	1 075	45 765	38 144
Koninklijke Ahold Delhaize NV	11 961	470 258	453 241
Koninklijke KPN NV	40 696	170 678	184 827
Koninklijke Philips NV	9 904	461 919	304 174
NXP Semiconductors NV	3 204	789 724	970 351
Prosus NV	18 550	902 451	729 129
Shell PLC	83 135	2 523 028	3 593 564
Stellantis NV	27 086	638 314	834 436
STMicroelectronics NV	1 333	80 483	87 849
STMicroelectronics NV	6 769	352 540	445 756
Universal Music Group NV	9 593	314 345	360 645
Wolters Kluwer NV	3 089	409 297	579 074
	16 787 973		19 620 715
Nouvelle-Zélande – 0,3 %			
a2 Milk Co. Ltd.	8 416	58 198	32 321
Auckland International Airport Ltd.	15 329	102 197	112 620
Contact Energy Ltd.	10 010	66 975	66 940
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	6 996	181 633	137 842
Infratil Ltd.	9 851	67 296	82 490
Mainfreight Ltd.	926	62 475	53 575
Mercury NZ Ltd.	7 787	40 495	42 908
Meridian Energy Ltd.	16 338	73 725	75 566
Ryman Healthcare Ltd.	5 893	56 596	29 027
Spark New Zealand Ltd.	23 352	95 939	100 989
Xero Ltd.	1 601	182 205	161 768
	987 734		896 046
Norvège – 0,8 %			
Adevinta ASA, série B	2 724	45 072	39 754
Aker ASA, série A	255	26 619	22 050
Aker BP ASA	3 895	163 036	149 440
AutoStore Holdings Ltd.	10 147	33 047	26 323
DNB Bank ASA	10 722	294 085	300 699
Equinor ASA	10 913	356 555	456 463
Frontline PLC	1 809	34 877	47 657
Gjensidige Forsikring ASA	2 355	64 322	57 332
Kongsberg Gruppen ASA	928	31 622	56 076
Leroy Seafood Group ASA	3 299	34 609	17 922
Mowi ASA	5 598	163 355	132 284
Nordic Semiconductor ASA	1 800	62 214	29 447
Norsk Hydro ASA	16 497	139 745	146 509
Orkla ASA	10 117	116 686	103 562
Salmar ASA	841	68 776	62 153
Schibsted ASA	804	34 262	30 545
Schibsted ASA, série B	1 107	50 281	39 756
SpareBank 1 SR-Bank ASA	2 046	35 440	34 242
Storebrand ASA	5 612	62 144	65 608
Telenor ASA	7 536	144 599	114 089
TOMRA Systems ASA	2 593	84 563	41 562
Var Energi ASA	4 879	26 092	20 373
Wallenius Wilhelmsen ASA	1 244	11 023	14 375
Yara International ASA	1 870	114 830	87 699
	2 197 854		2 095 920
Pologne – 0,4 %			
Allegro.eu SA	6 076	80 747	67 898
Bank Polska Kasa Opieki SA	2 238	74 474	114 109
Budimex SA	183	28 753	38 415
CD Projekt SA	824	55 785	31 776
Cyfrowy Polsat SA	2 582	26 528	10 676
Dino Polska SA	576	57 698	88 984
InPost SA	2 266	43 228	41 307
KGHM Polska Miedz SA	1 754	88 176	72 168
mBank SA	160	18 726	28 704
ORLEN SA	7 333	149 888	161 063
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	11 839	32 741	34 451
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski SA	10 784	125 543	181 967
Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA	7 361	80 529	116 679
Santander Bank Polska SA	371	34 267	60 935
	897 083		1 049 132
Portugal – 0,2 %			
Banco Comercial Portugues SA	100 456	26 160	40 151
EDP – Energias de Portugal SA	35 159	237 476	233 272
Galp Energia SGPS SA, série B	6 064	85 406	117 829
Jeronimo Martins SGPS SA	3 485	93 788	116 956
Navigator Co. SA	2 363	12 826	12 212
	455 656		520 420
Singapour – 1,4 %			
CapitaLand Ascendas REIT	46 000	128 370	139 327
CapitaLand Integrated Commercial Trust	57 720	138 146	118 858
CapitaLand Investment Ltd.	27 700	91 860	87 499
City Developments Ltd.	5 700	38 312	37 891
DBS Group Holdings Ltd.	22 695	652 290	757 953
Fraser's Logistics & Commercial Trust	29 200	39 436	33 567
Genting Singapore Ltd.	69 600	53 722	69 574
Grab Holdings Ltd., cat. A	21 300	86 292	94 650
Jardine Cycle & Carriage Ltd.	1 100	26 898	32 724
Keppel Corp. Ltd.	17 600	90 520	124 385

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Singapour – 1,4 % (suite)			
Keppel DC REIT	16 400	38 442	31 968
Keppel REIT	3 220	2 586	2 993
Mapletree Industrial Trust	26 686	68 635	66 956
Mapletree Logistics Trust	38 500	69 982	66 965
Mapletree Pan Asia Commercial Trust	26 800	45 271	42 060
Olam Group Ltd.	12 380	19 476	12 870
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	39 990	439 353	519 673
SATS Ltd.	11 377	41 978	31 275
Sea Ltd., CAAE	4 400	727 389	234 974
Seatrium Ltd.	824 269	106 863	97 227
Sembcorp Industries Ltd.	11 000	50 973	58 388
Singapore Airlines Ltd.	16 800	84 954	110 166
Singapore Exchange Ltd.	10 400	95 954	102 193
Singapore Technologies Engineering Ltd.	17 100	62 953	66 494
Singapore Telecommunications Ltd.	88 100	203 496	217 525
United Overseas Bank Ltd.	16 700	425 248	474 935
UOL Group Ltd.	5 600	37 312	35 155
Venture Corp. Ltd.	3 600	59 512	48 977
Wilmar International Ltd.	26 600	107 984	94 926
	4 034 207		3 812 148
Espagne – 2,5 %			
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	2 585	93 827	151 214
Aena SME SA	922	188 775	220 383
Amadeus IT Group SA, cat. A	5 596	463 792	528 842
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	73 988	575 993	886 519
Banco Santander SA	196 679	848 288	1 082 755
CaixaBank SA	47 268	186 977	256 536
Cellnex Telecom SA	7 106	488 161	369 100
Corp. ACCIONA Energias Renovables SA	636	29 535	26 013
EDP Renovaveis SA	3 771	110 652	101 754
Endesa SA	4 030	114 802	108 361
Grifols SA	3 799	107 264	85 522
Grifols SA, série B, priv.	2 859	52 679	43 934
Iberdrola SA	71 788	1 095 432	1 241 196
Industria de Diseno Textil SA	13 740	577 563	789 135
International Consolidated Airlines Group SA	46 399	122 855	120 891
Naturgy Energy Group SA	1 548	47 985	60 880
Redeia Corp. SA	4 758	116 589	103 333
Repsol SA	16 024	251 629	313 929
Telefonica SA	64 519	363 073	332 118
	5 835 871		6 822 415
Suède – 3,5 %			
AAK AB	2 275	62 865	66 915
AddTech AB, série B	3 061	88 451	88 672
Alfa Laval AB	3 545	152 374	187 110
Assa Abloy AB, série B	12 104	421 757	459 749
Atlas Copco AB, série A	31 490	587 294	715 060
Atlas Copco AB, série B	18 778	305 429	367 067
Avanza Bank Holding AB	1 463	55 176	44 697
Axfood AB	1 244	40 981	44 435
Beijer Ref AB	4 782	102 723	84 405
Boliden AB	3 407	167 608	140 197
Castellum AB	5 177	125 397	97 067
Electrolux AB, série B	2 137	63 913	30 226
Elektro AB, cat. B	4 559	59 825	49 104
Embracer Group AB	9 257	122 682	33 132
Epiroc AB	7 797	211 984	206 278
Epiroc AB	4 807	112 728	110 948
EQT AB	5 611	224 456	209 233
Essity AB, cat. B	7 579	287 654	247 912
Evolution AB	2 232	378 459	351 088
Fabege AB	3 195	58 885	45 232
Fastighets AB Balder, cat. B	8 470	100 648	79 260
Getinge AB, série B	2 784	111 749	81 704
H & M Hennes & Mauritz AB, série B	7 736	190 227	178 773
Hexagon AB	24 175	413 193	382 576
Holmen AB, série B	1 053	63 627	58 651
Husqvarna AB, cat. B	4 196	71 284	45 557
Industrivarden AB, cat. C	1 660	60 190	71 306
Industrivarden AB, cat. A	1 795	61 610	77 246
Indutrade AB	3 386	109 648	115 985
Investment AB Latour, cat. B	1 608	65 954	55 186
Investor AB	22 565	609 476	689 394
Investor AB	5 942	166 334	179 982
Kinnevik AB, série B	2 694	135 895	38 104
L E Lundbergforetagen AB, cat. B	577	36 347	41 387
Lifco AB, cat. B	2 870	86 371	92 827
Nibe Industrier AB	18 547	235 706	171 811
Saab AB, série B	992	45 433	78 863
Sagax AB, série B	2 591	91 412	94 041
Sandvik AB	12 830	384 614	366 123
Securitas AB, série B	6 104	82 249	78 732
Skandinaviska Enskilda Banken AB	19 795	314 383	359 493
Skanska AB, série B	3 957	121 154	94 410
SKF AB, série B	4 375	132 000	115 230
SSAB AB, cat. A	2 683	17 834	26 918
SSAB AB, cat. B	8 118	66 106	81 872
Svenska Cellulosa AB SCA, série B	7 438	155 201	147 050

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Suède – 3,5 % (suite)			
Svenska Handelsbanken AB, série A	18 332	247 185	262 525
Svenska Handelsbanken AB, série B	407	6 152	6 933
Sweco AB, cat. B	2 079	43 813	36 750
Swedbank AB	12 446	293 181	331 064
Swedish Orphan Biovitrum AB	2 957	85 716	103 302
Tele2 AB, série B	7 117	111 924	80 586
Telefonaktiebolaget LM Ericsson, série B	36 391	476 907	300 495
Telia Co. AB	27 846	120 357	93 745
Thule Group AB	1 387	89 940	49 815
Trelleborg AB, série B	2 653	81 015	117 189
Volvo AB, série B	18 577	529 867	636 099
Volvo AB, série A	2 344	62 841	81 887
Volvo Car AB, série B	5 235	52 026	22 302
	9 760 210		9 503 700
Suisse – 9,1 %			
ABB Ltd.	20 081	869 282	1 173 480
Alcon, Inc.	6 118	582 152	629 158
Cie Financière Richemont SA	6 258	975 355	1 134 849
DSM-Firmenich AG	3 276	629 080	439 005
Geberit AG	412	349 893	347 910
Givaudan SA	115	605 731	627 708
Glencore PLC	115 610	679 578	917 454
Holcim AG	6 376	440 862	659 486
Kuehne & Nagel International AG	640	244 060	290 576
Lonza Group AG	924	784 415	512 022
Nestlé SA	33 120	5 168 516	5 059 656
Novartis AG	24 832	2 793 480	3 301 775
Partners Group Holding AG	268	463 019	509 304
Roche Holding AG	8 725	3 932 684	3 342 149
Roche Holding AG	362	173 550	148 250
Schindler Holding AG, priv.	512	173 207	168 691
Schindler Holding AG	239	65 161	74 700
SGS SA	1 862	267 114	211 611
Sika AG	1 812	721 610	776 988
Straumann Holding AG	1 333	320 318	283 186
Swatch Group AG, série B	351	120 288	125 709
Swatch Group AG	695	46 667	47 964
Swiss Re AG	3 597	425 496	532 880
Swisscom AG	308	224 316	244 165
UBS Group AG	38 894	908 344	1 590 394
Zurich Insurance Group AG	1 801	992 370	1 240 375
	22 956 548		24 389 445
Royaume-Uni – 12,5 %			
3i Group PLC	11 752	273 485	478 257
Admiral Group PLC	2 434	111 447	109 814
Allfunds Group PLC	3 918	87 971	36 667
Anglo American PLC	14 395	697 343	476 832
Antofagasta PLC	3 861	99 881	109 002
Ashtead Group PLC	5 451	455 652	500 476
Associated British Foods PLC	4 352	152 895	173 158
AstraZeneca PLC	18 608	2 852 699	3 315 588
Auto Trader Group PLC	11 516	125 722	139 647
Aviva PLC	34 269	292 324	250 407
BAE Systems PLC	37 926	407 978	707 963
Barclays PLC	189 455	536 380	489 735
Barratt Developments PLC	11 328	128 390	107 129
Berkeley Group Holdings PLC	1 331	97 963	104 887
BP PLC	193 779	1 125 331	1 518 404
British American Tobacco PLC	25 474	1 202 276	982 945
BT Group PLC	77 952	201 849	161 957
Bunzl PLC	4 212	194 792	225 857
Burberry Group PLC	4 401	141 611	104 754
Centrica PLC	70 352	191 298	166 330
Coca-Cola Europacific Partners PLC	2 500	187 347	220 008
Compass Group PLC	21 551	590 183	777 414
ConvaTec Group PLC	20 247	74 166	83 112
Croda International PLC	1 758	225 485	149 233
Diageo PLC	27 886	1 601 695	1 338 750
DS Smith PLC	15 354	88 957	79 312

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Royaume-Uni – 12,5 % (suite)			
Entain PLC	8 067	210 091	134 816
Evraz plc	5 249	26 801	–
Experian PLC	11 437	579 029	615 586
Fresnillo PLC	1 963	31 005	19 613
GSK PLC	50 828	1 531 121	1 239 042
Haleon PLC	63 491	331 160	343 282
Halma PLC	4 751	204 034	182 405
Hargreaves Lansdown PLC	3 820	95 756	47 132
HSBC Holdings PLC	246 105	1 941 303	2 629 002
Imperial Brands PLC	10 789	290 134	327 623
Informa PLC	17 551	169 023	230 472
InterContinental Hotels Group PLC	2 007	175 211	239 193
Intermediate Capital Group PLC	3 675	123 129	103 813
Intertek Group PLC	2 032	175 999	145 030
J Sainsbury PLC	22 297	100 716	113 415
JD Sports Fashion PLC	31 859	101 893	88 872
Kingfisher PLC	22 716	125 660	92 903
Land Securities Group PLC	8 924	102 760	105 726
Legal & General Group PLC	74 203	331 070	313 201
Lloyds Banking Group PLC	800 153	596 880	641 708
London Stock Exchange Group PLC	4 475	594 473	697 614
M&G PLC	28 717	98 534	107 357
Melrose Industries PLC	16 519	146 317	157 554
Mondi PLC	6 022	176 160	155 636
National Grid PLC	46 593	778 756	828 631
NatWest Group PLC	68 600	258 745	252 997
Next PLC	1 461	183 333	199 367
Ocado Group PLC	7 519	210 171	95 855
Pearson PLC	9 029	110 930	146 340
Persimmon PLC	4 073	178 453	95 098
Phoenix Group Holdings PLC	8 704	95 105	78 305
Polestar Automotive Holding U.K. PLC, CAAE	2 900	16 805	8 642
Prudential PLC	34 281	724 959	511 246
Reckitt Benckiser Group PLC	8 891	936 845	810 037
RELX PLC	23 447	871 951	1 225 752
Rentokil Initial PLC	30 311	271 217	224 593
Rightmove PLC	9 385	107 082	90 805
Rio Tinto PLC	13 266	1 214 206	1 302 736
Rolls-Royce Holdings PLC	104 833	221 198	528 129
Sage Group PLC	12 775	165 320	251 784
Schroders PLC	10 921	95 402	78 920
Segro PLC	14 645	265 076	218 210
Severn Trent PLC	3 329	151 096	144 318
Smith & Nephew PLC	10 972	242 560	198 912
Smiths Group PLC	4 447	114 651	131 825
Spirax-Sarco Engineering PLC	926	202 713	163 517
SSE PLC	13 589	347 200	423 956
St. James's Place PLC	6 506	155 070	74 760
Standard Chartered PLC	29 377	248 275	329 176
Taylor Wimpey PLC	44 819	119 592	110 785
Tesco PLC	88 965	408 811	434 430
Unilever PLC	30 930	2 133 118	1 975 689
United Utilities Group PLC	8 596	149 757	153 092
Vodafone Group PLC	304 202	594 448	350 581
Weir Group PLC	3 005	90 342	95 292
Whitbread PLC	2 450	124 980	150 566
Wise PLC, cat. A	7 451	95 053	109 466
WPP PLC	13 509	215 785	170 991
	32 502 384		33 503 436
TOTAL DES ACTIONS		253 527 627	267 461 398
COÛTS DE TRANSACTIONS		(306 052)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS		253 221 575	267 461 398
GAIN (PERTE) LATENT SUR LES INSTRUMENTS			
DÉRIVÉS – 0,0 %			10 727
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,4 %			1 218 349
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS			
DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			268 690 474

Gain latent sur les contrats à terme normalisés

Contrats à terme normalisés

iShares MSCI EAFE Index ETF	2	2 970,02	USD	15 mars 2024	294 513	297 001	10 727
					294 513	297 001	10 727

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice général d'actions qui suit les rendements de titres cotés en bourse émis par des sociétés à grande et à moyenne capitalisation dans des marchés développés à l'extérieur de l'Amérique du Nord.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Euro	82 459 955	—	82 459 955	30,7
Yen japonais	65 798 574	—	65 798 574	24,5
Livre sterling	38 264 400	—	38 264 400	14,2
Franc suisse	23 314 459	—	23 314 459	8,7
Dollar australien	21 334 313	—	21 334 313	7,9
Couronne suédoise	9 549 793	—	9 549 793	3,6
Couronne danoise	8 566 846	—	8 566 846	3,2
Dollar de Hong Kong	6 001 499	—	6 001 499	2,2
Dollar américain	4 169 105	—	4 169 105	1,6
Dollar de Singapour	3 542 092	—	3 542 092	1,3
Couronne norvégienne	2 249 691	—	2 249 691	0,8
Shekel israélien	1 667 874	—	1 667 874	0,6
Zloty polonais	1 015 420	—	1 015 420	0,4
Dollar néo-zélandais	794 909	—	794 909	0,3
	268 728 930	—	268 728 930	100,0

31 décembre 2022

Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Euro	66 840 930	—	66 840 930	29,7
Yen japonais	52 552 326	—	52 552 326	23,4
Livre sterling	34 208 014	—	34 208 014	15,2
Franc suisse	20 087 595	—	20 087 595	8,9
Dollar australien	18 581 117	—	18 581 117	8,3
Couronne suédoise	7 322 183	—	7 322 183	3,3
Dollar de Hong Kong	7 039 486	—	7 039 486	3,1
Couronne danoise	6 329 585	—	6 329 585	2,8
Dollar de Singapour	3 311 148	—	3 311 148	1,5
Dollar américain	3 187 453	—	3 187 453	1,4
Couronne norvégienne	2 138 848	—	2 138 848	1,0
Shekel israélien	1 640 208	—	1 640 208	0,7
Dollar néo-zélandais	806 066	—	806 066	0,4
Zloty polonais	630 548	—	630 548	0,3
	224 675 507	—	224 675 507	100,0

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 26 873 000 \$ ou environ 10,0 % (22 468 000 \$ ou environ 10,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,5 % (99,7 % au 31 décembre 2022) de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 26 746 000 \$ (22 407 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débentures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

FNB indiciel d'actions internationales Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,6	99,7
Australie	7,8	8,2
Autriche	0,3	0,3
Belgique	0,8	0,9
Îles Caïmans	0,0	0,0
Bermudes	0,1	—
Chine	0,1	0,1
Danemark	3,2	2,8
Finlande	1,1	1,3
France	9,6	9,8
Allemagne	7,8	7,4
Hong Kong	2,2	3,1
Irlande	0,9	0,9
Israël	0,9	0,9
Italie	2,1	1,9
Japon	24,5	23,4
Jordanie	0,0	0,0
Luxembourg	0,2	0,2
Pays-Bas	7,3	6,7
Nouvelle-Zélande	0,3	0,4
Norvège	0,8	0,9
Pologne	0,4	0,3
Portugal	0,2	0,2
Singapour	1,4	1,6
Espagne	2,5	2,4
Suède	3,5	3,2
Suisse	9,1	9,3
Royaume-Uni	12,5	13,5
GAIN (PERTE) LATENT SUR LES INSTRUMENTS DÉRIVÉS	0,0	—
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,8	0,8

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	267 461 398	—	—	267 461 398
Gain latent sur les contrats à terme normalisés	10 727	—	—	10 727
	267 472 125	—	—	267 472 125

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2022				
Actions	224 063 750	2 987	—	224 066 737
	224 063 750	2 987	—	224 066 737

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	31 372 028	22 206 792
Trésorerie	72 050	44 349
Montant à recevoir pour la vente de titres	86 290	–
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	162 478	106 177
Total de l'actif	31 692 846	22 357 318
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	2 995	2 121
Montant à payer pour l'achat de titres	151 212	–
Charges à payer	1 014	742
Total du passif	155 221	2 863
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	31 537 625	22 354 455
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	18,55	17,88

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Intérêts à distribuer	810 129	504 402
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(9 132)	(2 241 094)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	958 514	(141 639)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	1 759 511	(1 878 331)
Revenu tiré du prêt de titres	3 865	869
Total des revenus (pertes), montant net	1 763 376	(1 877 462)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	27 644	19 866
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	8 293	5 952
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 075
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	4 661	2 820
Total des charges	41 736	29 713
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	1 721 640	(1 907 175)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	1,12	(1,73)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	1 538 219	1 101 811

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	22 354 455	–
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	1 721 640	(1 907 175)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Remboursement de capital	(659 550)	(404 700)
	(659 550)	(404 700)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	8 121 080	31 091 925
Paiement au rachat	–	(6 425 595)
	8 121 080	24 666 330
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	9 183 170	22 354 455
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	31 537 625	22 354 455

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	1 721 640	(1 907 175)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	9 132	2 241 094
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(958 514)	141 639
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(6 063 724)	(4 709 743)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(2 087 208)	4 572 922
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(56 301)	(106 177)
Charges à payer et autres montants à payer	1 146	2 863
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	(7 433 829)	235 423
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	130 482	288 228
Montant payé au rachat de parts rachetables*	7 990 598	(74 602)
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(659 550)	(404 700)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	7 461 530	(191 074)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	27 701	44 349
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	44 349	–
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	72 050	44 349
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	753 826	398 226

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)	Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 %				OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 25,9 %				Obligations de sociétés – 25,9 % (suite)			
Banque de Montréal, 4,61 %, 10 sept. 2025	15 000	15 223	15 014	Ville de Montréal, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2026	10 000	9 659	9 722
Banque de Montréal, 2,70 %, 9 déc. 2026	20 000	18 792	19 202	Ville de Montréal, 4,70 %, 1 ^{er} déc. 2041	20 000	19 988	21 054
Banque de Montréal, 3,19 %, 1 ^{er} mars 2028	120 000	112 259	115 825	Ville de Montréal, 4,40 %, 1 ^{er} déc. 2043	15 000	14 521	15 228
Banque de Montréal, 2,37 %, 3 févr. 2025	40 000	37 993	38 843	Ville d'Ottawa, 4,20 %, 30 juill. 2053	5 000	4 853	5 006
Banque de Montréal, 2,08 %, 17 juin 2030	55 000	50 727	52 646	Ville d'Ottawa, 3,10 %, 27 juill. 2048	10 000	7 950	8 224
Banque de Montréal, 1,76 %, 10 mars 2026	60 000	54 556	56 833	Ville d'Ottawa, 2,50 %, 11 mai 2051	10 000	6 919	7 257
Banque de Montréal, 1,55 %, 28 mai 2026	65 000	57 062	60 952	Ville de Toronto, 2,40 %, 7 juin 2027	10 000	9 466	9 590
Banque de Montréal, 1,93 %, 22 juill. 2031	30 000	26 597	27 877	Ville de Toronto, 3,25 %, 24 juin 2046	20 000	16 399	16 991
Banque de Montréal, 3,65 %, 1 ^{er} avr. 2027	90 000	85 817	87 787	Ville de Toronto, 3,50 %, 2 juin 2036	15 000	13 649	14 169
Banque de Montréal, 4,31 %, 1 ^{er} juin 2027	92 000	90 152	91 538	Ville de Toronto, 5,20 %, 1 ^{er} juin 2040	15 000	16 337	16 726
Banque de Montréal, 4,71 %, 7 déc. 2027	100 000	100 354	100 868	Ville de Toronto, 2,40 %, 24 juin 2026	10 000	9 491	9 649
Banque de Montréal, 5,04 %, 29 mai 2028	94 000	93 684	96 138	Ville de Toronto, 2,65 %, 9 nov. 2029	8 000	7 354	7 610
Banque de Montréal, 6,03 %, 7 sept. 2033	30 000	29 246	31 297	Ville de Toronto, 2,45 %, 6 févr. 2025	10 000	9 736	9 802
Banque de Montréal, 4,54 %, 18 déc. 2028	49 000	49 000	49 285	Ville de Toronto, 2,60 %, 24 sept. 2039	10 000	7 628	8 187
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,62 %, 2 déc. 2026	30 000	28 108	28 575	Ville de Toronto, 2,80 %, 22 nov. 2049	15 000	11 127	11 560
La Banque de Nouvelle-Écosse, 3,10 %, 2 févr. 2028	65 000	60 770	62 557	Ville de Toronto, 2,15 %, 25 août 2040	10 000	7 137	7 541
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,84 %, 3 juill. 2029	40 000	38 506	39 433	Ville de Toronto, 2,90 %, 29 avr. 2051	5 000	3 778	3 945
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,16 %, 3 févr. 2025	53 000	50 054	51 345	Ville de Toronto, 4,30 %, 1 ^{er} juin 2052	10 000	9 685	10 124
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,40 %, 1 ^{er} nov. 2027	80 000	68 009	72 051	Ville de Vancouver, 3,70 %, 18 oct. 2052	5 000	4 452	4 583
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,85 %, 2 nov. 2026	100 000	89 194	93 302	Cogeco Communications, Inc., 5,30 %, 16 févr. 2033	20 000	19 294	20 323
La Banque de Nouvelle-Écosse, 1,95 %, 10 janv. 2025	90 000	84 696	87 196	CT Real Estate Investment Trust, 3,53 %, 9 juin 2025, série B	10 000	9 670	9 756
La Banque de Nouvelle-Écosse, 2,95 %, 8 mars 2027	145 000	134 779	138 510	CT Real Estate Investment Trust, 3,86 %, 7 déc. 2027, série F	10 000	9 442	9 605
La Banque de Nouvelle-Écosse, 3,93 %, 3 mai 2032	65 000	61 680	62 804	Dollarama, Inc., 1,87 %, 8 juill. 2026	20 000	17 770	18 840
La Banque de Nouvelle-Écosse, 5,50 %, 8 mai 2026	70 000	70 812	71 480	Dollarama, Inc., 5,16 %, 26 avr. 2030	30 000	29 530	31 172
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 3,30 %, 26 mai 2025	45 000	44 048	44 203	Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 1,66 %, 22 déc. 2025, série A	15 000	13 513	14 125
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,95 %, 19 juin 2029	50 000	48 307	49 368	Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 2,06 %, 17 juin 2027, série C	30 000	26 194	27 309
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,00 %, 17 avr. 2025	50 000	46 736	48 187	Dream Industrial Real Estate Investment Trust, 2,54 %, 7 déc. 2026, série D	8 000	7 169	7 492
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,01 %, 21 juill. 2030	35 000	32 209	33 342	Dream Summit Industrial LP, 2,15 %, 17 sept. 2025	15 000	13 814	14 312
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,10 %, 19 janv. 2026	95 000	85 693	88 791	Dream Summit Industrial LP, 2,44 %, 14 juill. 2028	10 000	8 645	8 995
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,96 %, 21 avr. 2031	50 000	44 615	46 703	Enbridge Gas Inc., 4,55 %, 17 août 2052	5 000	4 987	4 988
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 1,70 %, 15 juill. 2026	50 000	44 256	46 921	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,95 %, 3 mars 2025	10 000	9 998	10 005
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25 %, 7 janv. 2027	80 000	72 221	75 198	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,70 %, 16 déc. 2026	20 000	19 618	20 016
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,75 %, 7 mars 2025	69 000	65 965	67 245	Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6 déc. 2027	10 000	9 492	9 872
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,20 %, 7 avr. 2032	40 000	38 368	39 009	Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,95 %, 3 mars 2031	32 000	28 083	30 144
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 4,95 %, 29 juin 2027	89 000	89 449	90 268	Great-West Lifeco, Inc., 6,67 %, 21 mars 2033	10 000	11 213	11 530
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,05 %, 7 oct. 2027	67 000	66 687	68 193	Great-West Lifeco, Inc., 6,00 %, 16 nov. 2039	4 000	4 281	4 590
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,33 %, 20 janv. 2033	34 000	34 019	34 337	Great-West Lifeco, Inc., 3,34 %, 28 févr. 2028	10 000	9 378	9 669
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 5,50 %, 14 janv. 2028	50 000	50 230	51 772	Great-West Lifeco, Inc., 2,38 %, 14 mai 2030	35 000	29 667	31 523
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 2,80 %, 22 sept. 2025	10 000	9 630	9 708	Great-West Lifeco Inc., 2,98 %, 8 juill. 2050	20 000	13 845	15 533
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,95 %, 22 sept. 2045	15 000	13 127	13 820	Hydro One Ltd., 1,41 %, 15 oct. 2027	15 000	13 035	13 685
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 1 ^{er} août 2047	15 000	12 281	13 009	iA Société financière inc., 3,07 %, 24 sept. 2031	15 000	13 978	14 278
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 31 juill. 2048	20 000	16 332	17 304	iA Société financière inc., 2,40 %, 21 févr. 2030	10 000	9 421	9 674
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,20 %, 31 juill. 2028	10 000	9 398	9 663	iA Société financière inc., 3,19 %, 25 févr. 2032	8 000	7 427	7 603
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,00 %, 8 févr. 2029	15 000	13 796	14 295	Société financière IGM Inc., 3,44 %, 26 janv. 2027	25 000	23 810	24 101
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,60 %, 8 févr. 2049	10 000	7 966	8 651	Société financière IGM Inc., 4,56 %, 25 janv. 2047	5 000	4 526	4 804
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 3,05 %, 8 févr. 2050	25 000	18 231	19 476	Société financière IGM Inc., 4,21 %, 21 mars 2050	20 000	17 072	18 185
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 4,40 %, 10 mai 2033	10 000	9 708	10 118	Intact Corporation financière, 6,40 %, 23 nov. 2039	10 000	11 374	11 901
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, 4,70 %, 10 mai 2053	48 000	48 225	49 533	Intact Corporation financière, 2,85 %, 7 juin 2027	20 000	18 700	19 096
Banque canadienne de l'Ouest, 3,67 %, 11 juin 2029	10 000	9 718	9 900	Intact Corporation financière, 3,69 %, 24 mars 2025	8 000	7 895	7 888
Banque canadienne de l'Ouest, 2,60 %, 6 sept. 2024	13 000	12 466	12 764	Intact Corporation financière, 2,95 %, 16 déc. 2050	25 000	17 080	19 212
Banque canadienne de l'Ouest, 2,61 %, 30 janv. 2025	10 000	9 502	9 711	Intact Corporation financière, 2,18 %, 18 mai 2028	10 000	8 753	9 189
Banque canadienne de l'Ouest, 1,82 %, 16 déc. 2027	40 000	34 137	36 047	Banque Laurentienne du Canada, 1,60 %, 6 mai 2026	10 000	9 129	9 397
CCL Industries, Inc., 3,86 %, 13 avr. 2028, série 1	15 000	14 027	14 493	Banque Laurentienne du Canada, 4,60 %, 2 sept. 2025	30 000	29 475	29 663
CGI, Inc., 2,10 %, 18 sept. 2028	10 000	8 565	9 081	Les Compagnies Loblaw limitée, 3,92 %, 10 juin 2024	45 000	44 545	44 735
CI Financial Corp., 7,00 %, 2 déc. 2025	35 000	35 000	35 730	Les Compagnies Loblaw limitée, 4,49 %, 11 déc. 2028	30 000	29 576	30 357
Ville de Montréal, 3,00 %, 1 ^{er} sept. 2027	30 000	28 793	29 274	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,01 %, 13 sept. 2032	20 000	20 022	20 749
Ville de Montréal, 3,00 %, 1 ^{er} sept. 2025	10 000	9 826	9 809	Les Compagnies Loblaw limitée, 5,33 %, 13 sept. 2052	8 000	8 000	8 702
Ville de Montréal, 3,50 %, 1 ^{er} sept. 2024	10 000	9 991	9 910	Société Financière Manuvie, 2,82 %, 13 mai 2035	40 000	34 792	35 592
Ville de Montréal, 4,10 %, 1 ^{er} déc. 2034	10 000	9 804	10 060	Société Financière Manuvie, 5,41 %, 10 mars 2033	50 000	50 765	51 058
Ville de Montréal, 2,30 %, 1 ^{er} sept. 2029	10 000	8 998	9 299	Metro inc., 5,03 %, 1 ^{er} déc. 2044, série D	15 000	14 588	15 413
Ville de Montréal, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2038	15 000	13 333	13 829	Metro inc., 3,39 %, 6 déc. 2027, série G	25 000	23 725	24 333
Ville de Montréal, 3,15 %, 1 ^{er} sept. 2028	20 000	19 153	19 552	Metro inc., 5,97 %, 15 oct. 2035, série B	25 000	26 406	27 656
				Metro inc., 3,41 %, 28 févr. 2050, série I	25 000	17 992	19 987
				Metro inc., 1,92 %, 2 déc. 2024, série J	15 000	14 341	14 584
				Banque Nationale du Canada, 2,54 %, 12 juill. 2024	40 000	38 074	39 437
				Banque Nationale du Canada, 2,58 %, 3 févr. 2025	50 000	47 513	48 650
				Banque Nationale du Canada, 1,53 %, 15 juin 2026	30 000	27 326	28 039
				Banque Nationale du Canada, 2,24 %, 4 nov. 2026	40 000	36 248	37 684
				Banque Nationale du Canada, 5,42 %, 16 août 2032	24 000	23 493	24 273
				Banque Nationale du Canada, 5,30 %, 3 nov. 2025	55 000	55 097	55 525
				Banque Nationale du Canada, 5,22 %, 14 juin 2028	50 000	49 954	51 493
				OMERS Finance Trust, 1,55 %, 21 avr. 2027	20 000	18 116	18 621
				Power Corporation du Canada, 4,45 %, 27 juill. 2048	5 000	4 483	4 824
				Power Corporation du Canada, 4,81 %, 31 janv. 2047	10 000	9 493	10 109
				Municipalité régionale de Peel, 2,50 %, 16 juin 2051	10 000	6 900	7 237
				Municipalité régionale de York, 3,65 %, 13 mai 2033	10 000	9 556	9 849

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 25,9 % (suite)			
Municipalité régionale de York, 4,05 %, 1 ^{er} mai, 2034	10 000	9 822	10 130
Municipalité régionale de York, 1,70 %, 27 mai 2030	15 000	12 771	13 366
Municipalité régionale de York, 2,50 %, 2 juin 2026	10 000	9 645	9 679
Rogers Communications Inc., 6,11 %, 25 août 2040	50 000	49 898	53 880
Rogers Communications Inc., 4,00 %, 13 mars 2024	20 000	19 783	19 940
Rogers Communications Inc., 3,25 %, 1 ^{er} mai 2029	40 000	35 848	37 542
Rogers Communications Inc., 3,65 %, 31 mars 2027	65 000	60 835	63 353
Rogers Communications Inc., 3,75 %, 15 avr. 2029	31 000	28 905	29 829
Rogers Communications Inc., 3,10 %, 15 avr. 2025	39 000	37 483	38 101
Rogers Communications Inc., 4,25 %, 15 avr. 2032	36 000	33 441	34 651
Rogers Communications Inc., 5,25 %, 15 avr. 2052	35 000	32 477	34 809
Rogers Communications Inc., 6,75 %, 9 nov. 2039	55 000	59 505	62 754
Rogers Communications Inc., 4,35 %, 31 janv. 2024	15 000	14 956	14 983
Rogers Communications Inc., 3,80 %, 1 ^{er} mars 2027	15 000	14 337	14 699
Rogers Communications Inc., 4,40 %, 2 nov. 2028	20 000	19 292	19 920
Rogers Communications Inc., 3,30 %, 10 déc. 2029	15 000	13 066	13 999
Rogers Communications Inc., 4,25 %, 9 déc. 2049	15 000	12 095	12 881
Rogers Communications Inc., 2,90 %, 9 déc. 2030	20 000	16 776	17 921
Rogers Communications Inc., 5,70 %, 21 sept. 2028	40 000	39 258	41 971
Rogers Communications Inc., 5,80 %, 21 sept. 2030	40 000	40 934	42 484
Rogers Communications Inc., 5,90 %, 21 sept. 2033	40 000	38 299	43 066
Banque Royale du Canada, 4,93 %, 16 juill. 2025	12 000	12 285	12 069
Banque Royale du Canada, 2,61 %, 1 ^{er} nov. 2024	80 000	77 000	78 356
Banque Royale du Canada, 2,88 %, 23 déc. 2029	60 000	57 581	58 498
Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28 janv. 2027	140 000	126 350	131 956
Banque Royale du Canada, 1,94 %, 1 ^{er} mai 2025	40 000	37 366	38 553
Banque Royale du Canada, 2,09 %, 30 juin 2030	45 000	41 678	43 114
Banque Royale du Canada, 1,67 %, 28 janv. 2033	30 000	24 925	26 728
Banque Royale du Canada, 1,59 %, 4 mai 2026	45 000	40 884	42 328
Banque Royale du Canada, 1,83 %, 31 juill. 2028	45 000	36 620	40 613
Banque Royale du Canada, 2,14 %, 3 nov. 2031	57 000	50 601	52 884
Banque Royale du Canada, 2,94 %, 3 mai 2032	27 000	24 490	25 361
Banque Royale du Canada, 3,37 %, 29 sept. 2025	107 000	103 298	104 666
Banque Royale du Canada, 4,61 %, 26 juill. 2027	79 000	78 505	79 498
Banque Royale du Canada, 5,23 %, 2 nov. 2026	101 000	100 351	103 122
Banque Royale du Canada, 5,01 %, 1 ^{er} févr. 2033	55 000	54 530	55 141
Banque Royale du Canada, 4,64 %, 17 janv. 2028	109 000	106 496	109 882
Banque Royale du Canada, 4,63 %, 1 ^{er} mai 2028	92 000	91 425	92 784
Banque Royale du Canada, 5,23 %, 24 juin 2030	60 000	60 281	62 588
Banque Royale du Canada, 5,34 %, 23 juin 2026	50 000	50 012	50 986
Banque Royale du Canada, 4,26 %, 21 déc. 2026	67 000	67 000	67 277
Saputo Inc., 3,60 %, 14 août 2025	15 000	14 439	14 717
Saputo Inc., 2,88 %, 19 nov. 2024	20 000	19 254	19 596
Saputo Inc., 2,24 %, 16 juin 2027	40 000	35 975	37 223
Saputo Inc., 1,41 %, 19 juin 2026	25 000	22 132	23 262
Saputo Inc., 2,30 %, 22 juin 2028	7 000	6 038	6 405
Saputo Inc., 5,25 %, 29 nov. 2029	15 000	15 150	15 536
Financière Sun Life inc., 2,58 %, 10 mai 2032	40 000	34 955	37 396
Financière Sun Life inc., 2,06 %, 1 ^{er} oct. 2035	30 000	23 714	25 232
Financière Sun Life inc., 2,46 %, 18 nov. 2031, série 2021-1	15 000	13 621	14 101
Financière Sun Life inc., 2,80 %, 21 nov. 2033, série 2021-2	44 000	38 584	40 373
Financière Sun Life inc., 3,15 %, 18 nov. 2036, série 2021-3	15 000	12 660	13 291
Financière Sun Life inc., 4,78 %, 10 août 2034	30 000	29 150	30 013
TELUS Corp., 3,35 %, 1 ^{er} avr. 2024, série CK	50 000	49 093	49 750
TELUS Corp., 4,85 %, 5 avr. 2044	45 000	40 324	42 805
TELUS Corp., 3,75 %, 17 janv. 2025, série CQ	30 000	29 470	29 583
TELUS Corp., 4,75 %, 17 janv. 2045, série CR	15 000	13 597	14 104
TELUS Corp., 4,40 %, 29 janv. 2046, série CU	15 000	12 515	13 408
TELUS Corp., 3,75 %, 10 mars 2026, série CV	20 000	19 277	19 699
TELUS Corp., 3,62 %, 1 ^{er} mars 2028, série CX	35 000	33 156	34 034
TELUS Corp., 5,15 %, 26 nov. 2043, série CN	15 000	13 650	14 819
TELUS Corp., 3,30 %, 2 mai 2029, série CY	60 000	54 683	56 916
TELUS Corp., 2,75 %, 8 juill. 2026, série CZ	30 000	27 966	28 885
TELUS Corp., 3,15 %, 19 févr. 2030	15 000	13 252	13 898
TELUS Corp., 3,95 %, 16 févr. 2050, série CAB	45 000	34 239	37 035
TELUS Corp., 2,35 %, 27 janv. 2028, série CAC	17 000	14 999	15 752
TELUS Corp., 2,05 %, 7 oct. 2030	30 000	24 545	25 584
TELUS Corp., 4,10 %, 5 avr. 2051, série CAE	12 000	9 346	10 126
TELUS Corp., 2,85 %, 13 nov. 2031, série CAF	45 000	37 493	39 697
TELUS Corp., 5,25 %, 15 nov. 2032	74 000	74 073	76 524
TELUS Corp., 5,65 %, 13 sept. 2052	31 000	31 723	33 063
TELUS Corp., 5,75 %, 8 sept. 2033	50 000	47 945	53 492
Thomson Reuters Corp., 2,24 %, 14 mai 2025	50 000	47 099	48 340
Groupe TMX Ltée, 3,00 %, 11 déc. 2024, série D	10 000	9 695	9 810
Groupe TMX Ltée, 3,78 %, 5 juin 2028, série E	10 000	9 589	9 794
Groupe TMX Ltée, 2,02 %, 12 févr. 2031, série F	5 000	4 012	4 257
La Banque Toronto-Dominion, 4,86 %, 4 mars 2031	30 000	29 844	30 011
La Banque Toronto-Dominion, 3,22 %, 25 juill. 2029	30 000	29 076	29 582
La Banque Toronto-Dominion, 2,50 %, 2 déc. 2024	50 000	47 828	48 827
La Banque Toronto-Dominion, 3,06 %, 26 janv. 2032	50 000	45 863	47 461
La Banque Toronto-Dominion, 1,94 %, 13 mars 2025	40 000	37 507	38 668
La Banque Toronto-Dominion, 3,10 %, 22 avr. 2030	100 000	95 243	97 260
La Banque Toronto-Dominion, 1,13 %, 9 déc. 2025	50 000	44 715	46 959
La Banque Toronto-Dominion, 1,89 %, 8 mars 2028	40 000	33 347	36 452
La Banque Toronto-Dominion, 1,90 %, 11 sept. 2028	75 000	63 799	67 701

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations de sociétés – 25,9 % (suite)			
La Banque Toronto-Dominion, 2,26 %, 7 janv. 2027	130 000	117 711	122 335
La Banque Toronto-Dominion, 2,67 %, 9 sept. 2025	146 000	137 950	141 229
La Banque Toronto-Dominion, 4,21 %, 1 ^{er} juin 2027	113 000	110 930	112 209
La Banque Toronto-Dominion, 4,34 %, 27 janv. 2026	57 000	56 768	56 811
La Banque Toronto-Dominion, 5,37 %, 21 oct. 2027	70 000	70 744	72 217
La Banque Toronto-Dominion, 4,68 %, 8 janv. 2029	106 000	105 018	107 255
La Banque Toronto-Dominion, 4,48 %, 18 janv. 2028	70 000	68 702	70 072
La Banque Toronto-Dominion, 5,42 %, 10 juill. 2026	50 000	50 000	51 091
La Banque Toronto-Dominion, 5,49 %, 8 sept. 2028	51 000	51 000	53 355
	7 895 854	8 158 658	
Obligations fédérales – 43,8 %			
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2064	60 000	54 961	56 926
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2048	219 000	203 336	207 903
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2025	180 000	174 671	175 522
Obligations du gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} juin 2027	234 000	213 581	217 086
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} juin 2028	196 000	184 500	186 974
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} déc. 2051	739 000	577 747	595 242
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} juin 2029	179 000	170 494	171 810
Obligations du gouvernement du Canada, 8,00 %, 1 ^{er} juin 2027	20 000	24 425	23 022
Obligations du gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2029	150 000	173 143	169 749
Obligations du gouvernement du Canada, 5,75 %, 1 ^{er} juin 2033	190 000	231 910	230 698
Obligations du gouvernement du Canada, 5,00 %, 1 ^{er} juin 2037	155 000	186 243	186 657
Obligations du gouvernement du Canada, 4,00 %, 1 ^{er} juin 2041	190 000	209 131	212 865
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2045	250 000	261 448	266 982
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} juin 2026	250 000	234 561	238 242
Obligations du gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} juin 2030	690 000	597 799	616 584
Obligations du gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2025	204 000	193 889	197 021
Obligations du gouvernement du Canada, 0,50 %, 1 ^{er} sept. 2025	647 000	596 558	611 784
Obligations du gouvernement du Canada, 0,50 %, 1 ^{er} déc. 2030	635 000	506 504	533 425
Obligations du gouvernement du Canada, 0,25 %, 1 ^{er} mars 2026	445 000	399 933	414 113
Obligations du gouvernement du Canada, 1,00 %, 1 ^{er} sept. 2026	328 000	302 482	307 572
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} juin 2031	613 000	535 094	548 010
Obligations du gouvernement du Canada, 1,75 %, 1 ^{er} déc. 2053	553 000	388 211	415 574
Obligations du gouvernement du Canada, 1,25 %, 1 ^{er} mars 2027	257 000	234 852	240 683
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} déc. 2031	483 000	420 010	428 846
Obligations du gouvernement du Canada, 1,50 %, 1 ^{er} avr. 2025	90 000	85 668	86 972
Obligations du gouvernement du Canada, 2,00 %, 1 ^{er} juin 2032	352 000	315 902	323 396
Obligations du gouvernement du Canada, 2,25 %, 1 ^{er} déc. 2029	92 000	86 886	88 067
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2027	223 000	219 907	218 689
Obligations du gouvernement du Canada, 3,00 %, 1 ^{er} oct. 2025	170 000	166 984	167 357
Obligations du gouvernement du Canada, 2,50 %, 1 ^{er} déc. 2032	315 000	294 690	300 330
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} mars 2028	249 000	249 564	251 619
Obligations du gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} févr. 2025	205 000	203 749	203 493
Obligations du gouvernement du Canada, 3,00 %, 1 ^{er} avr. 2026	120 000	116 401	118 292
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} déc. 2055	120 000	106 452	113 166
Obligations du gouvernement du Canada, 2,75 %, 1 ^{er} juin 2033	284 000	272 841	276 031
Obligations du gouvernement du Canada, 3,75 %, 1 ^{er} mai 2025	220 000	220 551	218 713
Obligations du gouvernement du Canada, 3,25 %, 1 ^{er} sept. 2028	260 000	254 100	260 913
Obligations du gouvernement du Canada, 3,50 %, 1 ^{er} août 2025	300 000	293 543	297 447
Obligations du gouvernement du Canada, 3,25 %, 1 ^{er} déc. 2033	389 000	379 661	394 073

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations fédérales – 43,8 % (suite)			
Obligations du gouvernement du Canada, 4,50 %, 1 ^{er} nov. 2025	300 000	300 842	303 225
Obligations du gouvernement du Canada, 4,00 %, 1 ^{er} mars 2029	40 000	40 522	41 637
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,55 %, 15 mars 2025	60 000	58 792	58 750
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,95 %, 15 déc. 2025	190 000	180 337	182 888
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,25 %, 15 déc. 2025	70 000	66 003	67 770
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,90 %, 15 sept. 2026	100 000	94 662	95 446
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 juin 2027	169 000	160 395	162 521
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,35 %, 15 mars 2028	40 000	35 187	38 291
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,65 %, 15 mars 2028	45 000	43 133	43 620
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,65 %, 15 déc. 2028	105 000	100 961	101 450
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,10 %, 15 sept. 2029	90 000	81 750	84 002
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,80 %, 15 déc. 2024	150 000	144 425	146 138
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,75 %, 15 juin 2030	165 000	144 597	149 213
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 0,95 %, 15 juin 2025	180 000	168 665	171 898
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,10 %, 15 mars 2031	80 000	65 842	68 185
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,40 %, 15 mars 2031	75 000	62 766	65 348
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,25 %, 15 juin 2026	140 000	129 082	131 824
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,90 %, 15 mars 2031	45 000	39 101	40 632
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,60 %, 15 déc. 2031	70 000	58 837	61 037
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,10 %, 15 déc. 2026	70 000	63 836	65 010
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,15 %, 15 déc. 2031	80 000	70 509	72 792
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 1,55 %, 15 déc. 2026	50 000	46 206	47 056
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 2,45 %, 15 déc. 2031	33 000	29 940	30 710
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,55 %, 15 sept. 2032	164 000	163 173	164 966
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,80 %, 15 juin 2027	64 000	64 804	64 516
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,60 %, 15 déc. 2027	142 000	142 854	142 635
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,65 %, 15 juin 2033	110 000	108 349	111 357
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,10 %, 15 juin 2028	80 000	78 303	78 932
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 3,95 %, 15 juin 2028	57 000	56 982	58 222
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,15 %, 15 juin 2033	54 000	53 874	56 817
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,25 %, 15 déc. 2028	139 000	141 586	144 314
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, 4,25 %, 15 mars 2034	104 000	103 937	110 411
PSP Capital Inc., 3,00 %, 5 nov. 2025	23 000	22 653	22 550
PSP Capital Inc., 2,05 %, 15 janv. 2030	15 000	13 304	13 751
PSP Capital Inc., 0,90 %, 15 juin 2026	20 000	18 105	18 625
PSP Capital Inc., 1,50 %, 15 mars 2028	25 000	22 762	23 006
PSP Capital Inc., 2,60 %, 1 ^{er} mars 2032	9 000	8 055	8 290
	13 527 513	13 819 683	
Obligations provinciales – 29,8 %			
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,50 %, 19 avr. 2026, série EE	20 000	19 382	19 382
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,95 %, 14 oct. 2024, série EA	10 000	9 891	9 860
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,15 %, 3 juin 2024, série EN	15 000	14 652	14 826
Municipal Finance Authority of British Columbia, 4,95 %, 1 ^{er} déc. 2027, série DN	20 000	20 670	20 969
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,65 %, 2 oct. 2025, série EB	10 000	9 575	9 752
Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,10 %, 1 ^{er} juin 2025, série EO	10 000	9 328	9 565
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,30 %, 15 avr. 2031, série EP	10 000	8 788	9 125
Municipal Finance Authority of British Columbia, 1,35 %, 30 juin 2026	10 000	9 194	9 406
Municipal Finance Authority of British Columbia, 2,50 %, 27 sept. 2041, série ER	10 000	7 583	7 900

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 29,8 % (suite)			
Municipal Finance Authority of British Columbia, 3,35 %, 1 ^{er} juin 2027	10 000	9 918	9 900
Province d'Alberta, 4,50 %, 1 ^{er} déc. 2040	12 000	12 272	12 679
Province d'Alberta, 3,45 %, 1 ^{er} déc. 2043	60 000	51 276	54 823
Province d'Alberta, 2,35 %, 1 ^{er} juin 2025	50 000	48 313	48 698
Province d'Alberta, 3,30 %, 1 ^{er} déc. 2046	65 000	56 818	57 506
Province d'Alberta, 2,20 %, 1 ^{er} juin 2026	40 000	38 111	38 490
Province d'Alberta, 2,55 %, 1 ^{er} juin 2027	65 000	62 098	62 752
Province d'Alberta, 3,05 %, 1 ^{er} déc. 2048	102 000	82 640	85 819
Province d'Alberta, 2,90 %, 1 ^{er} déc. 2028	30 000	28 639	29 160
Province d'Alberta, 2,90 %, 20 sept. 2029	30 000	28 366	29 035
Province d'Alberta, 3,90 %, 1 ^{er} déc. 2033	39 000	37 871	39 278
Province d'Alberta, 3,50 %, 1 ^{er} juin 2031	40 000	38 617	39 617
Province d'Alberta, 3,10 %, 1 ^{er} juin 2050	123 000	102 420	104 524
Province d'Alberta, 2,05 %, 1 ^{er} juin 2030	115 000	102 133	105 061
Province d'Alberta, 1,65 %, 1 ^{er} juin 2031	43 000	35 857	37 466
Province d'Alberta, 2,95 %, 1 ^{er} juin 2052	62 000	49 884	51 197
Province d'Alberta, 4,15 %, 1 ^{er} juin 2033	12 000	12 058	12 354
Province de la Colombie-Britannique, 4,30 %, 18 juin 2042	50 000	50 093	51 758
Province de la Colombie-Britannique, 5,70 %, 18 juin 2029	40 000	44 667	44 322
Province de la Colombie-Britannique, 6,35 %, 18 juin 2031	10 000	11 887	11 755
Province de la Colombie-Britannique, 4,70 %, 18 juin 2037	20 000	21 239	21 594
Province de la Colombie-Britannique, 4,95 %, 18 juin 2040	40 000	43 272	44 717
Province de la Colombie-Britannique, 3,20 %, 18 juin 2044	58 000	49 839	51 291
Province de la Colombie-Britannique, 2,85 %, 18 juin 2025	70 000	68 333	68 624
Province de la Colombie-Britannique, 2,80 %, 18 juin 2048	65 000	51 327	52 781
Province de la Colombie-Britannique, 2,30 %, 18 juin 2026	25 000	23 794	24 112
Province de la Colombie-Britannique, 2,55 %, 18 juin 2027	30 000	28 690	28 970
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 déc. 2028	35 000	33 308	34 117
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18 juin 2050	100 000	80 486	83 167
Province de la Colombie-Britannique, 2,20 %, 18 juin 2030	65 000	57 996	59 907
Province de la Colombie-Britannique, 1,55 %, 18 juin 2031	80 000	66 240	69 166
Province de la Colombie-Britannique, 2,75 %, 18 juin 2052	86 000	64 397	68 752
Province de la Colombie-Britannique, 3,20 %, 18 juin 2032	50 000	48 075	48 177
Province de la Colombie-Britannique, 4,25 %, 18 déc. 2053	16 000	16 774	16 926
Province de la Colombie-Britannique, 3,55 %, 18 juin 2033	25 000	23 834	24 568
Province du Manitoba, 4,40 %, 5 sept. 2025	15 000	15 135	15 056
Province du Manitoba, 3,15 %, 5 sept. 2052	5 000	4 072	4 215
Province du Manitoba, 4,60 %, 5 mars 2038	20 000	19 872	21 144
Province du Manitoba, 4,65 %, 5 mars 2040	10 000	10 449	10 632
Province du Manitoba, 4,10 %, 5 mars 2041	18 000	17 584	17 853
Province du Manitoba, 4,05 %, 5 sept. 2045	30 000	28 422	29 436
Province du Manitoba, 3,30 %, 2 juin 2024	10 000	9 981	9 932
Province du Manitoba, 2,45 %, 2 juin 2025	45 000	43 715	43 885
Province du Manitoba, 2,85 %, 5 sept. 2046	25 000	19 713	20 175
Province du Manitoba, 2,55 %, 2 juin 2026	35 000	33 591	33 954
Province du Manitoba, 3,40 %, 5 sept. 2048	30 000	26 273	26 501
Province du Manitoba, 2,60 %, 2 juin 2027	35 000	33 397	33 835
Province du Manitoba, 3,00 %, 2 juin 2028	15 000	14 466	14 669
Province du Manitoba, 3,20 %, 5 mars 2050	35 000	27 051	29 838
Province du Manitoba, 2,75 %, 2 juin 2029	20 000	18 759	19 231
Province du Manitoba, 4,70 %, 5 mars 2050	5 000	5 394	5 460
Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2030	29 000	25 426	26 441
Province du Manitoba, 2,05 %, 5 sept. 2052	37 000	23 855	24 360
Province du Manitoba, 2,05 %, 2 juin 2031	25 000	21 481	22 375
Province du Manitoba, 3,80 %, 5 sept. 2053	28 000	26 202	26 636
Province du Manitoba, 3,90 %, 2 déc. 2032	55 000	54 175	55 499
Province du Nouveau-Brunswick, 4,65 %, 26 sept. 2035	10 000	10 666	10 645
Province du Nouveau-Brunswick, 4,55 %, 26 mars 2037	8 000	8 266	8 434
Province du Nouveau-Brunswick, 4,80 %, 26 sept. 2039	17 000	16 973	18 422
Province du Nouveau-Brunswick, 3,80 %, 14 août 2045	20 000	18 630	19 002
Province du Nouveau-Brunswick, 2,60 %, 14 août 2026	10 000	9 646	9 710
Province du Nouveau-Brunswick, 3,10 %, 14 août 2048	13 000	10 670	10 943
Province du Nouveau-Brunswick, 2,35 %, 14 août 2027	10 000	9 423	9 566

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 29,8 % (suite)			
Province du Nouveau-Brunswick, 4,80 %, 3 juin 2041	10 000	10 678	10 813
Province du Nouveau-Brunswick, 3,55 %, 3 juin 2043	15 000	13 319	13 806
Province du Nouveau-Brunswick, 3,65 %, 3 juin 2024	15 000	15 065	14 918
Province du Nouveau-Brunswick, 3,10 %, 14 août 2028	25 000	24 168	24 515
Province du Nouveau-Brunswick, 3,05 %, 14 août 2050	32 000	25 660	26 641
Province du Nouveau-Brunswick, 2,90 %, 14 août 2052	10 000	7 995	8 062
Province du Nouveau-Brunswick, 2,55 %, 14 août 2031	18 000	16 077	16 628
Province du Nouveau-Brunswick, 3,95 %, 14 août 2032	15 000	15 503	15 197
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 4,65 %, 17 oct. 2040	15 000	15 033	15 579
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,30 %, 2 juin 2025	19 000	18 214	18 475
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,30 %, 17 oct. 2046	17 000	14 080	14 336
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,00 %, 2 juin 2026	18 000	17 621	17 623
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2028	25 000	23 560	24 201
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,70 %, 17 oct. 2048	15 000	13 280	13 464
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,85 %, 2 juin 2029	15 000	14 073	14 427
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,65 %, 17 oct. 2050	27 000	19 366	19 839
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 1,75 %, 2 juin 2030	21 000	17 848	18 658
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 2,05 %, 2 juin 2031	30 000	25 516	26 612
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, 3,15 %, 2 déc. 2052	15 000	11 768	12 175
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,40 %, 1 ^{er} juin 2042	15 000	14 127	15 515
Province de la Nouvelle-Écosse, 5,80 %, 1 ^{er} juin 2033	10 000	11 492	11 568
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,50 %, 1 ^{er} juin 2037	10 000	10 463	10 505
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,10 %, 1 ^{er} juin 2027	25 000	23 399	23 779
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,50 %, 2 juin 2062	9 000	7 727	8 076
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,45 %, 1 ^{er} juin 2045	10 000	8 824	9 030
Province de la Nouvelle-Écosse, 3,15 %, 1 ^{er} déc. 2051	35 000	28 748	29 760
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,00 %, 1 ^{er} sept. 2030	30 000	26 156	27 170
Province de la Nouvelle-Écosse, 1,10 %, 1 ^{er} juin 2028	20 000	17 628	18 025
Province de la Nouvelle-Écosse, 2,40 %, 1 ^{er} déc. 2031	20 000	17 528	18 218
Province de la Nouvelle-Écosse, 4,05 %, 1 ^{er} juin 2029	11 000	11 018	11 278
Province d'Ontario, 4,65 %, 2 juin 2041	140 000	145 386	150 858
Province d'Ontario, 7,60 %, 2 juin 2027	10 000	11 801	11 259
Province d'Ontario, 6,50 %, 8 mars 2029	55 000	63 512	62 653
Province d'Ontario, 6,20 %, 2 juin 2031	15 000	17 579	17 474
Province d'Ontario, 5,85 %, 8 mars 2033	70 000	80 765	81 028
Province d'Ontario, 5,60 %, 2 juin 2035	98 000	112 657	113 542
Province d'Ontario, 4,70 %, 2 juin 2037	113 000	120 147	121 996
Province d'Ontario, 4,60 %, 2 juin 2039	110 000	113 400	117 956
Province d'Ontario, 3,50 %, 2 juin 2043	155 000	134 404	143 914
Province d'Ontario, 3,45 %, 2 juin 2045	165 000	148 386	151 331
Province d'Ontario, 2,60 %, 2 juin 2025	272 000	264 743	265 823
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 déc. 2046	210 000	166 652	174 901
Province d'Ontario, 2,40 %, 2 juin 2026	130 000	124 175	125 714
Province d'Ontario, 2,80 %, 2 juin 2048	150 000	117 875	121 941
Province d'Ontario, 2,60 %, 2 juin 2027	180 000	171 767	174 118
Province d'Ontario, 2,65 %, 5 févr. 2025	61 000	59 399	59 805
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 juin 2049	170 000	130 857	140 398
Province d'Ontario, 2,90 %, 2 juin 2028	160 000	153 029	155 979
Province d'Ontario, 2,70 %, 2 juin 2029	125 000	115 567	119 977
Province d'Ontario, 2,65 %, 2 déc. 2050	182 000	137 130	142 646
Province d'Ontario, 2,05 %, 2 juin 2030	165 000	143 795	150 759
Province d'Ontario, 1,75 %, 8 sept. 2025	105 000	99 557	101 016
Province d'Ontario, 1,85 %, 1 ^{er} févr., 2027	46 000	43 082	43 596
Province d'Ontario, 1,90 %, 2 déc. 2051	175 000	106 968	115 533
Province d'Ontario, 1,05 %, 8 sept. 2027	20 000	17 640	18 266
Province d'Ontario, 1,35 %, 2 déc. 2030	115 000	94 590	99 256
Province d'Ontario, 2,15 %, 2 juin 2031	130 000	112 555	117 486
Province d'Ontario, 1,35 %, 8 sept. 2026	20 000	18 332	18 796
Province d'Ontario, 1,55 %, 1 ^{er} nov. 2029	68 000	58 351	60 991
Province d'Ontario, 2,55 %, 2 déc. 2052	105 000	76 370	80 238
Province d'Ontario, 2,25 %, 2 déc. 2031	75 000	64 529	67 722
Province d'Ontario, 3,75 %, 2 juin 2032	150 000	148 501	150 450
Province d'Ontario, 3,75 %, 2 déc. 2053	166 000	157 348	161 125
Province d'Ontario, 3,60 %, 8 mars 2028	80 000	78 816	80 198
Province d'Ontario, 4,05 %, 2 févr. 2032	40 000	39 581	41 056
Province d'Ontario, 3,65 %, 2 juin 2033	150 000	143 377	148 752
Province d'Ontario, 4,15 %, 2 déc. 2054	90 000	88 166	93 775
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, 2,65 %, 1 ^{er} déc. 2051	8 000	5 816	6 058
Province de Québec, 8,50 %, 1 ^{er} avr. 2026	20 000	23 435	21 964

Émetteur	Valeur nominale (\$)	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES – 99,5 % (suite)			
Obligations provinciales – 29,8 % (suite)			
Province de Québec, 6,00 %, 1 ^{er} oct. 2029	20 000	22 774	22 559
Province de Québec, 6,25 %, 1 ^{er} juin 2032	45 000	53 203	53 110
Province de Québec, 5,75 %, 1 ^{er} déc. 2036	70 000	81 644	83 032
Province de Québec, 2,60 %, 6 juill. 2025	15 000	14 520	14 653
Province de Québec, 5,00 %, 1 ^{er} déc. 2038	75 000	82 260	83 830
Province de Québec, 5,00 %, 1 ^{er} déc. 2041	120 000	130 922	134 952
Province de Québec, 4,25 %, 1 ^{er} déc. 2043	92 000	92 581	94 729
Province de Québec, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2045	130 000	116 616	120 063
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2025	100 000	97 908	97 844
Province de Québec, 3,50 %, 1 ^{er} déc. 2048	182 000	160 400	167 871
Province de Québec, 2,50 %, 1 ^{er} sept. 2026	100 000	95 652	96 961
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2027	75 000	72 278	72 943
Province de Québec, 2,75 %, 1 ^{er} sept. 2028	80 000	76 370	77 462
Province de Québec, 3,10 %, 1 ^{er} déc. 2051	215 000	173 999	184 784
Province de Québec, 2,30 %, 1 ^{er} sept. 2029	100 000	91 048	93 853
Province de Québec, 1,90 %, 1 ^{er} sept. 2030	140 000	121 234	126 315
Province de Québec, 1,85 %, 13 févr. 2027	10 000	9 308	9 486
Province de Québec, 1,50 %, 1 ^{er} sept. 2031	115 000	94 285	98 748
Province de Québec, 2,85 %, 1 ^{er} déc. 2053	172 000	135 034	140 190
Province de Québec, 2,10 %, 27 mai 2031	10 000	8 712	9 042
Province de Québec, 3,25 %, 1 ^{er} sept. 2032	115 000	110 191	111 196
Province de Québec, 3,65 %, 20 mai 2032	27 000	27 242	26 991
Province de Québec, 4,40 %, 1 ^{er} déc. 2055	115 000	121 895	125 520
Province de Québec, 3,90 %, 22 nov. 2032	40 000	41 040	40 669
Province de Québec, 3,60 %, 1 ^{er} sept. 2033	110 000	104 650	108 633
Province de la Saskatchewan, 6,40 %, 5 sept. 2031	10 000	11 873	11 802
Province de la Saskatchewan, 5,80 %, 5 sept. 2033	10 000	11 526	11 587
Province de la Saskatchewan, 4,75 %, 1 ^{er} juin 2040	10 000	9 608	10 871
Province de la Saskatchewan, 3,40 %, 3 févr. 2042	10 000	9 025	9 144
Province de la Saskatchewan, 3,90 %, 2 juin 2045	15 000	14 358	14 625
Province de la Saskatchewan, 2,75 %, 2 déc. 2046	35 000	27 514	28 152
Province de la Saskatchewan, 2,55 %, 2 juin 2026	35 000	33 464	33 952
Province de la Saskatchewan, 3,30 %, 2 juin 2048	40 000	34 334	35 358
Province de la Saskatchewan, 2,65 %, 2 juin 2027	15 000	14 395	14 527
Province de la Saskatchewan, 3,05 %, 2 déc. 2028	25 000	23 972	24 460
Province de la Saskatchewan, 3,10 %, 2 juin 2050	42 000	34 798	35 774
Province de la Saskatchewan, 5,60 %, 5 sept. 2035	20 000	22 034	23 141
Province de la Saskatchewan, 2,20 %, 2 juin 2030	25 000	21 076	23 035
Province de la Saskatchewan, 0,80 %, 2 sept. 2025	20 000	18 427	18 946
Province de la Saskatchewan, 2,80 %, 2 déc. 2052	30 000	22 673	24 018
Province de la Saskatchewan, 2,15 %, 2 juin 2031	20 000	17 368	18 053
South Coast British Columbia Transportation Authority, 3,25 %, 23 nov. 2028	10 000	9 709	9 866
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS	30 555 153	9 131 786	9 393 687
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,5 %			165 597
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			31 537 625

FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice d'obligations responsables qui suit les rendements d'obligations de qualité supérieure libellées en dollars canadiens.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de taux d'intérêt selon le terme à courir du portefeuille du Fonds, déduction faite des positions vendeur, compte non tenu des fonds sous-jacents, des actions privilégiées, de la trésorerie et des découverts, selon le cas.

Exposition au risque de taux d'intérêt	31 décembre 2023 (\$)	31 décembre 2022 (\$)
Moins de un an	558 366	403 635
De 1 à 3 ans	7 613 413	5 827 408
De 3 à 5 ans	5 999 351	4 090 354
De 5 à 10 ans	9 712 815	6 624 864
Plus de 10 ans	7 488 083	5 260 531
	31 372 028	22 206 792

Au 31 décembre 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient fluctué de 0,25 %, en supposant un déplacement parallèle de la courbe des taux et toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 529 335 \$, ou environ 1,7 % (221 656 \$ ou environ 1,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de change

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait pas d'exposition directe importante au risque de change.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait pas d'exposition directe importante au risque de prix lié aux actions, aux fonds sous-jacents, aux instruments dérivés et aux produits de base.

Risque de crédit

Ci-dessous, un résumé des notations des obligations, des débentures, des instruments du marché monétaire et des actions privilégiées détenus par le Fonds, s'il y a lieu.

Notation	31 décembre 2023		31 décembre 2022	
	Pourcentage du total des instruments notés (%)	Pourcentage de l'actif net (%)	Pourcentage du total des instruments notés (%)	Pourcentage de l'actif net (%)
AAA/A-1+	44,8	44,7	39,6	39,3
AA	16,8	16,7	13,6	13,6
A/A-1	30,0	29,8	33,0	32,8
BBB/A-2	8,4	8,3	7,3	7,2
Pas de notation	—	—	6,5	6,5
	100,0	99,5	100,0	99,4

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
OBLIGATIONS ET DÉBENTURES	99,5	99,3
Obligations et débentures canadiennes		
Obligations de sociétés	25,9	44,3
Obligations fédérales	43,8	29,8
Obligations provinciales	29,8	25,2
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT		
TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,2	0,2

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Obligations et débentures	—	31 372 028	—	31 372 028
	—	31 372 028	—	31 372 028
31 décembre 2022				
Obligations et débentures	—	22 206 792	—	22 206 792
	—	22 206 792	—	22 206 792

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	3 443 721	2 173 723
Trésorerie	27 663	6 361
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	7 766	4 734
Total de l'actif	3 479 150	2 184 818
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	324	234
Montant à payer pour l'achat de titres	—	1 725
Charges à payer	174	149
Distributions à verser	28 964	—
Total du passif	29 462	2 108
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	3 449 688	2 182 710
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	19,71	17,46

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	82 987	47 328
Intérêts à distribuer	2	—
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	8 537	(32 858)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	307 816	(154 237)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	399 342	(139 767)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(32)	58
Revenu tiré du prêt de titres	27	—
Total des revenus (pertes), montant net	399 337	(139 709)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	2 863	1 838
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	520	334
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 075
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	420	276
Coûts de transactions	193	161
Total des charges	5 134	3 684
Charges absorbées par le gestionnaire	(662)	—
Charges, montant net	4 472	3 684
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	394 865	(143 393)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	2,79	(1,49)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	141 301	96 448

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	2 182 710	—
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	394 865	(143 393)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(76 101)	(14 791)
Gains nets réalisés sur les placements	(12 707)	—
Remboursement de capital	(4 188)	(9 309)
	(92 996)	(24 100)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	1 420 070	2 350 203
Distributions réinvesties	12 707	—
Palement au rachat	(467 668)	—
	965 109	2 350 203
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	1 266 978	2 182 710
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	3 449 688	2 182 710

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	394 865	(143 393)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(8 537)	32 858
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(307 816)	154 237
(Gain) perte de change latent	12	5
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(1 017 713)	(1 362 117)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	1 013 431	353 375
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(3 032)	(4 734)
Charges à payer et autres montants à payer	115	383
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	71 325	(969 386)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	564	999 852
Montant payé au rachat de parts rachetables	750	—
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(51 325)	(24 100)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(50 011)	975 752
Gain (perte) de change latent	(12)	(5)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	21 314	6 366
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	6 361	—
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	27 663	6 361
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts	2	—
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	80 617	42 594

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,8 %			
Services de communication – 4,8 %			
BCE Inc.	2 003	111 052	104 497
Québecor inc., cat. B	341	10 298	10 748
Rogers Communications Inc., cat. B	826	49 779	51 237
		171 129	166 482
Consommation discrétionnaire – 4,0 %			
BRP Inc., à droit de vote subalterne	82	8 308	7 775
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	391	17 650	17 134
Magna International, Inc.	654	57 422	51 202
Restaurant Brands International Inc.	606	50 590	62 739
		133 970	138 850
Consommation de base – 3,4 %			
George Weston Limitée	138	22 487	22 701
Les Compagnies Loblaw limitée	336	35 871	43 102
Metro inc.	522	35 710	35 804
Saputo Inc.	558	16 209	14 971
		110 277	116 578
Finance – 48,3 %			
Banque de Montréal	1 696	214 811	222 362
La Banque de Nouvelle-Écosse	2 834	205 075	182 793
Banque Canadienne Impériale de Commerce	2 177	139 853	138 893
Fairfax Financial Holdings Ltd., à droit de vote subalterne	53	46 107	64 793
Great-West Lifeco Inc.	604	22 941	26 491
iA Société financière Inc.	242	19 556	21 860
Société financière IGM Inc.	214	8 709	7 492
Intact Corporation financière	396	72 071	80 729
Banque Nationale du Canada	777	75 780	78 477
Onex Corp.	149	12 505	13 787
Power Corporation du Canada	1 212	46 552	45 923
Banque Royale du Canada	2 677	355 542	358 718
Financière Sun Life inc.	1 358	90 467	93 322
La Banque Toronto-Dominion	3 844	342 862	329 123
		1 652 831	1 664 763
Industrie – 17,6 %			
Air Canada	921	19 421	17 214
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	1 300	200 294	216 515
Canadien Pacifique Kansas City Limitée	2 131	214 891	223 414
TFI International Inc.	191	27 189	34 426
Thomson Reuters Corp.	321	50 006	62 187
Groupe WSP Global Inc.	288	49 693	53 493
		561 494	607 249
Technologies de l'information – 15,5 %			
CGI, Inc.	468	56 235	66 432
Constellation Software, Inc.	45	108 580	147 837
Open Text Corp.	617	32 269	34 361
Shopify Inc., cat. A	2 787	272 032	287 507
		469 116	536 137
Matériaux – 4,9 %			
Mines Agnico Eagle Limitée	1 029	65 681	74 757
CCL Industries Inc., cat. B	341	22 121	20 320
West Fraser Timber Co. Ltd.	122	13 318	13 830
Wheaton Precious Metals Corp.	916	48 439	59 879
		149 559	168 786
Immobilier – 0,5 %			
FirstService Corp.	87	18 647	18 674
Services aux collectivités – 0,8 %			
Hydro One Ltd.	660	23 212	26 202
TOTAL DES ACTIONS		3 290 235	3 443 721
COÛTS DE TRANSACTIONS		(93)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS		3 290 142	3 443 721
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,2 %			5 967
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			3 449 688

FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice d'actions responsables qui suit les rendements de titres de capitaux propres cotés en bourse au Canada.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	1 542	–	1 542	0,0
	1 542	–	1 542	0,0

31 décembre 2022				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	1 508	–	1 508	0,1
	1 508	–	1 508	0,1

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de néant, ou environ 0,0 % de l'actif net (néant ou environ 0,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,8 % de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts

rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 344 000 \$ (217 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débetures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,8	99,6
Services de communication	4,8	5,9
Consommation discrétionnaire	4,0	4,0
Consommation de base	3,4	4,1
Finance	48,3	46,6
Industrie	17,6	22,5
Technologies de l'information	15,5	8,8
Matériaux	4,9	6,4
Immobilier	0,5	0,5
Services aux collectivités	0,8	0,8
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,8	0,4

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	3 443 721	–	–	3 443 721
	3 443 721	–	–	3 443 721

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2022				
Actions	2 173 723	–	–	2 173 723
	2 173 723	–	–	2 173 723

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux	31 décembre 2023	31 décembre 2022
(en dollars)		
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	20 000 160	11 801 763
Trésorerie	90 935	32 247
Montant à recevoir pour la vente de titres	26 006	—
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	40 776	19 323
Total de l'actif	20 157 877	11 853 333
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	3 199	1 905
Montant à payer pour l'achat de titres	66 661	—
Charges à payer	1 056	666
Total du passif	70 916	2 571
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	20 086 961	11 850 762
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	20,09	17,56

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	577 102	252 648
Intérêts à distribuer	15	—
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	154 845	(135 458)
Gain (perte) net réalisé sur les instruments dérivés	—	362
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	1 794 575	(358 912)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	2 526 537	(241 360)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(3 019)	(307)
Revenu tiré du prêt de titres	717	242
Autres revenus	—	2 529
Total des revenus (pertes), montant net	2 524 235	(238 896)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	27 820	13 549
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	8 182	3 985
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 075
Retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts	57 946	27 715
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	4 821	2 278
Coûts de transactions	2 899	—
Total des charges	102 806	48 602
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	2 421 429	(287 498)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	2,82	(0,60)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	857 603	480 432

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	11 850 762	—
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	2 421 429	(287 498)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(124 335)	—
Gains nets réalisés sur les placements	(169 570)	—
Remboursement de capital	—	(155 250)
	(293 905)	(155 250)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	6 099 545	12 293 510
Distributions réinvesties	9 130	—
	6 108 675	12 293 510
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	8 236 199	11 850 762
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	20 086 961	11 850 762

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 421 429	(287 498)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(154 845)	135 458
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(1 794 575)	358 912
(Gain) perte de change latent	162	(359)
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(10 681 294)	(14 690 200)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	4 472 972	2 394 067
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(21 453)	(19 323)
Charges à payer et autres montants à payer	1 684	2 571
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	(5 755 920)	(12 106 372)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	6 099 545	12 293 510
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(284 775)	(155 250)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	5 814 770	12 138 260
Gain (perte) de change latent	(162)	359
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	58 850	31 888
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	32 247	—
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	90 935	32 247
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts	15	—
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts	497 703	205 610

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 %			
Australie – 6,9 %			
ANZ Group Holdings Ltd.	4 545	102 371	105 996
Arcadium Lithium PLC	976	12 400	9 844
Atlas Arteria Ltd., titres agrafés	1 516	8 770	7 884
Brambles Ltd.	2 270	23 999	27 777
CAR Group Ltd.	526	10 419	14 738
Cochlear Ltd.	107	21 322	28 754
Commonwealth Bank of Australia	2 546	231 533	256 106
Computershare Ltd.	720	15 433	15 800
CSL Ltd.	765	160 673	197 303
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	87	6 009	4 614
EBOS Group Ltd.	181	5 816	5 365
Evolution Mining Ltd.	2 073	6 458	7 386
Goodman Group	2 619	49 154	59 618
IDP Education Ltd.	511	11 507	9 209
IGO Ltd.	1 079	12 931	8 786
Insurance Australia Group Ltd.	4 154	19 296	21 155
Lendlease Corp. Ltd.	902	8 028	6 062
Lynas Rare Earths Ltd.	1 423	10 309	9 167
Macquarie Group Ltd.	574	94 368	94 837
Mineral Resources Ltd.	246	16 071	15 494
Mirvac Group	5 825	12 453	10 954
National Australia Bank Ltd.	4 729	123 882	130 625
Northern Star Resources Ltd.	1 355	12 899	16 642
Pilbara Minerals Ltd.	3 914	12 831	13 910
Pro Medicus Ltd.	90	6 234	7 760
QBE Insurance Group Ltd.	2 061	24 218	27 463
Ramsay Health Care Ltd.	241	12 301	11 408
REA Group Ltd.	74	9 278	12 061
Reece Ltd.	481	9 148	9 690
SEEK Ltd.	422	10 061	10 149
Sonic Healthcare Ltd.	647	21 446	18 675
Suncorp Group Ltd.	1 793	19 160	22 343
Transurban Group	4 436	54 738	54 720
Westpac Banking Corp.	5 301	105 181	109 223
WiseTech Global Ltd.	310	15 382	21 022
Worley Ltd.	577	8 385	9 064
	1 284 464	1 391 604	
Autriche – 0,3 %			
BAWAG Group AG	155	10 844	10 832
Erste Group Bank AG	508	26 640	27 178
Raiffeisen Bank International AG	291	7 489	7 914
Verbund AG	44	5 027	5 387
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	40	1 405	1 544
	51 405	52 855	
Belgique – 0,6 %			
Ageas SA	223	13 416	12 769
D'ieteren Group	28	6 888	7 215
Elia Group SA	46	6 037	7 592
KBC Group NV	409	36 277	34 982
Proximus SADP	122	2 995	1 512
Sofina SA	25	8 578	8 208
UCB SA	221	25 949	25 398
Umicore SA	230	11 655	8 342
Warehouses De Pauw CVA	260	11 588	10 793
	123 383	116 811	
Bermudes – 0,1 %			
Liberty Global Ltd., cat. A	499	12 629	11 692
Liberty Global Ltd., cat. C	100	2 285	2 458
	14 914	14 150	
Chine – 0,0 %			
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	2 700	3 231	4 022
Danemark – 4,2 %			
Coloplast AS, série B	176	30 821	26 549
Danske Bank AS	976	26 208	34 403
Demant AS	90	4 680	5 205
DSV AS	321	77 245	74 357
Genmab AS	110	50 297	46 319
Novo Nordisk AS, cat. B	4 380	366 599	597 458
Novozymes AS, actions de cat. B	263	18 015	19 070
Pandora AS	120	14 721	21 881
Tryg AS	504	14 682	14 467
	603 268	839 709	
Finlande – 1,2 %			
Elisa OYJ, série A	190	14 311	11 588
Huhtamäki OYJ	110	5 509	5 885
Kesko OYJ, série B	340	11 350	8 877
KONE OYJ, série B	462	33 606	30 390
Metso OYJ	998	14 234	13 330
Nokia OYJ	8 860	55 805	39 387
Nordea Bank Abp	4 891	72 491	79 976
Orion OYJ, série B	167	9 873	9 553
Sampo OYJ, série A	668	40 997	38 541
	258 176	237 527	

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
France – 8,8 %			
Aéroports de Paris SA	34	6 051	5 804
AXA SA	2 599	100 093	111 640
BioMérieux	65	9 421	9 525
BNP Paribas SA	1 733	144 545	157 994
Bouygues SA	335	14 994	16 649
Carrefour SA	814	20 624	19 641
Crédit Agricole SA	1 641	26 758	30 720
Danone SA	859	65 916	73 421
Dassault Systèmes SE	851	49 278	54 832
EssilorLuxottica SA	411	108 710	108 716
Hermès International SCA	47	101 584	131 361
Kering SA	119	92 607	69 160
Legrand SA	391	48 936	53 593
L'Oréal SA	325	175 614	213 334
Orange SA	2 979	42 659	44 711
Sanofi SA	1 939	251 871	253 512
Sartorius Stedim Biotech	52	19 387	18 140
Schneider Electric SE	842	180 880	222 944
Société Générale SA	1 234	47 972	43 183
Sodexo SA	119	14 248	17 268
Vinci SA	692	95 821	114 605
	1 617 969	1 770 753	
Allemagne – 8,3 %			
adidas AG	241	61 929	64 647
Allianz SE	591	179 022	208 282
Bayerische Motoren Werke AG	481	62 449	70 608
Bayerische Motoren Werke AG, priv.	110	14 723	14 412
Beiersdorf AG	132	18 325	26 091
BioNTech SE, CAAE	226	33 072	31 451
Carl Zeiss Meditec AG	40	7 693	5 759
Continental AG	182	19 585	20 391
Daimler Truck Holding AG	735	30 122	36 422
Delivery Hero SE	274	19 283	9 982
Deutsche Bank AG	2 673	37 181	48 139
Deutsche Boerse AG	275	62 342	74 705
Deutsche Post AG	1 404	89 453	91 731
Hannover Rueck SE	87	21 152	27 410
Henkel AG & Co. KGaA	141	12 984	13 346
Henkel AG & Co. KGaA, sans droit de vote, priv.	229	22 681	24 303
Knorr-Bremse AG	83	7 968	7 109
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	192	81 108	104 903
Porsche Automobil Holding SE	283	21 488	19 094
Puma SE	195	18 507	14 349
SAP SE	1 457	209 387	296 012
Sartorius AG, priv.	49	26 166	23 781
Siemens AG	1 173	228 822	290 322
Siemens Energy AG	1 169	26 911	20 433
Siemens Healthineers AG	447	33 686	34 248
Symrise AG	192	29 132	27 866
Talanx AG	64	3 439	6 027
Volkswagen AG	51	14 227	8 799
Volkswagen AG, priv., sans droit de vote	295	58 389	48 040
	1 451 226	1 668 662	
Hong Kong – 1,7 %			
AIA Group Ltd.	17 000	219 346	195 353
Alibaba Health Information Technology Ltd.	6 000	4 852	4 296
Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd.	2 800	6 937	5 494
Hang Seng Bank Ltd.	1 300	27 159	19 988
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	1 800	104 325	81 461
Swire Pacific Ltd., cat. A	1 000	8 771	11 162
Technic Industries Co. Ltd.	2 000	37 884	31 426
	409 274	349 180	
Irlande – 0,7 %			
AIB Group PLC	1 716	10 655	9 698
ICON PLC	119	36 695	44 418
James Hardie Industries PLC	702	27 750	35 680
Kerry Group PLC, série A	252	31 406	28 873
Kingspan Group PLC	237	25 205	27 065
	131 711	145 734	
Israël – 1,1 %			
Airport City Ltd.	84	1 917	1 904
Bank Hapoalim BM	2 156	24 122	25 667
Bank Leumi Le-Israel BM	2 671	26 655	28 472
Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.	3 299	5 996	5 951
Camtek Ltd.	85	6 289	7 918
Check Point Software Technologies Ltd.	124	19 789	24 982
CyberArk Software Ltd.	44	8 906	12 709
Enlight Renewable Energy Ltd.	186	4 586	4 770
First International Bank Of Israel Ltd.	163	8 089	8 822
Israel Discount Bank Ltd., série A	2 766	17 936	18 333
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	209	9 095	10 715
Nice Ltd.	112	30 197	29 902
Nova Ltd.	47	6 165	6 640
Phoenix Holdings Ltd.	337	4 984	4 523

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Israël – 1,1 % (suite)			
Plus500 Ltd.	169	4 211	4 724
Wix.com Ltd.	156	20 670	25 305
		199 607	223 337
Italie – 1,8 %			
Amplifon SpA	219	10 685	9 997
Assicurazioni Generali SpA	1 446	36 063	40 240
Banca Mediolanum SpA	448	5 375	5 569
Banco BPM SpA	2 019	14 448	14 060
DiaSorin SpA	38	6 413	5 161
FinecoBank Banca Fineco SpA	925	19 132	18 304
Interpump Group SpA	83	5 577	5 666
Intesa Sanpaolo SpA	22 029	70 587	84 823
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1 157	16 951	18 883
Moncler SpA	324	25 756	26 287
Nexi SpA	645	10 806	6 958
Poste Italiane SpA	915	13 154	13 694
PRADA SpA	800	6 593	6 032
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	158	10 675	11 238
Telecom Italia SpA	15 572	5 944	6 673
Telecom Italia SpA	18 079	7 785	7 976
UniCredit SpA	2 252	52 133	80 579
UnipolSai Assicurazioni SpA	1 023	3 432	3 368
		321 509	365 508
Japon – 22,7 %			
Advantest Corp.	1 200	40 789	53 840
Aisin Corp.	200	8 811	9 228
Alfresa Holdings Corp.	200	3 397	4 483
Amada Co. Ltd.	400	3 963	5 500
Asics Corp.	200	7 827	8 264
Astellas Pharma, Inc.	2 900	55 545	45 731
Bandai Namco Holdings, Inc.	800	25 088	21 149
Brother Industries Ltd.	300	7 381	6 315
Capcom Co. Ltd.	300	11 779	12 784
Central Japan Railway Co.	1 300	43 893	43 578
Chiba Bank Ltd.	800	7 211	7 621
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	900	33 494	44 968
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings, Inc.	100	1 310	1 894
Concordia Financial Group Ltd.	1 200	6 532	7 235
CyberAgent, Inc.	800	9 735	6 623
Dai Nippon Printing Co. Ltd.	300	10 227	11 709
Daifuku Co. Ltd.	500	14 072	13 340
Dai-ichi Life Holdings, Inc.	1 300	35 226	36 380
Daiichi Sankyo Co. Ltd.	2 800	100 881	101 403
Daikin Industries Ltd.	500	114 582	107 491
Daito Trust Construction Co. Ltd.	100	12 321	15 292
Daiwa House Industry Co. Ltd.	800	26 125	31 965
Daiwa Securities Group, Inc.	1 900	12 911	16 866
Denso Corp.	2 400	52 470	47 746
Dentsu Group, Inc.	300	13 308	10 152
Disco Corp.	200	46 386	65 434
East Japan Railway Co.	600	43 470	45 619
Ebara Corp.	100	5 256	7 808
Eisai Co. Ltd.	400	32 124	26 383
FANUC Corp.	1 400	64 166	54 302
Fast Retailing Co. Ltd.	200	56 737	65 453
Fuji Electric Co. Ltd.	200	11 389	11 353
Fukuoka Financial Group, Inc.	200	5 489	6 224
Hakuhodo DY Holdings, Inc.	200	2 415	2 021
Hankyu Hanshin Holdings, Inc.	400	16 087	16 794
Haseko Corp.	300	4 426	5 140
Hitachi Ltd.	1 300	96 082	123 657
Hoshizaki Corp.	200	9 016	9 654
Hulic Co. Ltd.	700	7 686	9 667
IHI Corp.	200	6 496	5 165
Iida Group Holdings Co. Ltd.	200	4 161	3 950
Isuzu Motors Ltd.	800	13 252	13 588
Ito En Ltd.	100	5 802	4 005
Japan Post Bank Co. Ltd.	500	5 938	6 716
Kajima Corp.	600	9 773	13 224
Kansai Paint Co. Ltd.	200	4 583	4 506
Keihan Holdings Co. Ltd.	100	3 785	3 448
Keikyu Corp.	200	2 824	2 410
Keisei Electric Railway Co. Ltd.	200	7 110	12 466
Kewpie Corp.	200	4 367	4 648
Keyence Corp.	300	173 538	174 304
Kikkoman Corp.	200	15 969	16 151
Kintetsu Group Holdings Co. Ltd.	300	12 523	12 548
Kobayashi Pharmaceutical Co. Ltd.	100	6 674	6 351
Koito Manufacturing Co. Ltd.	300	7 119	6 166
Konami Group Corp.	100	8 673	6 905
Kose Corp.	100	9 410	9 891
Kubota Corp.	1 500	34 302	29 778
Kurita Water Industries Ltd.	200	10 193	10 326
Kyowa Kirin Co. Ltd.	300	9 206	6 650
Kyushu Railway Co.	200	5 652	5 812
Lion Corp.	500	7 162	6 119
Lixil Corp.	300	7 962	4 940
LY Corp.	4 700	19 635	21 967

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Japon – 22,7 % (suite)			
M3, Inc.	800	29 313	17 457
Makita Corp.	300	12 612	10 915
MatsukiyoCocokara & Co.	600	12 350	14 013
Mazda Motor Corp.	900	9 944	12 825
Mebuki Financial Group, Inc.	1 400	3 447	5 616
Medipal Holdings Corp.	200	4 063	4 275
MEIJI Holdings Co. Ltd.	400	14 561	12 529
MINEBEA MITSUMI, Inc.	500	13 286	13 555
MISUMI Group, Inc.	400	12 724	8 940
Mitsubishi Electric Corp.	2 600	37 569	48 612
Mitsubishi HC Capital, Inc.	900	6 419	7 970
Mitsubishi Motors Corp.	1 300	5 788	5 459
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	16 300	134 465	184 700
Mizuho Financial Group, Inc.	3 400	59 529	76 719
MonotaRO Co. Ltd.	300	6 178	4 320
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	600	25 119	31 123
NEC Corp.	400	24 426	31 239
NGK Insulators Ltd.	300	5 530	4 729
NH Foods Ltd.	100	4 720	4 471
Nichirei Corp.	200	5 915	6 499
NIDEC Corp.	900	76 142	47 939
Nintendo Co. Ltd.	1 700	102 695	117 010
Nippon Paint Holdings Co. Ltd.	1 400	14 651	14 928
Nissan Motor Co. Ltd.	2 900	17 043	15 032
Nissin Seifun Group, Inc.	400	6 848	7 103
Niterra Co. Ltd.	300	7 838	9 397
Nitori Holdings Co. Ltd.	100	18 890	17 659
Nomura Holdings, Inc.	4 600	24 099	27 437
Nomura Research Institute Ltd.	500	19 505	19 179
NSK Ltd.	700	5 937	4 995
NTT Data Group Corp.	900	19 515	16 827
Obayashi Corp.	900	9 312	10 270
Obic Co. Ltd.	100	21 569	22 723
Odakyu Electric Railway Co. Ltd.	400	8 013	8 047
Olympus Corp.	1 800	45 357	34 353
Omron Corp.	300	24 582	18 471
Ono Pharmaceutical Co. Ltd.	600	17 861	14 119
Open House Group Co. Ltd.	100	6 522	3 912
Oracle Corp.	100	10 127	10 167
Otsuka Corp.	200	10 020	10 874
Persol Holdings Co. Ltd.	2 000	6 108	4 529
Pola Orbis Holdings, Inc.	200	3 553	2 963
Rakuten Group, Inc.	1 800	11 874	10 573
Recruit Holdings Co. Ltd.	2 300	113 267	128 277
Resona Holdings, Inc.	3 800	22 798	25 466
Ricoh Co. Ltd.	900	10 080	9 116
Rinnai Corp.	200	5 693	6 113
Ryohin Keikaku Co. Ltd.	400	8 114	8 827
Santen Pharmaceutical Co. Ltd.	600	7 640	7 885
SBI Holdings, Inc.	100	8 625	8 900
SCREEN Holdings Co. Ltd.	300	5 500	11 158
SCSK Corp.	300	6 602	7 845
Secom Co. Ltd.	300	24 751	28 494
Sega Sammy Holdings, Inc.	200	5 045	3 689
Sekisui Chemical Co. Ltd.	600	11 656	11 406
Sekisui House Ltd.	800	20 345	23 435
Seven Bank Ltd.	1 200	3 300	3 364
SG Holdings Co. Ltd.	500	11 538	9 465
Shimadzu Corp.	400	16 587	14 748
Shimamura Co. Ltd.	100	14 878	14 740
Shimano, Inc.	100	21 175	20 422
Shionogi & Co. Ltd.	400	29 702	25 433
Shiseido Co. Ltd.	600	35 303	23 862
Shizuoka Financial Group, Inc.	700	7 091	7 824
SMC Corp.	100	63 150	70 859
SoftBank Group Corp.	1 500	86 895	88 289
Sohgo Security Services Co. Ltd.	500	4 636	3 794
Sompo Holdings, Inc.	500	28 049	32 250
Sony Group Corp.	1 800	230 899	225 765
Square Enix Holdings Co. Ltd.	100	6 533	4 735
Stanley Electric Co. Ltd.	200	5 452	4 963
Subaru Corp.	900	20 269	21 768
Sugi Holdings Co. Ltd.	100	5 636	6 063
Sumitomo Electric Industries Ltd.	1 100	17 891	18 473
Sumitomo Heavy Industries Ltd.	200	6 538	6 650
Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	500	23 002	19 857
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1 900	92 565	122 264
Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	1 000	23 401	25 309
Sundrug Co. Ltd.	100	3 187	4 239
Suntory Beverage & Food Ltd.	200	10 201	8 698
Sysmex Corp.	200	20 721	14 699
T&D Holdings, Inc.	700	11 326	14 669
Taisei Corp.	200	7 552	9 020
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	2 400	91 848	91 002
THK Co. Ltd.	200	5 024	5 171
TIS, Inc.	300	11 253	8 718
Tobu Railway Co. Ltd.	300	9 568	10 632
Toho Co. Ltd.	200	10 358	8 921
Tokio Marine Holdings, Inc.	2 700	72 234	89 119

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Japon – 22,7 % (suite)			
Tokyo Century Corp.	400	5 465	5 713
Tokyo Electron Ltd.	700	120 031	165 349
Tokyu Corp.	700	11 557	11 268
TOPPAN Holdings, Inc.	300	6 534	11 041
TOTO Ltd.	200	8 792	6 946
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	100	5 263	6 809
Toyota Boshoku Corp.	100	2 431	2 093
Toyota Motor Corp.	15 900	344 880	385 244
Toyota Tsusho Corp.	300	15 964	23 312
Trend Micro, Inc.	200	12 444	14 119
Tsuruha Holdings, Inc.	100	10 200	12 089
Unicharm Corp.	600	29 799	28 609
Welcia Holdings Co. Ltd.	100	3 433	2 306
West Japan Railway Co.	400	22 187	22 002
Yakult Honsha Co. Ltd.	400	15 662	11 849
Yamada Holdings Co. Ltd.	700	3 264	2 870
Yamato Holdings Co. Ltd.	400	9 851	9 748
Yamazaki Baking Co. Ltd.	100	1 555	3 008
Yaskawa Electric Corp.	400	21 931	22 036
Yokogawa Electric Corp.	300	6 657	7 545
Zensho Holdings Co. Ltd.	100	7 501	6 911
ZOZO, Inc.	200	5 078	5 939
		4 300 092	4 550 775
Luxembourg – 0,2 %			
B&M European Value Retail SA	1 265	11 219	11 912
Eurofins Scientific SE	236	22 418	20 275
Millicom International Cellular SA, CAAE	246	5 881	5 802
		39 518	37 989
Pays-Bas – 6,9 %			
Adyen NV	49	99 766	83 264
AerCap Holdings NV	246	17 646	24 108
Akzo Nobel NV	287	30 522	31 278
Argenx SE, CAAE	73	31 496	36 619
ASM International NV	65	31 235	44 494
ASML Holding NV	572	476 838	567 972
Ferrari NV	187	61 903	83 131
HAL Trust	127	22 940	21 052
ING Groep NV	5 412	102 536	106 626
JDE Peet's NV	298	11 009	10 574
Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 499	58 272	56 802
Koninklijke KPN NV	5 483	25 447	24 902
Prosus NV	2 308	142 015	90 718
Stellantis NV	3 192	66 147	98 336
Universal Music Group NV	1 157	35 828	43 497
Wolters Kluwer NV	372	55 926	69 736
		1 269 526	1 393 109
Nouvelle-Zélande – 0,4 %			
a2 Milk Co. Ltd.	965	5 573	3 706
Auckland International Airport Ltd.	1 682	10 886	12 358
Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd.	964	21 289	18 994
Mainfreight Ltd.	123	7 955	7 116
Meridian Energy Ltd.	1 780	7 609	8 233
Spark New Zealand Ltd.	2 672	10 831	11 555
Xero Ltd.	170	16 185	17 177
		80 328	79 139
Norvège – 0,6 %			
Adevinta ASA, série B	381	4 841	5 560
AutoStore Holdings Ltd.	788	2 045	2 044
DNB Bank ASA	1 517	38 006	42 544
Gjensidige Forsikring ASA	243	6 407	5 916
Mowi ASA	811	21 641	19 164
Nordic Semiconductor ASA	169	5 234	2 765
Orkla ASA	1 610	16 588	16 481
Salmar ASA	112	7 499	8 277
Schibsted ASA	129	4 001	4 901
Schibsted ASA, série B	184	6 255	6 608
SpareBank 1 SR-Bank ASA	183	3 277	3 063
Storebrand ASA	525	6 515	6 138
		122 309	123 461
Pologne – 0,3 %			
Allegro.eu SA	652	7 923	7 286
Budimex SA	24	5 066	5 038
CD Projekt SA	58	3 062	2 237
InPost SA	188	1 902	3 427
KGHM Polska Miedz SA	217	9 077	8 928
mBank SA	22	3 324	3 947
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	1 099	10 481	18 544
Powszechny Zakład Ubezpieczen SA	711	9 807	11 270
Santander Bank Polska SA	28	2 948	4 599
		53 590	65 276
Portugal – 0,0 %			
Banco Comercial Portugues SA	8 696	1 935	3 476

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Singapour – 1,4 %			
CapitaLand Investment Ltd.	3 700	12 917	11 688
City Developments Ltd.	400	3 125	2 659
DBS Group Holdings Ltd.	2 800	90 121	93 513
Keppel Corp. Ltd.	2 500	14 485	17 668
Keppel REIT	300	241	279
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	4 700	55 673	61 077
SATS Ltd.	1 696	4 924	4 662
Singapore Exchange Ltd.	1 700	15 840	16 705
United Overseas Bank Ltd.	2 100	58 035	59 722
Venture Corp. Ltd.	300	5 737	4 081
		261 098	272 054
Espagne – 2,6 %			
Aena SME SA	107	21 393	25 576
Amadeus IT Group SA, cat. A	715	61 252	67 570
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	8 888	78 492	106 495
Banco Santander SA	24 119	108 474	132 780
CaixaBank SA	5 480	25 622	29 742
EDP Renovaveis SA	464	13 469	12 520
Industria de Diseno Textil SA	1 685	66 707	96 775
Telefonica SA	8 446	46 070	43 477
		421 479	514 935
Suède – 4,0 %			
AddTech AB, série B	334	8 218	9 675
Assa Abloy AB, série B	1 450	49 063	55 076
Atlas Copco AB, série A	4 071	66 471	92 442
Atlas Copco AB, série B	2 144	30 516	41 910
Avanza Bank Holding AB	141	4 757	4 308
Axfood AB	116	3 875	4 143
Beijer Ref AB	549	11 936	9 690
Boliden AB	389	19 992	16 007
Castellum AB	698	13 924	13 087
Electrolux AB, série B	411	8 703	5 813
Elektro AB, cat. B	343	4 347	3 694
Embracer Group AB	1 148	9 828	4 109
EQT AB	720	24 650	26 849
Fabege AB	219	3 932	3 100
Fastighets AB Balder, cat. B	1 196	11 073	11 192
Gefinge AB, série B	277	9 884	8 129
H & M Hennes & Mauritz AB, série B	899	17 643	20 775
Hexagon AB	3 144	48 494	49 755
Holmen AB, série B	118	6 560	6 573
Husqvarna AB, cat. B	795	9 787	8 632
Indutrade AB	454	13 340	15 551
Investment AB Latour, cat. B	285	8 041	9 781
Kinnevik AB, série B	296	9 242	4 187
Lifco AB, cat. B	298	8 499	9 639
Nibe Industrier AB	2 498	32 610	23 140
Sagax AB, série B	349	12 182	12 667
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2 560	41 238	46 492
Skanska AB, série B	654	16 635	15 604
SKF AB, série B	808	19 590	21 281
Svenska Cellulosa AB SCA, série B	902	17 674	17 833
Svenska Handelsbanken AB, série A	2 216	27 923	31 734
Sweco AB, cat. B	217	4 173	3 836
Swedbank AB	1 653	33 018	43 970
Swedish Orphan Biovitrum AB	319	8 793	11 144
Tele2 AB, série B	750	10 788	8 492
Telia Co. AB	3 622	14 740	12 194
Thule Group AB	158	6 207	5 675
Trelleborg AB, série B	234	7 945	10 336
Volvo AB, série B	2 181	58 233	74 680
Volvo AB, série A	620	17 736	21 660
Volvo Car AB, série B	525	4 489	2 237
		736 749	797 092
Suisse – 12,1 %			
Cie Financière Richemont SA	773	140 758	140 179
Geberit AG	52	40 533	43 911
Givaudan SA	13	64 732	70 958
Kuehne & Nagel International AG	86	31 648	39 046
Nestlé SA	4 111	659 985	628 027
Novartis AG	3 061	356 792	407 004
Partners Group Holding AG	31	47 690	58 912
Roche Holding AG	1 063	470 842	407 187
Roche Holding AG	53	25 303	21 705
Schindler Holding AG, priv.	70	21 193	23 063
Schindler Holding AG	23	6 421	7 189
Sika AG	232	90 996	99 482
Straumann Holding AG	183	34 046	38 877
Swatch Group AG, série B	37	13 444	13 251
Swatch Group AG	71	6 686	4 900
Swiss Re AG	381	48 285	56 444
Swisscom AG	46	34 205	36 466
UBS Group AG	4 649	122 172	190 100
Zurich Insurance Group AG	203	123 599	139 809
		2 339 330	2 426 510

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,6 % (suite)			
Royaume-Uni – 12,7 %			
Admiral Group PLC	249	11 110	11 234
Allfunds Group PLC	438	4 588	4 099
Antofagasta PLC	413	9 288	11 660
AstraZeneca PLC	2 368	393 468	421 932
Auto Trader Group PLC	1 112	11 589	13 485
Aviva PLC	4 163	33 494	30 419
Barratt Developments PLC	1 215	11 295	11 490
Berkeley Group Holdings PLC	153	11 331	12 057
BT Group PLC	9 013	22 490	18 726
Bunzl PLC	501	24 103	26 865
Burberry Group PLC	673	21 647	16 019
ConvaTec Group PLC	2 636	9 402	10 820
Croda International PLC	264	29 516	22 410
Experian PLC	1 450	70 334	78 045
Fresnillo PLC	183	2 725	1 828
GSK PLC	6 583	178 615	160 475
Halma PLC	486	20 099	18 659
Hargreaves Lansdown PLC	391	6 784	4 824
HSBC Holdings PLC	32 520	293 911	347 393
Informa PLC	2 294	22 902	30 124
Intermediate Capital Group PLC	443	12 136	12 514
Kingfisher PLC	3 523	16 033	14 408
Land Securities Group PLC	956	11 891	11 326
Legal & General Group PLC	8 544	37 787	36 063
Lloyds Banking Group PLC	102 650	81 451	82 323
London Stock Exchange Group PLC	523	66 266	81 531
M&G PLC	2 865	9 579	10 711
NatWest Group PLC	11 118	41 814	41 003
Next PLC	169	18 477	23 062
Ocado Group PLC	1 159	14 075	14 775
Pearson PLC	964	12 026	15 624
Persimmon PLC	665	16 254	15 527
Phoenix Group Holdings PLC	1 275	12 783	11 471
Prudential PLC	4 276	76 633	63 770
Reckitt Benckiser Group PLC	1 139	113 658	103 772
RELX PLC	2 815	112 038	147 161
Rentokil Initial PLC	5 059	41 320	37 485
Rightmove PLC	1 600	16 757	15 481
Sage Group PLC	1 338	16 498	26 371
Schroders PLC	1 059	8 084	7 653
Segro PLC	1 727	31 124	25 732
Severn Trent PLC	321	13 771	13 916
Smith & Nephew PLC	1 723	32 311	31 236
Spirax-Sarco Engineering PLC	137	26 123	24 192
St. James's Place PLC	899	19 293	10 330
Standard Chartered PLC	4 536	45 287	50 827
Taylor Wimpey PLC	4 644	10 099	11 479
Unilever PLC	3 925	257 994	250 714
United Utilities Group PLC	974	17 082	17 347
Vodafone Group PLC	38 346	64 965	44 192
Whitbread PLC	273	12 133	16 777
Wise PLC, cat. A	1 116	12 277	16 396
WPP PLC	1 482	23 975	18 759
		2 490 685	2 556 492
TOTAL DES ACTIONS		18 586 776	20 000 160
COÛTS DE TRANSACTIONS		(22 279)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS		18 564 497	20 000 160
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,4 %			86 801
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			20 086 961

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice d'actions responsables qui suit les rendements de titres de capitaux propres cotés en bourse émis par des sociétés dans des marchés développés à l'extérieur de l'Amérique du Nord.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Euro	6 139 198	—	6 139 198	30,6
Yen japonais	4 561 298	—	4 561 298	22,7
Livre sterling	2 573 719	—	2 573 719	12,8
Franc suisse	2 447 414	—	2 447 414	12,2
Dollar australien	1 443 454	—	1 443 454	7,2
Couronne danoise	842 683	—	842 683	4,2
Couronne suédoise	804 972	—	804 972	4,0
Dollar de Hong Kong	357 285	—	357 285	1,8
Dollar de Singapour	278 633	—	278 633	1,4
Dollar américain	216 204	—	216 204	1,1
Shekel israélien	158 020	—	158 020	0,8
Couronne norvégienne	126 592	—	126 592	0,6
Dollar néo-zélandais	71 793	—	71 793	0,4
Zloty polonais	65 235	—	65 235	0,3
	20 086 500	—	20 086 500	100,1

31 décembre 2022

Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Euro	3 291 351	—	3 291 351	27,7
Yen japonais	2 808 690	—	2 808 690	23,7
Livre sterling	1 563 189	—	1 563 189	13,2
Franc suisse	1 524 444	—	1 524 444	12,9
Dollar australien	900 258	—	900 258	7,6
Couronne suédoise	461 920	—	461 920	3,9
Couronne danoise	401 518	—	401 518	3,4
Dollar de Hong Kong	372 536	—	372 536	3,1
Dollar de Singapour	190 641	—	190 641	1,6
Dollar américain	129 384	—	129 384	1,1
Couronne norvégienne	89 512	—	89 512	0,8
Dollar néo-zélandais	59 571	—	59 571	0,5
Shekel israélien	32 384	—	32 384	0,3
Zloty polonais	25 342	—	25 342	0,2
	11 850 740	—	11 850 740	100,0

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 2 009 000 \$ ou environ 10,0 % (1 185 000 \$ ou environ 10,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,6 % de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 2 000 000 \$ (1 180 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débentures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,6	99,6
Australie	6,9	7,5
Autriche	0,3	0,2
Belgique	0,6	0,7
Bermudes	0,1	—
Chine	0,0	0,1
Danemark	4,2	3,4
Finlande	1,2	1,4
France	8,8	8,1
Allemagne	8,3	7,2
Hong Kong	1,7	3,1
Irlande	0,7	0,3
Israël	1,1	0,6
Italie	1,8	1,6
Japon	22,7	23,6
Luxembourg	0,2	0,1
Pays-Bas	6,9	6,4
Nouvelle-Zélande	0,4	0,5
Norvège	0,6	0,7
Pologne	0,3	0,2
Singapour	1,4	1,5
Espagne	2,6	2,3
Suède	4,0	3,9
Suisse	12,1	12,8
Royaume-Uni	12,7	13,4
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT		
TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,4	0,3

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	20 000 160	—	—	20 000 160
	20 000 160	—	—	20 000 160
31 décembre 2022				
Actions	11 801 763	—	—	11 801 763
	11 801 763	—	—	11 801 763

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux	31 décembre 2023	31 décembre 2022
(en dollars)		
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	51 975 510	29 210 187
Trésorerie	212 791	33 433
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	41 523	21 092
Total de l'actif	52 229 824	29 264 712
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	6 979	4 006
Charges à payer	1 611	964
Distributions à verser	194 328	–
Total du passif	202 918	4 970
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	52 026 906	29 259 742
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	21,68	17,21

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	665 064	295 023
Intérêts à distribuer	428	–
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	1 427 979	(427 818)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	7 950 878	(1 210 151)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	10 044 349	(1 342 946)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(7 237)	2 888
Revenu tiré du prêt de titres	1 289	38
Total des revenus (pertes), montant net	10 038 401	(1 340 020)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	57 900	27 929
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	12 407	5 985
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 075
Retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts	94 088	43 259
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	9 126	4 304
Coûts de transactions	830	546
Total des charges	175 489	83 098
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	9 862 912	(1 423 118)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	4,67	(1,20)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	2 110 959	1 183 008

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	29 259 742	–
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	9 862 912	(1 423 118)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(476 728)	(65 620)
Gains nets réalisés sur les placements	(1 513 848)	–
Remboursement de capital	–	(36 280)
	(1 990 576)	(101 900)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	17 225 930	32 482 400
Distributions réinvesties	1 513 848	–
Paieement au rachat	(3 844 950)	(1 697 640)
	14 894 828	30 784 760
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	22 767 164	29 259 742
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	52 026 906	29 259 742

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	9 862 912	(1 423 118)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(1 427 979)	427 818
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(7 950 878)	1 210 151
(Gain) perte de change latent	317	22
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(14 357 376)	(11 204 327)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	14 328 286	7 129 547
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(20 431)	(21 092)
Charges à payer et autres montants à payer	3 620	4 970
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	438 471	(3 876 029)
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	28 243	4 014 752
Montant payé au rachat de parts rachetables*	(4 639)	(3 368)
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(282 400)	(101 900)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(258 796)	3 909 484
Gain (perte) de change latent	(317)	(22)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	179 675	33 455
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	33 433	–
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	212 791	33 433
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts	428	–
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts	550 546	230 672

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 %			
Services de communication – 3,6 %			
Charter Communications Inc., cat. A	201	115 223	103 015
Comcast Corp., cat. A	8 085	449 562	467 480
Electronic Arts, Inc.	497	83 319	89 658
Fox Corp., cat. A	501	22 766	19 601
Fox Corp., cat. B	241	10 371	8 787
Match Group, Inc.	684	43 746	32 920
Netflix, Inc.	740	333 095	475 080
Omnicom Group, Inc.	361	38 610	41 180
Pinterest, Inc., cat. A	991	32 279	48 401
Sirius XM Holdings, Inc.	1 116	8 337	8 049
Snap Inc., cat. A	1 658	36 366	37 013
Take-Two Interactive Software, Inc.	330	58 671	70 035
Walt Disney Co.	3 399	488 249	404 673
Warner Bros Discovery, Inc.	4 264	80 425	63 984
Warner Music Group Corp., cat. A	240	9 781	11 326
	1 810 800		1 881 202
Consommation discrétionnaire – 8,3 %			
Airbnb, Inc.	850	143 293	152 587
Aptiv PLC	602	83 041	71 219
AutoZone Inc.	35	105 484	119 328
Best Buy Co., Inc.	370	40 169	38 191
Booking Holdings, Inc.	74	242 209	346 125
CarMax, Inc.	332	36 032	33 595
Chipotle Mexican Grill, Inc.	49	111 050	147 764
DoorDash, Inc., cat. A	515	49 829	67 154
DR Horton, Inc.	579	73 606	116 032
eBay, Inc.	1 128	71 592	64 879
Expedia Group, Inc.	290	45 383	58 044
General Motors Co.	2 925	142 380	138 540
Genuine Parts Co.	291	63 528	53 144
Home Depot, Inc.	1 951	800 678	891 531
Lennar Corp., cat. A	462	60 224	90 794
Lennar Corp., cat. B	24	2 535	4 242
Live Nation Entertainment, Inc.	296	32 093	36 533
Lowe's Cos., Inc.	1 164	322 107	341 581
Lululemon Athletica, Inc.	196	89 185	132 141
MercadoLibre, Inc.	80	125 352	165 779
NIKE, Inc., cat. B	2 203	330 558	315 382
NVR, Inc.	6	41 520	55 385
PulteGroup, Inc.	403	30 677	54 851
Ross Stores, Inc.	619	82 960	112 956
Sherwin-Williams Co.	485	161 908	199 467
TJX Cos., Inc.	2 183	214 339	270 032
Tractor Supply Co.	226	63 553	64 080
Ulta Beauty, Inc.	101	60 203	65 256
Yum! Brands, Inc.	545	90 079	93 897
	3 715 567		4 300 509
Consommation de base – 5,6 %			
Archer-Daniels-Midland Co.	1 051	113 195	100 086
Church & Dwight Co., Inc.	484	58 584	60 348
Clorox Co.	268	52 276	50 389
Colgate-Palmolive Co.	1 488	151 161	156 397
Estée Lauder Cos., Inc., cat. A	554	154 581	106 836
General Mills, Inc.	1 064	103 543	91 391
Hershey Co.	302	89 366	74 244
J M Smucker Co.	196	35 432	32 662
Kellanova	506	44 988	37 304
Keurig Dr Pepper, Inc.	1 780	81 534	78 206
Kraft Heinz Co.	1 570	77 680	76 556
McCormick & Co., Inc., sans droit de vote	506	56 240	45 651
Mondelez International, Inc., cat. A	2 653	235 508	253 378
Monster Beverage Corp.	979	63 767	74 369
PepsiCo, Inc.	2 682	616 710	600 637
Procter & Gamble Co.	4 377	858 720	845 757
Sysco Corp.	953	98 690	91 897
Target Corp.	862	191 165	161 879
	3 083 140		2 937 987
Finance – 22,3 %			
Aflac, Inc.	983	86 032	106 935
Allstate Corp.	428	68 397	78 999
American Express Co.	1 127	241 420	278 399
American International Group, Inc.	1 313	100 509	117 297
Ameriprise Financial, Inc.	195	78 881	97 664
Aon PLC, cat. A	398	161 228	152 728
Apollo Global Management, Inc.	809	74 203	99 410
Arch Capital Group Ltd.	606	48 223	59 347
ARES Management Corp.	289	40 807	45 317
Arthur J Gallagher & Co.	387	113 333	114 756
Bank of America Corp.	12 943	585 435	574 634
Bank of New York Mellon Corp.	1 377	84 373	94 508
BlackRock, Inc., cat. A	290	265 254	310 427
Blackstone, Inc., cat. A	1 493	194 765	257 738
Capital One Financial Corp.	667	94 114	115 321
Cboe Global Markets, Inc.	200	33 797	47 090
Charles Schwab Corp.	2 568	234 221	232 968
Chubb Ltd.	739	197 995	220 225
Cincinnati Financial Corp.	295	42 386	40 245
Citigroup, Inc.	3 676	244 098	249 339
Citizens Financial Group, Inc.	995	43 959	43 480

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Finance – 22,3 % (suite)			
CME Group Inc.	657	176 105	182 447
Coinbase Global, Inc., cat. A	279	24 994	63 983
Discover Financial Services	499	69 026	73 957
Everest Group Ltd.	61	26 491	28 440
Fidelity National Financial, Inc.	477	25 585	32 090
Fidelity National Information Services, Inc.	1 231	122 431	97 505
Fifth Third Bancorp	1 295	56 635	58 895
Fiserv, Inc.	1 153	166 368	201 963
FleetCor Technologies, Inc.	151	46 221	56 270
Franklin Resources, Inc.	555	20 073	21 801
Global Payments, Inc.	521	81 531	87 248
Globe Life, Inc.	172	24 103	27 606
Goldman Sachs Group, Inc.	634	282 373	322 501
Hartford Financial Services Group, Inc.	575	53 441	60 944
Huntington Bancshares, Inc.	2 773	45 317	46 510
Interactive Brokers Group, Inc., cat. A	207	20 248	22 628
Intercontinental Exchange, Inc.	1 059	156 726	179 339
JPMorgan Chase & Co.	5 699	1 042 517	1 278 251
KeyCorp	1 761	34 251	33 438
M&T Bank Corp.	338	62 620	61 095
Markel Group, Inc.	25	44 320	46 807
Marsh & McLennan Cos., Inc.	946	213 509	236 344
Mastercard, Inc., cat. A	1 665	805 686	936 389
MetLife, Inc.	1 211	100 726	105 598
Moody's Corp.	304	127 925	156 558
Morgan Stanley	2 732	311 271	335 925
MSCI, Inc.	156	102 228	116 355
Nasdaq, Inc.	656	48 740	50 291
Northern Trust Corp.	394	45 988	43 838
PayPal Holdings, Inc.	2 364	249 727	191 425
PNC Financial Services Group, Inc.	801	161 608	163 552
Principal Financial Group, Inc.	468	45 697	48 548
Progressive Corp.	989	164 258	207 716
Prudential Financial, Inc.	701	91 368	95 863
Raymond James Financial, Inc.	364	48 170	53 517
Regions Financial Corp.	1 993	50 178	50 930
S&P Global, Inc.	631	313 770	366 529
State Street Corp.	596	59 508	60 875
Synchrony Financial	792	36 199	39 883
T Rowe Price Group, Inc.	467	73 835	66 314
Travelers Cos., Inc.	420	94 883	105 496
Truist Financial Corp.	2 450	134 281	119 273
U.S. Bancorp	2 763	147 323	157 682
Visa Inc., cat. A	2 992	872 492	1 027 146
W R Berkley Corp.	367	30 617	34 223
Wells Fargo & Co.	6 853	405 209	444 770
Willis Towers Watson PLC	176	51 720	55 976
	10 401 722		11 591 561
Soins de santé – 17,0 %			
Abbott Laboratories	3 319	472 251	481 714
AbbVie, Inc.	3 474	673 277	709 889
Agilent Technologies, Inc.	610	103 672	111 828
Arlinam Pharmaceuticals, Inc.	260	69 331	65 622
Avantor, Inc.	1 447	46 228	43 560
Biogen, Inc.	293	95 954	99 976
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	368	43 249	46 787
Boston Scientific Corp.	2 766	168 527	210 847
Bristol-Myers Squibb Co.	4 416	391 843	298 775
Centene Corp.	1 039	106 278	101 670
Cigna Group	516	185 746	203 745
Danaher Corp.	1 425	421 380	434 689
Dexcom, Inc.	684	96 859	111 920
Edwards Lifesciences Corp.	1 276	151 880	128 293
Elevance Health, Inc.	441	274 389	274 213
Gilead Sciences, Inc.	2 233	217 781	238 529
Henry Schein, Inc.	286	29 109	28 552
Hologic, Inc.	486	48 475	45 788
Humana, Inc.	235	147 593	141 862
IDEXX Laboratories, Inc.	172	104 745	125 885
Illumina, Inc.	390	104 219	71 605
Incyte Corp.	378	33 860	31 297
Intuitive Surgical, Inc.	711	260 390	316 283
IQVIA Holdings, Inc.	376	105 533	114 717
Medtronic PLC	2 728	323 274	296 332
Merck & Co., Inc.	4 791	619 860	688 724
Mettler-Toledo International, Inc.	47	82 293	75 172
Moderna, Inc.	856	146 615	112 251
Pfizer, Inc.	11 877	679 754	450 881
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	204	190 489	236 255
ResMed, Inc.	286	81 368	64 872
Royalty Pharma plc, cat. A	703	34 614	26 039
Stryker Corp.	587	201 144	231 788
Thermo Fisher Scientific, Inc.	834	587 793	583 716
UnitedHealth Group, Inc.	1 697	1 117 586	1 178 063
Veeva Systems Inc., cat. A	295	75 288	74 888
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	471	188 308	252 703
Waters Corp.	124	49 127	53 831
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	430	73 526	69 004
	8 803 608		8 832 565

FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Industrie – 7,1 %			
3M Co.	1 032	140 226	148 762
A O Smith Corp.	233	20 806	25 328
AMETEK, Inc.	462	82 883	100 450
Automatic Data Processing, Inc.	911	271 447	279 854
Broadridge Financial Solutions, Inc.	232	47 910	62 942
Carrier Global Corp.	1 744	108 121	132 114
CH Robinson Worldwide, Inc.	230	29 542	26 200
Copart, Inc.	1 650	77 798	106 609
CoStar Group, Inc.	826	80 751	95 182
Cummins, Inc.	281	83 737	88 767
Deere & Co.	524	267 446	276 289
Dover Corp.	278	53 378	56 382
Equifax, Inc.	249	67 476	81 193
Expeditors International of Washington, Inc.	294	43 089	49 311
Fastenal Co.	1 013	72 828	86 516
Ferguson PLC	393	83 797	100 051
Illinois Tool Works, Inc.	597	178 469	206 200
Ingersoll Rand, Inc.	793	58 516	80 871
JB Hunt Transport Services, Inc.	168	40 458	44 247
Johnson Controls International PLC	1 353	110 878	102 834
Masco Corp.	424	30 534	37 448
Otis Worldwide Corp.	823	87 034	97 094
PACCAR, Inc.	1 020	110 452	131 336
Paychex, Inc.	648	101 365	101 774
Quanta Services, Inc.	294	68 933	83 659
Rivian Automotive, Inc., cat. A	1 844	39 507	57 043
Roper Technologies, Inc.	203	122 962	145 929
Snap-on, Inc.	102	37 138	38 848
Stanley Black & Decker, Inc.	261	37 943	33 762
Trane Technologies PLC	406	94 639	130 572
TransUnion	579	49 884	52 458
United Parcel Service, Inc., cat. B	1 534	367 850	318 034
Verisk Analytics, Inc.	296	78 953	93 228
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	332	42 893	55 554
W.W. Grainger, Inc.	73	57 897	79 768
Xylem, Inc.	451	60 949	68 009
	3 308 489		3 674 618

Technologies de l'information – 33,3 %

Adobe, Inc.	825	470 093	649 008
Advanced Micro Devices, Inc.	2 928	372 701	569 129
Amdocs Ltd.	235	26 424	27 235
ANSYS, Inc.	170	65 674	81 344
Applied Materials, Inc.	1 640	264 432	350 477
Arista Networks, Inc.	396	74 930	122 975
Atlassian Corp., cat. A	308	72 652	96 602
Autodesk, Inc.	421	115 688	135 163
Block, Inc., cat. A	1 071	98 105	109 235
Broadcom, Inc.	743	678 272	1 093 612
Cadence Design Systems, Inc.	498	123 998	178 855
CDW Corp.	260	67 016	77 933
Cisco Systems, Inc.	7 936	527 574	528 662
Cloudflare, Inc., cat. A	580	42 916	63 676
Cognizant Technology Solutions Corp., cat. A	1 000	92 906	99 594
CrowdStrike Holdings, Inc., cat. A	381	94 941	128 269
Datadog, Inc., cat. A	603	69 788	96 511
Enphase Energy, Inc.	386	87 921	67 257
EPAM Systems, Inc.	117	45 362	45 872
Fair Isaac Corp.	45	46 397	69 069
Fortinet, Inc.	1 307	107 208	100 871
Gartner, Inc.	152	62 272	90 415
Gen Digital, Inc.	1 179	33 515	35 477
HP, Inc.	1 845	78 030	73 203
HubSpot, Inc.	100	55 624	76 550
Intuit, Inc.	548	336 031	451 642
KLA Corp.	253	130 761	193 925
Lam Research Corp.	265	193 508	273 694
Marvell Technology, Inc.	1 821	122 981	144 815
Microsoft Corp.	9 918	3 650 103	4 917 804
MongoDB, Inc.	130	54 596	70 084
Motorola Solutions, Inc.	310	119 549	127 981
NetApp, Inc.	406	39 418	47 197
NVIDIA Corp.	4 693	1 843 549	3 064 515
Okta, Inc.	328	43 653	39 154
Oracle Corp.	2 992	357 150	415 948
Palo Alto Networks, Inc.	551	144 503	214 245
QUALCOMM, Inc.	2 112	337 845	402 778
Salesforce, Inc.	1 780	458 245	617 618
ServiceNow, Inc.	361	232 829	336 300
Snowflake Inc., cat. A	549	123 466	144 058
Splunk, Inc.	295	40 745	59 262
Spotify Technology SA	245	45 288	60 706
SS&C Technologies Holdings, Inc.	437	35 746	35 213
Synopsys, Inc.	281	133 841	190 788
Teradyne, Inc.	351	46 581	50 226
Trade Desk, Inc.	929	82 146	88 150
Trimble, Inc.	599	43 101	42 020
Twilio Inc., cat. A	350	41 723	35 015
Unity Software, Inc.	540	24 496	29 115
VeriSign, Inc.	183	49 889	49 699
Workday, Inc., cat. A	385	100 347	140 145

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Technologies de l'information – 33,3 % (suite)			
Zebra Technologies Corp., cat. A	113	45 457	40 727
Zoom Video Communications, Inc., cat. A	527	59 059	49 970
Zscaler, Inc.	165	35 801	48 205
	12 746 846		17 347 993
Matériaux – 1,1 %			
Amcor PLC	2 841	42 406	36 113
Ball Corp.	610	52 152	46 266
Ecolab, Inc.	488	112 071	127 634
Newmont Corp.	1 414	93 943	77 172
Nucor Corp.	501	94 005	114 974
PPG Industries, Inc.	480	85 344	94 654
Vulcan Materials Co.	261	65 547	78 126
	545 468		574 939
Immobilier – 1,5 %			
CBRE Group, Inc., cat. A	584	64 208	71 685
Crown Castle, Inc.	794	113 275	120 600
Prologis, Inc.	1 868	311 642	328 337
Realty Income Corp.	1 396	116 262	105 697
SBA Communications Corp.	184	56 820	61 551
VICI Properties Inc.	1 960	85 110	82 393
	747 317		770 263
Services aux collectivités – 0,1 %			
American Water Works Co., Inc.	367	72 233	63 873
TOTAL DES ACTIONS		45 235 190	51 975 510
COÛTS DE TRANSACTIONS		(407)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS		45 234 783	51 975 510
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,1 %			51 396
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			52 026 906

FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice d'actions responsables qui suit les rendements d'actions américaines cotées en bourse.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	52 032 815	–	52 032 815	100,0
	52 032 815	–	52 032 815	100,0

31 décembre 2022				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	29 255 566	–	29 255 566	100,0
	29 255 566	–	29 255 566	100,0

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 5 203 000 \$, ou environ 10,0 % de l'actif net (2 926 000 \$ ou environ 10,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,9 % de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts

rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 5 198 000 \$ (2 921 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débentures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,9	99,8
Services de communication	3,6	3,7
Consommation discrétionnaire	8,3	8,2
Consommation de base	5,6	5,8
Finance	22,3	15,9
Soins de santé	17,0	19,3
Industrie	7,1	5,6
Technologies de l'information	33,3	38,3
Matériaux	1,1	1,3
Immobilier	1,5	1,6
Services aux collectivités	0,1	0,1
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,4	0,1

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

31 décembre 2023	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Actions	51 975 510	–	–	51 975 510
	51 975 510	–	–	51 975 510

31 décembre 2022	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Actions	29 210 187	–	–	29 210 187
	29 210 187	–	–	29 210 187

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué au cours de la période close le 31 décembre 2023.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

FNB indiciel d'actions américaines Scotia

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux

(en dollars)	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIF		
Actif courant		
Actifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net (note 2)		
Actifs financiers non dérivés	670 027 590	546 080 369
Trésorerie	2 793 249	1 858 966
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	536 966	434 738
Total de l'actif	673 357 805	548 374 073
PASSIF		
Passif courant		
Frais de gestion à payer (note 5)	31 173	26 070
Charges à payer	18 820	15 751
Distributions à verser	2 442 364	1 574 500
Total du passif	2 492 357	1 616 321
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	670 865 448	546 757 752
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, PAR PART	28,43	23,27

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars, sauf le nombre moyen de parts)	2023	2022
REVENUS		
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net		
Dividendes	10 042 801	8 628 687
Intérêts à distribuer	7 405	130
Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	2 566 916	(6 177 664)
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	119 633 570	(81 412 259)
Gain (perte) net sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net	132 250 692	(78 961 106)
Gain (perte) de change net réalisé et latent	(79 474)	86 006
Revenu tiré du prêt de titres	12 294	5 942
Total des revenus (pertes), montant net	132 183 512	(78 869 158)
CHARGES		
Frais de gestion (note 5)	307 334	268 843
Frais d'administration à taux fixe (note 6)	184 401	161 306
Frais du comité d'examen indépendant	1 138	1 115
Retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts	1 403 559	1 220 903
Taxe de vente harmonisée/taxe sur les produits et services	43 518	40 347
Coûts de transactions	1 642	1 815
Total des charges	1 941 592	1 694 329
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités	130 241 920	(80 563 487)
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS, PAR PART†	5,51	(3,59)
NOMBRE MOYEN PONDÉRÉ DE PARTS	23 623 836	22 434 247

† L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités par le nombre moyen pondéré de parts.

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À L'OUVERTURE DE LA PÉRIODE	546 757 752	480 840 429
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES LIÉE AUX ACTIVITÉS	130 241 920	(80 563 487)
DISTRIBUTIONS AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES		
Revenus nets de placement	(8 015 764)	(6 704 673)
Remboursement de capital	–	(10 027)
	(8 015 764)	(6 714 700)
TRANSACTIONS SUR PARTS RACHETABLES		
Produit de l'émission de titres	98 594 390	202 560 530
Paieement au rachat	(96 712 850)	(49 365 020)
	1 881 540	153 195 510
AUGMENTATION (DIMINUTION) DE L'ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES	124 107 696	65 917 323
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES, À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	670 865 448	546 757 752

TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 31 décembre (note 1)

(en dollars)	2023	2022
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS D'EXPLOITATION		
Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	130 241 920	(80 563 487)
Ajustements au titre des éléments suivants :		
(Gain) perte net réalisé sur les actifs financiers non dérivés	(2 566 916)	6 177 664
Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés	(119 633 570)	81 412 259
(Gain) perte de change latent	6 114	261
Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	(29 843 067)	(19 833 963)
Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés*	30 265 201	13 867 935
Revenu de placement à recevoir et autres éléments	(102 228)	(191 926)
Charges à payer et autres montants à payer	8 172	6 319
Flux nets de trésorerie liés aux activités d'exploitation	8 375 626	875 062
FLUX DE TRÉSORERIE LIÉS AUX ACTIVITÉS DE FINANCEMENT		
Produit de l'émission de parts rachetables*	122 827	347 110
Montant payé au rachat de parts rachetables	(410 156)	5 446 170
Distributions aux porteurs de parts rachetables	(7 147 900)	(6 264 700)
Flux nets de trésorerie liés aux activités de financement	(7 435 229)	(471 420)
Gain (perte) de change latent	(6 114)	(261)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	940 397	403 642
Trésorerie (découvert bancaire), à l'ouverture de la période	1 858 966	1 455 585
TRÉSORERIE (DÉCOUVERT BANCAIRE), À LA CLÔTURE DE LA PÉRIODE	2 793 249	1 858 966
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	7 405	130
Dividendes reçus, déduction faite des retenues d'impôts ¹⁾	8 537 193	7 215 859

* Hors opérations en nature, le cas échéant.

1) Classés comme éléments d'exploitation.

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

FNB indiciel d'actions américaines Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 %			
Services de communication – 8,6 %			
Alphabet Inc., cat. A	74 641	11 657 174	13 748 516
Alphabet Inc., cat. C	64 828	10 190 524	12 047 006
AT&T, Inc.	90 182	2 289 065	1 995 377
Charter Communications Inc., cat. A	1 245	925 480	638 079
Comcast Corp., cat. A	51 401	3 257 878	2 972 037
Electronic Arts, Inc.	3 407	582 314	614 615
Fox Corp., cat. A	2 978	136 557	116 508
Fox Corp., cat. B	1 889	81 398	68 872
Meta Platforms, Inc., cat. A	27 665	9 965 320	12 912 131
Netflix, Inc.	5 468	3 317 970	3 510 456
Omnicom Group, Inc.	2 448	235 080	279 248
Pinterest, Inc., cat. A	7 299	425 630	356 490
ROBLOX Corp., cat. A	5 690	401 691	343 030
Sirius XM Holdings, Inc.	8 455	64 744	60 984
Snap Inc., cat. A	12 480	698 955	278 602
Take-Two Interactive Software, Inc.	2 082	403 033	441 860
T-Mobile U.S., Inc.	6 472	1 080 432	1 368 253
Verizon Communications, Inc.	52 794	3 420 169	2 624 454
Walt Disney Co.	22 956	4 353 601	2 733 059
Warner Bros Discovery, Inc.	28 510	842 160	427 812
Warner Music Group Corp., cat. A	1 527	66 721	72 063
	54 395 896		57 609 452

Consommation discrétionnaire – 11,0 %			
Airbnb, Inc.	5 261	987 533	944 424
Amazon.com, Inc.	113 068	21 802 004	22 652 957
Aptiv PLC	3 532	601 063	417 852
AutoZone Inc.	225	518 660	767 112
Best Buy Co., Inc.	2 411	312 452	248 863
Booking Holdings, Inc.	443	1 324 223	2 072 072
Builders FirstSource, Inc.	1 579	309 953	347 581
Carnival Corp.	12 558	292 714	307 003
Chipotle Mexican Grill, Inc.	343	690 591	1 034 346
Coupage, Inc., cat. A	13 907	400 391	296 888
Darden Restaurants, Inc.	1 509	268 843	326 919
DoorDash, Inc., cat. A	3 317	486 265	432 525
DR Horton, Inc.	3 854	449 015	772 345
DraftKings, Inc.	5 267	213 098	244 814
eBay, Inc.	6 641	498 777	381 973
Endeavor Group Holdings, Inc.	958	29 605	29 976
Expedia Group, Inc.	1 790	342 881	358 269
Ford Motor Co.	48 853	908 425	785 250
Garmin Ltd.	1 857	302 319	314 748
General Motors Co.	17 558	1 075 950	831 619
Genuine Parts Co.	1 705	283 520	311 377
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	3 232	551 605	776 016
Home Depot, Inc.	12 626	5 201 811	5 769 587
Las Vegas Sands Corp.	4 094	243 346	265 653
Lennar Corp., cat. A	3 081	381 822	605 491
Lennar Corp., cat. B	125	12 888	22 095
Live Nation Entertainment, Inc.	1 886	221 028	232 772
Lowe's Cos., Inc.	7 343	1 927 051	2 154 836
Lucid Group, Inc.	11 242	283 539	62 408
Lululemon Athletica, Inc.	1 404	643 311	946 559
Marriott International, Inc., cat. A	3 268	651 424	971 764
McDonald's Corp.	9 187	2 871 913	3 591 916
MercadoLibre, Inc.	565	968 374	1 170 811
MGM Resorts International	3 352	172 706	197 483
Mobileye Global, Inc.	1 248	65 255	71 288
NIKE, Inc., cat. B	15 375	2 714 596	2 201 091
NVR, Inc.	38	233 931	350 770
O'Reilly Automotive, Inc.	759	624 463	950 857
Pool Corp.	490	277 493	257 612
PulteGroup, Inc.	2 787	313 859	379 327
Ross Stores, Inc.	4 233	601 531	772 442
Royal Caribbean Cruises Ltée	2 766	384 626	472 282
Sherwin-Williams Co.	2 979	1 035 714	1 225 177
Starbucks Corp.	14 063	1 866 093	1 780 359
Tesla, Inc.	34 517	11 529 059	11 309 348
TJX Cos., Inc.	14 505	1 328 830	1 794 238
Tractor Supply Co.	1 376	347 911	390 149
Ulta Beauty, Inc.	612	292 826	395 414
Yum China Holdings, Inc.	4 983	355 363	278 790
Yum! Brands, Inc.	3 515	542 486	605 593
	68 743 136		73 881 041

Consommation de base – 5,9 %			
Albertsons Cos., Inc., cat. A	5 052	156 123	153 216
Altria Group, Inc.	22 404	1 337 434	1 191 721
Archer-Daniels-Midland Co.	6 683	580 166	636 417
Brown-Forman Corp., cat. A	534	42 775	41 959
Brown-Forman Corp., cat. B	3 775	337 879	284 228
Bunge Global SA	1 823	268 407	242 664
Campbell Soup Co.	2 488	159 017	141 824
Church & Dwight Co., Inc.	3 068	350 361	382 539
Clorox Co.	1 532	327 316	288 045
Coca-Cola Co.	48 892	3 546 822	3 799 158
Colgate-Palmolive Co.	10 332	1 037 753	1 085 951
Conagra Brands, Inc.	5 898	258 376	222 892
Constellation Brands, Inc., cat. A	1 961	580 379	625 111
Costco Wholesale Corp.	5 558	3 307 959	4 837 580

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Consommation de base – 5,9 % (suite)			
Dollar General Corp.	2 758	733 121	494 409
Dollar Tree, Inc.	2 604	412 138	487 748
Estée Lauder Cos., Inc., cat. A	2 725	965 952	525 503
General Mills, Inc.	7 358	610 742	632 005
Hershey Co.	1 840	445 996	452 345
Hormel Foods Corp.	3 538	206 991	149 800
J M Smucker Co.	1 250	250 758	208 306
Kellanova	3 242	262 950	239 010
Keurig Dr Pepper, Inc.	11 503	511 662	505 393
Kimberly-Clark Corp.	4 270	728 005	684 153
Kraft Heinz Co.	10 046	478 359	489 861
Kroger Co.	8 979	493 434	541 193
McCormick & Co., Inc., sans droit de vote	3 069	342 912	276 881
Mondelez International, Inc., cat. A	17 042	1 359 949	1 627 617
Monster Beverage Corp.	6 430	380 471	488 452
PepsiCo, Inc.	17 284	3 529 398	3 870 770
Philip Morris International, Inc.	19 544	2 378 470	2 424 509
Procter & Gamble Co.	29 640	5 468 784	5 727 267
Sysco Corp.	6 436	633 685	620 618
Target Corp.	5 835	1 484 248	1 095 784
Tyson Foods, Inc., cat. A	3 540	337 350	250 897
Walgreens Boots Alliance, Inc.	8 972	512 278	308 894
Walmart, Inc.	17 847	3 282 187	3 709 986
	38 100 607		39 744 706

Énergie – 4,0 %			
Baker Hughes Co.	12 675	452 270	571 259
Cheniere Energy, Inc.	3 013	441 228	678 221
Chevron Corp.	21 816	3 492 039	4 290 823
ConocoPhillips	15 209	1 496 162	2 327 736
Coterra Energy, Inc.	9 321	378 532	313 658
Devon Energy Corp.	8 069	490 835	481 982
Diamondback Energy, Inc.	2 152	370 132	440 059
DTE Energy Co.	2 545	372 500	370 015
Entergy Corp.	2 685	360 748	358 257
EOG Resources, Inc.	7 312	870 485	1 166 152
EQT Corp.	5 282	289 072	269 261
Exxon Mobil Corp.	50 780	4 702 242	6 694 512
Halliburton Co.	11 450	403 660	545 792
Hess Corp.	3 472	410 199	659 990
Kinder Morgan, Inc.	24 542	528 454	570 849
Marathon Oil Corp.	7 699	276 382	245 270
Marathon Petroleum Corp.	4 985	484 063	975 203
Occidental Petroleum Corp.	8 751	451 233	688 998
ONEOK, Inc.	7 222	558 663	668 700
Phillips 66	5 540	604 454	972 593
Pioneer Natural Resources Co.	2 954	721 131	875 940
Schlumberger NV	17 967	835 972	1 232 894
Targa Resources Corp.	2 772	279 417	317 524
Valero Energy Corp.	4 377	481 412	750 297
Williams Cos., Inc.	15 095	539 280	693 266
	20 290 565		27 159 251

Finance – 12,7 %			
Aflac, Inc.	6 725	501 027	731 576
Allstate Corp.	3 326	519 098	613 905
American Express Co.	7 442	1 510 185	1 838 371
American International Group, Inc.	8 849	604 401	790 527
Ameriprise Financial, Inc.	1 307	460 764	654 603
Aon PLC, cat. A	2 558	908 419	981 604
Apollo Global Management, Inc.	5 072	438 932	623 249
Arch Capital Group Ltd.	4 434	265 879	434 232
ARES Management Corp.	1 883	206 834	295 269
Arthur J Gallagher & Co.	2 661	549 740	789 058
Bank of America Corp.	87 284	4 253 189	3 875 171
Bank of New York Mellon Corp.	9 353	588 644	641 926
Berkshire Hathaway Inc., cat. B	16 226	6 069 695	7 630 956
BlackRock, Inc., cat. A	1 871	1 839 757	2 002 792
Blackstone, Inc., cat. A	8 867	1 161 909	1 530 720
Blue Owl Capital, Inc.	5 255	84 543	103 246
Brown & Brown, Inc.	3 040	232 940	285 048
Capital One Financial Corp.	4 789	806 835	827 993
Cboe Global Markets, Inc.	1 290	296 895	303 729
Charles Schwab Corp.	17 432	1 591 186	1 581 425
Chubb Ltd.	5 189	1 244 456	1 546 341
Cincinnati Financial Corp.	1 888	267 423	257 565
Citigroup, Inc.	23 889	1 858 738	1 620 362
Citizens Financial Group, Inc.	6 099	329 315	366 517
CME Group Inc.	4 527	1 197 787	1 257 135
Coinbase Global, Inc., cat. A	1 988	247 397	455 910
Discover Financial Services	3 072	428 307	455 303
Everest Group Ltd.	405	208 903	188 823
Fidelity National Information Services, Inc.	7 555	1 052 136	598 419
Fifth Third Bancorp	8 345	399 853	379 518
First Citizens BancShares, Inc.	128	242 651	239 495
Fiserv, Inc.	7 644	1 074 257	1 338 945
FleetCor Technologies, Inc.	920	291 860	342 838
Franklin Resources, Inc.	3 657	136 807	143 651
Global Payments, Inc.	3 295	653 300	551 788
Goldman Sachs Group, Inc.	4 155	1 845 021	2 113 550
Hartford Financial Services Group, Inc.	3 763	316 021	398 837

FNB indiciel d'actions américaines Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Finance – 12,7 % (suite)			
Huntington Bancshares, Inc.	18 069	333 127	303 064
Interactive Brokers Group, Inc., cat. A	1 217	114 151	133 033
Intercontinental Exchange, Inc.	6 903	1 038 214	1 169 008
JPMorgan Chase & Co.	36 422	6 851 690	8 169 231
KKR & Co., Inc.	8 064	589 825	880 960
Loews Corp.	2 290	163 559	210 134
LPL Financial Holdings, Inc.	953	272 141	286 033
M&T Bank Corp.	2 079	414 549	375 787
Markel Group, Inc.	171	281 490	320 160
Marsh & McLennan Cos., Inc.	6 236	1 217 794	1 557 972
Mastercard, Inc., cat. A	10 551	4 847 179	5 933 841
MetLife, Inc.	7 844	614 470	683 989
Moody's Corp.	1 979	838 531	1 019 170
Morgan Stanley	16 270	1 846 707	2 000 550
MSCI, Inc.	970	640 615	723 490
Nasdaq, Inc.	4 248	309 573	325 666
Northern Trust Corp.	2 693	351 444	299 633
PayPal Holdings, Inc.	13 681	3 267 033	1 107 822
PNC Financial Services Group, Inc.	4 959	1 116 244	1 012 554
Principal Financial Group, Inc.	3 101	267 800	321 680
Progressive Corp.	7 301	1 000 954	1 533 404
Prudential Financial, Inc.	4 614	589 213	630 974
Raymond James Financial, Inc.	2 360	292 217	346 976
Regions Financial Corp.	11 428	303 415	292 036
Rocket Cos., Inc., cat. A	1 555	30 518	29 690
S&P Global, Inc.	4 024	1 996 683	2 337 420
State Street Corp.	3 916	413 933	399 975
Synchrony Financial	5 436	283 700	273 742
T Rowe Price Group, Inc.	2 717	564 716	385 814
Tradeweb Markets Inc., cat. A	1 406	142 668	168 487
Travelers Cos., Inc.	2 885	589 526	724 655
Truist Financial Corp.	16 844	1 134 712	820 012
U.S. Bancorp	18 677	1 181 819	1 065 878
Visa Inc., cat. A	20 321	5 730 648	6 976 149
W R Berkley Corp.	2 484	203 628	231 636
Wells Fargo & Co.	45 833	2 608 626	2 974 630
Willis Towers Watson PLC	1 317	382 447	418 867
	77 510 663		85 134 519

Soins de santé – 12,7 %			
Abbott Laboratories	21 807	3 269 730	3 165 031
AbbVie, Inc.	22 200	3 643 842	4 536 424
Agilent Technologies, Inc.	3 675	649 289	673 719
Align Technology, Inc.	896	578 454	323 722
Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	1 586	341 243	400 296
Amgen, Inc.	6 669	2 023 772	2 532 774
Avantor, Inc.	8 409	346 552	253 142
Baxter International, Inc.	6 288	584 998	320 544
Becton Dickinson & Co.	3 637	1 161 765	1 169 347
Biogen, Inc.	1 797	611 178	613 162
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	2 358	255 198	299 795
Bio-Rad Laboratories, Inc., cat. A	249	191 505	106 015
Boston Scientific Corp.	18 297	1 010 290	1 394 749
Bristol-Myers Squibb Co.	26 415	2 190 318	1 787 169
Cardinal Health, Inc.	3 138	328 712	417 087
Cencora, Inc.	2 133	375 280	577 646
Centene Corp.	6 822	626 511	667 555
Cigna Group	3 684	1 132 473	1 454 645
Cooper Cos., Inc.	604	294 232	301 403
CVS Health Corp.	16 001	1 764 116	1 665 971
Danaher Corp.	8 310	2 548 997	2 534 923
Dexcom, Inc.	4 853	679 359	794 072
Edwards Lifesciences Corp.	7 581	956 680	762 218
Elevance Health, Inc.	2 982	1 567 102	1 854 205
Eli Lilly & Co.	10 626	3 852 936	8 167 551
GE HealthCare Technologies, Inc.	4 489	355 112	457 672
Gilead Sciences, Inc.	15 597	1 372 409	1 666 068
HCA Healthcare, Inc.	2 606	751 142	930 130
Hologic, Inc.	3 098	290 543	291 875
Humana, Inc.	1 576	890 465	951 381
IDEXX Laboratories, Inc.	1 039	711 211	760 433
Illumina, Inc.	1 973	876 088	362 246
Incyte Corp.	2 359	227 341	195 313
Insulet Corp.	836	276 087	239 188
Intuitive Surgical, Inc.	4 364	1 620 174	1 941 294
IQVIA Holdings, Inc.	2 290	660 956	698 674
Johnson & Johnson	30 242	6 431 347	6 250 337
Kenvue, Inc.	21 509	578 560	610 629
Laboratory Corp. of America Holdings	1 122	367 706	336 269
McKesson Corp.	1 686	552 550	1 029 278
Medtronic PLC	16 632	2 304 119	1 806 672
Merck & Co., Inc.	31 864	3 427 769	4 580 570
Mettler-Toledo International, Inc.	271	470 931	433 440
Moderna, Inc.	4 134	1 050 048	542 111
Molina Healthcare, Inc.	719	290 230	342 548
Pfizer, Inc.	71 120	3 970 580	2 699 893
Quest Diagnostics, Inc.	1 453	255 008	264 168
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	1 300	1 037 238	1 505 547
ResMed, Inc.	1 780	515 086	403 750
Revvity, Inc.	1 601	318 261	230 762
Royalty Pharma plc, cat. A	4 581	234 495	169 678

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Soins de santé – 12,7 % (suite)			
STERIS PLC	1 207	327 241	349 902
Stryker Corp.	3 973	1 297 171	1 568 810
Thermo Fisher Scientific, Inc.	4 848	3 351 006	3 393 114
UnitedHealth Group, Inc.	11 657	6 581 811	8 092 328
Veeva Systems Inc., cat. A	1 849	592 860	469 381
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	3 247	1 013 010	1 742 097
Viatri, Inc.	15 109	261 251	215 763
Waters Corp.	735	301 655	319 080
West Pharmaceutical Services, Inc.	927	424 274	430 411
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	2 596	451 169	416 590
Zoetis, Inc.	5 804	1 370 451	1 510 503
	76 791 887		84 981 070

Industrie – 9,0 %			
3M Co.	6 879	1 430 742	991 603
AMETEK, Inc.	2 922	502 803	635 313
Automatic Data Processing, Inc.	5 172	1 393 013	1 588 809
Axon Enterprise, Inc.	873	263 310	297 373
Boeing Co.	6 991	1 867 998	2 402 851
Broadridge Financial Solutions, Inc.	1 456	293 883	395 016
Carlisle Cos., Inc.	637	205 626	262 425
Carrier Global Corp.	10 409	624 610	788 519
Caterpillar, Inc.	6 454	1 774 498	2 516 224
Cintas Corp.	1 095	569 399	870 161
Copart, Inc.	10 629	468 079	686 755
CoStar Group, Inc.	5 069	520 310	584 113
CSX Corp.	25 291	1 053 779	1 156 200
Cummins, Inc.	1 800	536 717	568 615
Deere & Co.	3 401	1 563 353	1 793 240
Delta Air Lines, Inc.	8 025	414 720	425 704
Dover Corp.	1 765	338 037	357 966
Eaton Corp. PLC	4 956	991 214	1 573 754
Emerson Electric Co.	7 082	833 146	908 899
Equifax, Inc.	1 508	428 270	491 724
Expeditors International of Washington, Inc.	1 804	259 214	302 578
Fastenal Co.	7 079	484 763	604 587
FedEx Corp.	2 877	918 180	959 670
Ferguson PLC	2 393	469 108	609 215
First Solar, Inc.	1 257	261 196	285 551
Fortive Corp.	4 399	394 751	427 092
General Dynamics Corp.	2 831	731 631	969 337
General Electric Co.	13 643	1 409 953	2 296 020
HEICO Corp.	558	105 367	131 609
HEICO Corp., cat. A	944	148 324	177 303
Honeywell International, Inc.	8 345	2 208 171	2 307 589
Howmet Aerospace, Inc.	5 215	290 835	372 156
Hubbell, Inc.	671	280 602	291 031
IDEX Corp.	944	256 077	270 250
Illinois Tool Works, Inc.	3 837	1 103 488	1 325 277
Ingersoll Rand, Inc.	5 096	347 145	519 693
Jacobs Solutions, Inc.	1 560	256 765	267 001
JB Hunt Transport Services, Inc.	997	223 924	262 587
Johnson Controls International PLC	8 535	698 882	648 695
L3Harris Technologies, Inc.	2 370	641 687	658 205
Lennox International Inc.	413	161 720	243 711
Lockheed Martin Corp.	3 181	1 604 913	1 901 100
Nordson Corp.	663	194 269	230 937
Norfolk Southern Corp.	2 828	921 776	881 461
Northrop Grumman Corp.	1 915	965 132	1 182 109
Old Dominion Freight Line, Inc.	1 185	442 302	633 345
ON Semiconductor Corp.	5 347	447 693	588 933
Otis Worldwide Corp.	5 171	518 316	610 049
PACCAR, Inc.	6 526	536 627	840 296
Parker-Hannifin Corp.	1 619	646 437	983 509
Paychex, Inc.	4 012	575 012	630 118
Quanta Services, Inc.	1 840	315 694	523 579
Republic Services, Inc.	2 596	402 903	564 501
Rivian Automotive, Inc., cat. A	8 129	359 142	251 465
Rockwell Automation, Inc.	1 416	515 244	579 709
Rollins, Inc.	3 794	180 875	218 471
Roper Technologies, Inc.	1 327	763 928	953 929
RTX Corp.	18 344	1 997 999	2 035 212
Southwest Airlines Co.	7 310	426 148	278 373
Stanley Black & Decker, Inc.	1 840	377 011	238 013
Teledyne Technologies, Inc.	597	320 405	351 321
Trane Technologies PLC	2 871	640 228	923 332
TransDigm Group, Inc.	654	552 039	872 368
TransUnion	2 360	290 643	213 818
Uber Technologies, Inc.	24 404	1 241 532	1 981 268
Union Pacific Corp.	7 676	2 185 052	2 486 061
United Airlines Holdings, Inc.	3 907	231 549	212 562
United Parcel Service, Inc., cat. B	9 123	2 199 724	1 891 412
United Rentals, Inc.	859	369 938	649 500
Verisk Analytics, Inc.	1 806	456 694	568 819
Waste Management, Inc.	5 104	955 879	1 205 367
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	2 297	266 854	384 358
W.W. Grainger, Inc.	509	317 870	556 190
Xylem, Inc.	2 998	421 299	452 084
	50 366 417		60 097 990

FNB indiciel d'actions américaines Scotia

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Technologies de l'information – 29,4 %			
Accenture PLC, cat. A	8 365	3 313 720	3 870 569
Adobe, Inc.	5 728	3 760 045	4 506 085
Advanced Micro Devices, Inc.	20 118	2 580 020	3 910 433
Akamai Technologies, Inc.	1 889	256 555	294 790
Amdocs Ltd.	1 567	186 214	181 602
Amphenol Corp., cat. A	7 419	704 939	969 758
Analog Devices, Inc.	6 301	1 323 815	1 649 736
ANSYS, Inc.	1 064	454 800	509 117
Apple, Inc.	186 082	36 033 791	47 240 648
Applied Materials, Inc.	10 482	1 709 673	2 240 061
Arista Networks, Inc.	2 951	421 692	916 414
Aspen Technology, Inc.	360	111 674	104 504
Atlassian Corp., cat. A	1 937	662 071	607 525
Autodesk, Inc.	2 659	881 635	853 679
Bentley Systems, Inc., cat. B	2 544	164 610	175 039
Block, Inc., cat. A	6 911	1 271 650	704 879
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	1 576	270 835	265 812
Broadcom, Inc.	5 073	3 872 503	7 466 884
Cadence Design Systems, Inc.	3 395	701 978	1 219 304
CDW Corp.	1 662	378 915	498 175
Cisco Systems, Inc.	51 325	3 417 704	3 419 049
Cloudflare, Inc., cat. A	3 621	411 819	397 537
Cognizant Technology Solutions Corp., cat. A	6 355	617 377	632 919
Corning, Inc.	9 635	455 827	386 858
CrowdStrike Holdings, Inc., cat. A	2 760	707 894	929 195
Datadog, Inc., cat. A	3 620	521 765	579 387
Dell Technologies Inc., cat. C	3 111	284 892	313 816
Enphase Energy, Inc.	1 639	394 288	285 579
EPAM Systems, Inc.	694	385 876	272 098
FactSet Research Systems, Inc.	466	257 384	293 132
Fair Isaac Corp.	306	307 207	469 668
Fortinet, Inc.	8 538	585 500	658 943
Gartner, Inc.	963	332 270	572 825
GLOBALFOUNDRIES, Inc.	967	69 715	77 270
Hewlett Packard Enterprise Co.	16 162	312 832	361 864
HP, Inc.	12 484	491 243	495 324
HubSpot, Inc.	597	385 753	457 004
Intel Corp.	52 560	3 230 169	3 482 607
International Business Machines Corp.	11 411	1 949 000	2 460 862
Intuit, Inc.	3 429	2 140 228	2 826 060
Jabil, Inc.	1 566	173 036	263 072
Keysight Technologies Inc.	2 202	447 808	461 927
KLA Corp.	1 733	800 389	1 328 348
Lam Research Corp.	1 677	1 240 043	1 732 017
Marvell Technology, Inc.	10 880	815 336	865 229
Microchip Technology, Inc.	6 675	648 500	793 733
Micron Technology, Inc.	13 612	1 335 492	1 531 749
Microsoft Corp.	92 116	33 234 235	45 675 382
MongoDB, Inc.	860	405 213	463 634
Monolithic Power Systems, Inc.	577	366 837	479 918
Motorola Solutions, Inc.	2 109	624 006	870 681
NetApp, Inc.	2 695	268 723	313 288
NVIDIA Corp.	29 798	8 750 921	19 458 007
Okta, Inc.	1 836	450 625	219 169
Oracle Corp.	19 584	2 093 454	2 722 568
Palantir Technologies, Inc.	22 623	491 168	512 193
Palo Alto Networks, Inc.	3 806	804 094	1 479 882
Paycom Software, Inc.	628	299 016	171 181
PTC, Inc.	1 437	277 326	331 519
QUALCOMM, Inc.	14 009	2 582 344	2 671 644
Salesforce, Inc.	11 812	3 385 988	4 098 485
Seagate Technology Holdings PLC	2 405	255 030	270 728
ServiceNow, Inc.	2 564	1 804 235	2 388 565
Skyworks Solutions, Inc.	1 968	375 542	291 730
Snowflake Inc., cat. A	3 466	1 040 039	909 483
Splunk, Inc.	1 882	321 969	378 073
Spotify Technology SA	1 686	447 805	417 754
SS&C Technologies Holdings, Inc.	2 831	251 302	228 121
Synopsys, Inc.	1 888	767 079	1 281 877
TE Connectivity Ltd.	3 910	680 890	724 380
Teradyne, Inc.	1 895	293 567	271 164
Texas Instruments, Inc.	11 391	2 591 338	2 560 339
Trade Desk, Inc.	5 543	520 069	525 956
Trimble, Inc.	3 074	286 060	215 640
Tyler Technologies, Inc.	511	281 923	281 731
VeriSign Inc.	1 130	307 294	306 884
Western Digital Corp.	4 165	293 582	287 614
Workday, Inc., cat. A	2 564	759 290	933 329
Zebra Technologies Corp., cat. A	639	357 630	230 304
Zoom Video Communications, Inc., cat. A	3 140	807 076	297 736
Zscaler, Inc.	1 121	301 250	327 499
	148 557 402	197 129 544	
Matériaux – 2,2 %			
Air Products and Chemicals, Inc.	2 755	979 402	994 645
Albemarle Corp.	1 434	373 599	273 193
Amcor PLC	18 407	270 810	233 977
Avery Dennison Corp.	1 023	235 007	272 699
Ball Corp.	4 011	417 469	304 218
Celanese Corp.	1 399	257 997	286 614
CF Industries Holdings, Inc.	2 467	309 911	258 612

Émetteur	Nombre d'actions	Coût moyen (\$)	Valeur comptable (\$)
ACTIONS – 99,9 % (suite)			
Matériaux – 2,2 % (suite)			
Corteva, Inc.	9 048	562 479	571 719
CRH PLC	8 586	676 653	782 995
Dow Inc.	9 010	669 802	651 531
DuPont de Nemours, Inc.	5 257	498 038	533 270
Ecolab, Inc.	3 211	820 860	839 819
Freeport-McMoRan, Inc.	17 782	840 496	998 154
International Flavors & Fragrances, Inc.	3 161	513 163	337 491
Linde PLC	6 139	2 421 048	3 324 650
LyondellBasell Industries NV, cat. A	3 127	385 747	392 040
Martin Marietta Materials, Inc.	772	360 075	507 870
Mosaic Co.	4 281	329 701	201 693
Newmont Corp.	9 915	732 146	541 130
Nucor Corp.	3 117	433 942	715 318
PPG Industries, Inc.	2 916	554 005	575 025
Southern Copper Corp.	1 135	99 584	128 813
Steel Dynamics, Inc.	1 941	320 194	302 265
Vulcan Materials Co.	1 652	382 182	494 502
Westlake Corp.	366	59 107	67 546
	13 503 417		14 589 789
Immobilier – 2,3 %			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	2 186	479 052	365 409
American Tower Corp.	5 865	1 814 648	1 669 527
AvalonBay Communities, Inc.	1 788	470 879	441 401
Camden Property Trust	1 311	222 406	171 641
CBRE Group, Inc., cat. A	3 861	423 779	473 932
Crown Castle, Inc.	5 370	1 146 351	815 647
Digital Realty Trust, Inc.	3 843	691 283	681 968
Equinix, Inc.	1 180	1 126 029	1 253 145
Equity Residential	4 744	453 610	382 583
Essex Property Trust, Inc.	816	301 468	266 778
Extra Space Storage, Inc.	2 618	521 213	553 474
Healthpeak Properties, Inc.	6 626	259 567	172 994
Invitation Homes, Inc.	7 017	326 293	315 607
Iron Mountain, Inc.	3 555	294 596	328 040
Mid-America Apartment Communities, Inc.	1 416	312 053	251 055
NET Lease Office Properties	169	2 912	4 118
Prologis, Inc.	11 592	1 833 254	2 037 519
Public Storage	1 995	769 654	802 335
Realty Income Corp.	8 895	742 035	673 476
SBA Communications Corp.	1 327	514 312	443 902
Simon Property Group, Inc.	4 020	640 046	756 102
Sun Communities, Inc.	1 540	325 829	271 396
UDR, Inc.	4 005	248 659	202 209
Ventas, Inc.	5 124	337 364	336 744
VICI Properties Inc.	12 705	506 091	534 080
Welltower, Inc.	6 509	668 139	773 908
Weyerhaeuser Co.	9 297	422 380	426 246
WP Carey, Inc.	2 557	272 278	218 517
	16 126 180		15 623 753
Services aux collectivités – 2,1 %			
Alliant Energy Corp.	3 068	218 446	207 532
Ameren Corp.	3 201	341 999	305 535
American Electric Power Co., Inc.	6 419	715 320	687 454
American Water Works Co., Inc.	2 470	497 546	429 884
Atmos Energy Corp.	1 863	286 628	284 714
Avangrid, Inc.	836	49 696	35 727
CenterPoint Energy, Inc.	7 761	306 675	292 376
CMS Energy Corp.	3 531	277 401	270 373
Consolidated Edison, Inc.	4 371	454 940	524 315
Constellation Energy Corp.	4 046	281 302	623 615
Dominion Energy, Inc.	10 329	952 006	640 131
Duke Energy Corp.	9 621	1 220 168	1 231 074
Edison International	4 719	374 665	444 845
Evergy, Inc.	2 831	221 986	194 860
Eversource Energy	4 240	449 295	345 068
Exelon Corp.	12 574	596 480	595 225
FirstEnergy Corp.	6 692	325 165	323 490
NextEra Energy, Inc.	25 393	2 540 246	2 033 770
PG&E Corp.	31 118	591 389	739 810
PPL Corp.	8 946	321 898	319 677
Public Service Enterprise Group, Inc.	6 130	487 098	494 277
Sempra	7 976	701 876	785 947
Southern Co.	13 706	1 151 516	1 267 260
WEC Energy Group, Inc.	3 861	546 703	428 519
Xcel Energy, Inc.	6 997	594 653	571 197
	14 413 097		14 076 475
TOTAL DES ACTIONS	578 799 267		670 027 590
COÛTS DE TRANSACTIONS		(1 555)	–
TOTAL DU PORTEFEUILLE DE PLACEMENTS	578 797 712		670 027 590
AUTRES ACTIFS, MOINS LES PASSIFS – 0,1 %			837 858
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES – 100,0 %			670 865 448

FNB indiciel d'actions américaines Scotia

NOTES PROPRES AU FONDS

Pour les périodes indiquées à la note 1

Le Fonds (note 1)

L'objectif de placement du Fonds consiste à reproduire, dans la mesure du possible et avant déduction des frais, le rendement d'un indice général d'actions américaines qui suit les rendements d'actions américaines à grande capitalisation cotées en bourse.

Le Fonds peut également investir une partie de ses actifs dans des fonds gérés par le gestionnaire et/ou par d'autres gestionnaires de placements (les « fonds sous-jacents »). Outre les risques décrits ci-dessous, le Fonds peut être indirectement exposé au risque dans la mesure où les fonds sous-jacents détiennent des instruments financiers exposés aux risques ci-dessous.

Risques associés aux instruments financiers (note 4)

Risque de taux d'intérêt

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, la majorité des instruments financiers du Fonds ne portaient pas intérêt. Par conséquent, le Fonds n'était pas directement exposé à des risques importants attribuables aux fluctuations des taux d'intérêt du marché.

Risque de change

Ci-dessous, un résumé de l'exposition directe du Fonds au risque de change. Les montants indiqués sont fondés sur la valeur comptable des actifs et des passifs monétaires et non monétaires du Fonds, déduction faite de la valeur des contrats de change et des positions vendeur, le cas échéant.

31 décembre 2023				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	670 863 686	–	670 863 686	100,0
Couronne danoise	179	–	179	0,0
	670 863 865	–	670 863 865	100,0

31 décembre 2022				
Devise	Exposition brute au risque de change (\$)	Contrats de change (\$)	Exposition nette au risque de change (\$)	Pourcentage de l'actif net (%)
Dollar américain	546 760 990	–	546 760 990	100,0
	546 760 990	–	546 760 990	100,0

Au 31 décembre 2023, si le dollar canadien avait fluctué de 10 % par rapport aux autres devises, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté de 67 086 000 \$, ou environ 10,0 % de l'actif net (54 676 000 \$, ou environ 10,0 % au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de prix

Au 31 décembre 2023, une tranche d'environ 99,9 % (99,9 % au 31 décembre 2022) de l'actif net du Fonds était directement exposée au risque de prix. Si les cours de ces instruments avaient fluctué de 10 %, toutes les autres variables demeurant constantes, l'actif net

attribuable aux porteurs de parts rachetables du Fonds aurait diminué ou augmenté d'environ 67 003 000 \$ (54 608 000 \$ au 31 décembre 2022). Dans les faits, les résultats réels peuvent différer de ceux de cette analyse de sensibilité, et la différence peut être importante.

Risque de crédit

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait aucune exposition directe importante aux obligations, aux débetures, aux instruments du marché monétaire et aux actions privilégiées.

Risque de concentration

Ci-dessous, un résumé du risque de concentration du Fonds selon la valeur comptable en pourcentage de l'actif net.

	31 décembre 2023	31 décembre 2022
ACTIONS	99,9	99,9
Services de communication	8,6	7,3
Consommation discrétionnaire	11,0	9,9
Consommation de base	5,9	7,0
Énergie	4,0	5,5
Finance	12,7	11,2
Soins de santé	12,7	16,0
Industrie	9,0	8,7
Technologies de l'information	29,4	26,5
Matériaux	2,2	2,3
Immobilier	2,3	2,6
Services aux collectivités	2,1	2,9
TRÉSORERIE ET INSTRUMENTS À COURT TERME (DÉCOUVERT BANCAIRE)	0,4	0,3

Classement selon la hiérarchie des justes valeurs (note 2)

Ci-dessous, un résumé du classement des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie des justes valeurs.

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2023				
Actions	670 027 590	–	–	670 027 590
	670 027 590	–	–	670 027 590

	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
31 décembre 2022				
Actions	546 080 369	–	–	546 080 369
	546 080 369	–	–	546 080 369

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert important entre le niveau 1 et le niveau 2 n'a été effectué pendant les périodes closes le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

Compensation des actifs et des passifs financiers (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds n'avait conclu aucune entente selon laquelle les instruments financiers peuvent faire l'objet d'une compensation.

Participation dans l'actif des fonds sous-jacents (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, le Fonds ne détenait aucune participation dans des fonds sous-jacents.

Comparaison de la valeur liquidative par part et de l'actif net par part (note 2)

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, il n'y avait aucune différence importante entre la valeur liquidative par part et l'actif net par part de toutes les séries du Fonds.

NOTES ANNEXES

Pour la période indiquée à la note 1

1. Les Fonds

Gestion d'actifs 1832 S.E.C., filiale en propriété exclusive de La Banque de Nouvelle-Écosse (la « Banque Scotia »), est le gestionnaire et le fiduciaire des FNB Scotia (collectivement, les « Fonds », ou individuellement, un « Fonds »). Dans le présent document, les termes « nous », « notre », « nos », le « gestionnaire », le « fiduciaire » et « Gestion d'actifs 1832 » désignent Gestion d'actifs 1832 S.E.C. Le siège social des Fonds est le situé au 40 Temperance Street, 16th Floor, Toronto (Ontario) M5H 0B4.

Les Fonds faisant l'objet des présents états financiers sont des fonds négociés en bourse constitués sous le régime des lois de la province d'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie datée du 18 mai 2018.

Le gestionnaire a retenu les services de Conseillers en gestion globale State Street (« CSS Canada ») à titre de sous-conseiller des Fonds. State Street Trust Company Canada est le dépositaire des Fonds, ainsi que l'agent des transferts et l'agent chargé de la tenue des registres. State Street Bank and Trust Company fournit également des services de comptabilité aux Fonds et peut assurer les fonctions d'agent de prêt de titres.

Les états de la situation financière de chacun des Fonds sont présentés aux 31 décembre 2023 et 2022, et les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables et les tableaux des flux de trésorerie portent sur les exercices clos les 31 décembre 2023 et 2022, à l'exception des Fonds établis pendant l'une ou l'autre de ces périodes, pour lesquels l'information est présentée pour la période allant de la date d'établissement du Fonds aux 31 décembre 2023 ou 2022, selon le cas. L'inventaire du portefeuille de chaque Fonds est établi au 31 décembre 2023. Dans ce document, les termes « période » et « périodes » désignent la ou les période(s) de présentation de l'information décrite(s) ci-dessus.

Les présents états financiers ont été approuvés par le conseil d'administration de Gestion d'actifs 1832 Inc., S.E.N.C., à titre de commandité et au nom de Gestion d'actifs 1832 S.E.C., en sa capacité de fiduciaire des Fonds. Leur publication a été autorisée le 7 mars 2024.

Les objectifs de placement des Fonds sont présentés dans les « Notes propres au Fonds » de chaque Fonds. La date d'établissement de chaque Fonds figure ci-dessous :

Fonds	Date d'établissement
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	29 octobre 2020
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	29 octobre 2020
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	27 septembre 2022
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	29 octobre 2020
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	4 janvier 2022
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	4 janvier 2022
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	4 janvier 2022
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	4 janvier 2022
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	29 octobre 2020

Chaque Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de catégories ou de séries de parts rachetables et cessibles. Chaque part d'un

Fonds représente une participation indivise dans l'actif net de celui-ci (les « parts »). Les parts des Fonds sont inscrites à la cote de la Bourse Neo Inc. Les Fonds émettent généralement les parts directement aux courtiers désignés. Scotia Capitaux Inc., société affiliée du gestionnaire, est le courtier désigné des Fonds.

2. Résumé des informations significatives sur les méthodes comptables

Les informations significatives sur les méthodes comptables utilisées pour établir les présents états financiers sont décrites ci-après. Sauf indication contraire, elles ont été appliquées uniformément à la période présentée.

(a) Règles comptables

Les présents états financiers annuels des Fonds ont été préparés conformément aux normes IFRS de comptabilité.

La préparation des présents états financiers conformément aux normes IFRS de comptabilité exige de la direction qu'elle exerce un jugement dans l'application des méthodes comptables, dans l'établissement d'estimations et dans la formulation d'hypothèses sur l'avenir. Les jugements et les estimations comptables importants du gestionnaire sont présentés à la note 3.

(b) Instruments financiers

Classement

Les placements des Fonds, y compris les instruments dérivés, sont classés à la juste valeur par le biais du résultat net. Le classement des placements se fait en fonction du modèle économique adopté par les Fonds pour gérer leurs placements, ainsi que des caractéristiques de leurs flux de trésorerie contractuels. Le portefeuille est géré et la performance est évaluée en fonction de la juste valeur. Les Fonds s'intéressent essentiellement à l'évolution de la juste valeur et utilisent cette donnée pour évaluer la performance et prendre des décisions. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance des Fonds se composent généralement de capital et d'intérêts. Or, la perception des flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à l'atteinte de l'objectif du modèle économique des Fonds. Tous les placements sont donc évalués à la juste valeur par le biais du résultat net.

Les instruments dérivés comprennent les bons de souscription, les swaps, les options, les contrats à terme normalisés et les contrats de change à terme. Les contrats dérivés ayant une juste valeur négative sont classés comme des passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net.

Par conséquent, les Fonds comptabilisent tous les placements et les instruments dérivés comme des actifs ou des passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat net.

Les montants à recevoir pour la vente de titres, les souscriptions à recevoir, les revenus de placement à recevoir et les autres éléments sont évalués au coût amorti.

Tous les autres passifs financiers, autres que ceux classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net, sont évalués au coût amorti.

Les achats et les ventes normalisés de placements sont comptabilisés à la juste valeur à la date à laquelle les Fonds effectuent la transaction. Les coûts de transactions sont passés en charges à l'état du résultat global à mesure qu'ils sont engagés. La juste valeur des actifs et passifs financiers comptabilisés à la juste valeur par le biais du résultat net est évaluée selon la méthode présentée ci-dessous. Les gains et les pertes résultant des variations de la juste valeur sont présentés dans l'état du résultat global pour la période au cours de laquelle ils se produisent.

(c) Évaluation de la juste valeur et hiérarchie des justes valeurs des instruments financiers

La juste valeur d'un instrument financier s'entend du prix qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif dans une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation (la valeur de sortie). La juste valeur des actifs et passifs financiers négociés sur des marchés actifs (comme les instruments dérivés et les titres négociables cotés) est fondée sur le cours de clôture à la date de présentation de l'information financière. Les Fonds utilisent le dernier cours pour les actifs et les 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 faits et circonstances en cause.

La juste valeur des actifs et des passifs financiers qui ne sont pas négociés sur un marché actif, y compris les instruments dérivés hors cote, est déterminée au moyen de techniques d'évaluation. Les Fonds utilisent diverses méthodes et posent des hypothèses qui reposent sur les conditions qui prévalent sur le marché à chaque date de présentation de l'information financière. Les techniques d'évaluation comprennent l'utilisation de transactions récentes comparables dans des conditions de concurrence normale, la référence à la juste valeur d'autres instruments sensiblement identiques, l'analyse des flux de trésorerie actualisés, les modèles d'évaluation des options ainsi que d'autres techniques couramment utilisées par les intervenants du marché qui recourent à l'utilisation maximale des données d'entrée observables.

L'IFRS 13, *Évaluation de la juste valeur*, exige l'utilisation et la présentation d'une hiérarchie des justes valeurs qui classe en trois niveaux les données d'entrée utilisées dans les techniques d'évaluation pour déterminer la juste valeur des instruments financiers. La hiérarchie des justes valeurs place au plus haut niveau les cours (non ajustés) observés sur des marchés actifs et au niveau le plus bas les données d'entrée non observables. Les trois niveaux de la hiérarchie basée sur les données d'entrée sont définis ainsi :

- Niveau 1 : La juste valeur est fondée sur des prix cotés non ajustés observés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques;
- Niveau 2 : La juste valeur est fondée sur des données d'entrée autres que les cours non ajustés visés au niveau 1, observables directement ou indirectement pour l'actif ou le passif concerné;
- Niveau 3 : La juste valeur est fondée sur au moins une donnée d'entrée non observable importante, relative à l'actif ou au passif financier, qui ne s'appuie pas sur des données de marché.

Des changements dans la méthode d'évaluation peuvent entraîner des transferts entre les différents niveaux. La politique des Fonds consiste à comptabiliser ces transferts à la date où ils ont lieu ou à la date du changement de circonstances qui est à l'origine du transfert. La hiérarchie des justes valeurs, les transferts entre les niveaux et le rapprochement des instruments financiers de niveau 3, le cas échéant, sont présentés dans les « Notes propres au Fonds » de chacun des Fonds.

Le gestionnaire a la responsabilité d'établir les évaluations à la juste valeur présentées dans les états financiers des Fonds, y compris les évaluations de niveau 3. Lorsqu'il évalue la juste valeur, le gestionnaire prend en considération plusieurs facteurs, comme les prix obtenus auprès de fournisseurs de services d'établissement des prix, et les résultats de modèles d'évaluation internes basés sur les fondamentaux de la société ou sur des données de marché. L'équipe d'évaluation fait un suivi de ces facteurs et les examine quotidiennement. À chaque date de présentation de l'information financière, le gestionnaire examine et approuve toutes les évaluations de la juste valeur de niveau 3. Le gestionnaire a également mis sur pied un comité d'évaluation constitué de membres de l'équipe des finances, ainsi que de membres des équipes de conseil en placement et de la conformité. Le comité se réunit chaque trimestre pour effectuer un examen détaillé de l'évaluation des placements détenus par les Fonds.

Les méthodes d'évaluation de la juste valeur des instruments financiers sont décrites ci-après.

- (i) Les actions, y compris les fonds négociés en bourse et les fonds à capital fixe, sont évaluées au cours de clôture de la bourse à laquelle ces actions sont principalement négociées.
- (ii) Les titres à revenu fixe, y compris les obligations et les titres adossés à des créances hypothécaires, sont évalués à l'aide de cours moyens provenant de fournisseurs de prix indépendants.
- (iii) Les instruments de créance à court terme sont comptabilisés au coût amorti, lequel se rapproche de la juste valeur.
- (iv) Les placements dans les fonds communs de placement sous-jacents sont évalués selon la valeur liquidative par part fournie par le gestionnaire des fonds communs de placement sous-jacents à la fin de chaque date d'évaluation.
- (v) Les bons de souscription non cotés sont évalués selon le modèle d'évaluation des options de Black et Scholes. Le modèle tient compte de la valeur temps de l'argent et des données significatives sur la volatilité. Aux fins du calcul de la valeur liquidative (définie ci-après), les bons de souscription non cotés sont évalués à leur valeur intrinsèque.
- (vi) Les options sont évaluées au cours moyen fourni par la bourse principale ou le marché hors cote où le contrat est négocié. Toutes les transactions sur options négociées hors cote sont évaluées au moyen de cours provenant de sources indépendantes. Les options sur contrats à terme normalisés sont évaluées selon le prix de règlement établi par la bourse si celui-ci est disponible, selon le dernier cours de clôture publié à la date d'évaluation si aucun prix de règlement n'est disponible ou, encore, selon le dernier prix de règlement publié si aucun cours de clôture n'est disponible. Les options sur fonds indiciels négociés en bourse sont évaluées selon le cours moyen en vigueur à 16 h fourni par la bourse principale où elles sont négociées.

(vii) Les contrats à terme normalisés sont évalués au prix de règlement à chaque date d'évaluation.

(viii) La valeur des contrats de change à terme ouverts est calculée d'après le gain ou la perte qui serait comptabilisé si la position était dénouée à la date d'évaluation.

(ix) Les swaps de gré à gré sont évalués au montant que les Fonds recevraient ou verseraient pour dénouer le swap, selon la valeur réelle du sous-jacent à la date d'évaluation. Les swaps faisant l'objet d'une compensation centralisée, qui sont cotés ou négociés sur une plateforme multilatérale ou un marché, comme une bourse réglementée, sont évalués au prix de règlement quotidien établi par la bourse (si celui-ci est disponible).

(d) Comparaison entre l'actif net et la valeur liquidative

Les méthodes comptables utilisées par les Fonds pour l'évaluation de la juste valeur de leurs placements et de leurs instruments dérivés sont identiques aux méthodes utilisées pour évaluer leur valeur liquidative selon la partie 14 du *Règlement 81-106 sur l'information continue des fonds d'investissement* (le « Règlement 81-106 »), sauf lorsque le dernier cours des actifs et passifs financiers ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur ou lorsque les Fonds détiennent des bons de souscription non cotés, tel qu'il est indiqué précédemment. Une comparaison entre l'actif net par part selon les normes IFRS de comptabilité (l'« actif net par part ») et la valeur liquidative par part calculée conformément au Règlement 81-106 (la « valeur liquidative par part ») est présentée, le cas échéant, dans les « Notes propres au Fonds » de chaque Fonds.

(e) Comptabilisation des revenus

Les gains et les pertes liés aux variations de la juste valeur des actifs financiers non dérivés sont présentés dans l'état du résultat global au poste « Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés » et au poste « Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés » lorsque les positions sont vendues.

Les gains et les pertes résultant des variations de la juste valeur des instruments dérivés sont présentés à l'état du résultat global au poste « Variation du gain (perte) latent sur les instruments dérivés » et au poste « Gain (perte) net réalisé sur les instruments dérivés » lorsque les positions sont dénouées ou échues, le cas échéant.

Les primes reçues ou payées sur les options achetées ou vendues sont comprises dans le coût des options. Toute différence résultant de la réévaluation à la date de présentation de l'information financière est traitée comme « Variation du gain (perte) latent sur les instruments dérivés », tandis que les gains ou les pertes réalisés au dénouement de la position sont présentés au poste « Gain (perte) net réalisé sur les instruments dérivés » de l'état du résultat global.

Le revenu de dividendes et les distributions provenant des fonds sous-jacents sont comptabilisés à la date ex-dividende. Les distributions provenant des fonds sous-jacents sont comptabilisées en fonction de la nature des composantes sous-jacentes, à savoir le revenu de dividendes, le revenu d'intérêts, les gains en capital et le remboursement de capital, en appliquant les classifications publiées par le fonds sous-jacent pour l'exercice précédent étant donné que celles de l'exercice considéré ne sont disponibles qu'à l'exercice suivant. Les distributions d'intérêts, de dividendes et de gains en capital provenant des fonds sous-jacents sont

respectivement inscrites aux postes « Intérêts à distribuer », « Dividendes » et « Gain (perte) net réalisé sur les actifs financiers non dérivés » de l'état du résultat global.

Les intérêts à distribuer correspondent à l'amortissement lié aux obligations à coupon zéro et aux paiements d'intérêts nominaux reçus par les Fonds et comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Les Fonds n'amortissent pas les primes payées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe. Les gains ou les pertes réalisés à la vente d'instruments de créance à court terme sont comptabilisés comme un rajustement des intérêts à distribuer.

(f) Monnaie fonctionnelle, monnaie de présentation et conversion des devises

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation de tous les Fonds. La monnaie fonctionnelle est la monnaie du principal environnement économique dans lequel les Fonds exercent leurs activités ou, dans le cas où des indicateurs mixtes existent dans le principal environnement, la monnaie principalement utilisée pour mobiliser les capitaux. Toute monnaie autre que la monnaie fonctionnelle constitue une devise pour les Fonds. Les montants libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle comme suit :

- (i) La juste valeur des placements, des contrats dérivés et des actifs et passifs monétaires et non monétaires est convertie aux taux de change en vigueur à la date d'évaluation;
- (ii) Les revenus et les charges étrangers sont convertis aux taux de change en vigueur à la date de la transaction;
- (iii) L'achat et la vente de placements et le revenu de placement sont convertis au taux de change en vigueur à la date de la transaction.

Les gains et les pertes de change liés aux actifs et passifs monétaires et non monétaires comptabilisés par les Fonds, autres que les placements et les instruments dérivés, sont présentés dans l'état du résultat global à titre de gain (perte) de change net réalisé et latent.

(g) Investissement dans des entités structurées non consolidées

Les Fonds peuvent investir dans un ou plusieurs fonds négociés en bourse gérés par le gestionnaire ou par d'autres gestionnaires de placements. Les Fonds concernés considèrent tous leurs placements dans ces instruments (les « fonds sous-jacents ») comme étant des placements dans des entités structurées non consolidées, car les décisions prises par les fonds sous-jacents ne dépendent pas des droits de vote ou de droits similaires détenus par les Fonds. Les Fonds comptabilisent ces investissements dans des entités structurées non consolidées à la juste valeur.

Les fonds sous-jacents ont chacun des objectifs et stratégies de placement qui permettent aux Fonds d'atteindre leurs objectifs de placement. Les fonds sous-jacents financent principalement leurs activités en émettant des parts rachetables; le droit de rachat est exécutable au gré du porteur pour les fonds négociés en bourse. Chaque fonds sous-jacent donne au porteur le droit à une part proportionnelle de son actif net. Les Fonds détiennent des parts dans chacun de leurs fonds sous-jacents. Ces placements sont comptabilisés dans les actifs financiers non dérivés, dans l'état de la situation financière. La variation de la juste valeur de chaque fonds

sous-jacent est comptabilisée dans l'état du résultat global au poste « Variation du gain (perte) latent sur les actifs financiers non dérivés ». La juste valeur de l'exposition aux placements des fonds sous-jacents est présentée dans les « Notes propres au Fonds ». L'exposition maximale des Fonds au risque de perte attribuable à leurs placements dans les fonds sous-jacents correspond à la valeur comptable totale de leurs placements dans les fonds sous-jacents.

(h) Parts rachetables émises par les Fonds

Les parts rachetables en circulation des Fonds sont considérées comme des « instruments remboursables au gré du porteur » et ont été classées dans les passifs, conformément à l'IAS 32, *Instruments financiers : présentation* (l'« IAS 32 »). Le jugement posé pour déterminer ce classement est présenté à la note 7.

(i) Compensation des instruments financiers

Les actifs et passifs financiers sont compensés et le montant net qui en résulte est présenté à l'état de la situation financière seulement si un droit juridique inconditionnel de compenser les montants comptabilisés existe et s'il y a une intention soit de régler le solde net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Les revenus et les charges liés aux gains et aux pertes attribuables à un groupe de transactions similaires, comme les gains et pertes découlant d'instruments financiers évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, sont comptabilisés à leur montant net seulement lorsque cela est permis selon les normes IFRS de comptabilité. Les actifs et passifs financiers faisant l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'un accord similaire, ainsi que les effets potentiels de la compensation, sont présentés dans les « Notes propres au Fonds » de chacun des Fonds.

(j) Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités, par part, est présentée à l'état du résultat global et correspond à l'augmentation ou à la diminution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables liée aux activités de la période, divisée par le nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période.

(k) Trésorerie et découvert bancaire

La trésorerie est composée de dépôts en espèces et de découverts bancaires, s'il y a lieu. Les instruments à court terme sont comptabilisés dans les actifs financiers non dérivés, dans l'état de la situation financière.

(l) Opérations sans effet sur la trésorerie

Les opérations sans effet sur la trésorerie présentées dans le tableau des flux de trésorerie comprennent les distributions réinvesties provenant des fonds sous-jacents et les dividendes issus des placements en actions. Ces montants font partie des revenus hors trésorerie comptabilisés dans l'état du résultat global.

Les souscriptions et les rachats honorés au moyen de paniers de valeurs mobilières sont aussi des opérations sans effet sur la trésorerie et ont été exclus des postes « Produit de l'émission de parts rachetables » et « Montant payé au rachat de parts rachetables » du

tableau des flux de trésorerie. De même, les opérations de placement liées ont été exclues des postes « Achat d'actifs et de passifs financiers non dérivés » et « Produit de la vente d'actifs et de passifs financiers non dérivés » du tableau des flux de trésorerie.

(m) Changements de méthodes comptables

Les Fonds ont adopté *Informations à fournir sur les méthodes comptables (modifications de l'IAS 1 et de l'énoncé de pratiques en IFRS 2)* le 1^{er} janvier 2023. Bien que les modifications n'aient pas entraîné de changements de méthodes comptables en soi, elles ont eu une incidence sur les informations sur les méthodes comptables à fournir dans les états financiers.

Les modifications exigent la présentation d'informations « significatives » sur les méthodes comptables plutôt que la présentation d'informations sur les principales méthodes comptables. Les modifications fournissent également des directives quant à l'application du concept d'importance relative aux informations à fournir sur les méthodes comptables, dans le but d'aider les entités à fournir des informations utiles sur les méthodes comptables qui leur sont propres et qui aideront les utilisateurs à comprendre les autres informations dans les états financiers.

Le gestionnaire a passé en revue les méthodes comptables et a déterminé qu'aucun changement n'était nécessaire.

3. Jugements et estimations comptables importants

Lorsqu'il prépare les états financiers, le gestionnaire doit faire appel à son jugement pour appliquer les méthodes comptables et établir des estimations et des hypothèses concernant l'avenir. Ces estimations sont faites en fonction de l'information disponible à la date de publication des états financiers. Les résultats réels peuvent différer considérablement des estimations. Les paragraphes qui suivent présentent une analyse des jugements et estimations comptables les plus importants établis par les Fonds aux fins de la préparation des états financiers.

Entités d'investissement

Conformément à l'IFRS 10, *États financiers consolidés*, le gestionnaire a déterminé que les Fonds répondent à la définition d'entité d'investissement, soit une entité qui obtient des capitaux de la part d'un ou de plusieurs investisseurs en vue de leur fournir des services de gestion de placements, qui s'engage à investir ces fonds dans le seul but de réaliser des rendements provenant de plus-values de capital ou de revenus de placement, ou les deux, et qui évalue la performance de ses placements sur la base de la juste valeur. Les Fonds ne consolident donc pas leurs placements dans des filiales, le cas échéant, mais les évaluent à la juste valeur par le biais du résultat net, conformément à la norme comptable susmentionnée.

Classement et évaluation des instruments financiers

Le classement et l'évaluation de certains instruments financiers détenus par les Fonds exigent du gestionnaire qu'il exerce un jugement important afin de déterminer si le modèle économique des Fonds est de gérer leurs actifs selon la juste valeur et de réaliser ces justes valeurs et, donc, s'il est possible de classer tous les instruments financiers comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net conformément à l'IFRS 9.

La détermination de la juste valeur des instruments financiers non cotés sur un marché actif est l'un des points clés pour lesquels le gestionnaire est tenu d'exercer un jugement complexe ou subjectif. L'utilisation de techniques d'évaluation pour les instruments financiers non cotés sur un marché actif exige que le gestionnaire pose des hypothèses fondées sur les conditions du marché à la date de présentation des états financiers. Tout changement à ces hypothèses lié à une modification des conditions du marché peut avoir une incidence sur la juste valeur publiée des instruments financiers.

4. Risques associés aux instruments financiers

Les activités de placement de chaque Fonds l'exposent à divers risques financiers : le risque de marché (qui comprend le risque de taux d'intérêt, le risque de change et le risque de prix), le risque de crédit, le risque de liquidité et le risque de concentration. Les pratiques de placement de chaque Fonds comportent un suivi du portefeuille afin d'assurer le respect des directives de placement. Le gestionnaire cherche à réduire au minimum les effets négatifs potentiels des risques sur le rendement de chaque Fonds en employant et en supervisant des conseillers en valeurs professionnels et expérimentés qui effectuent un suivi régulier des titres de chaque Fonds et de l'évolution des marchés des capitaux. Les risques sont évalués d'après une méthode qui tient compte de l'incidence attendue, sur les résultats et sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts des Fonds, des changements raisonnablement possibles dans les facteurs de risque pertinents.

Le gestionnaire maintient, en matière de gestion du risque, une méthode qui consiste, entre autres, à surveiller le respect des directives de placement afin de s'assurer que les Fonds sont gérés conformément à leurs objectifs et stratégies de placement et aux règlements sur les valeurs mobilières.

Les Fonds peuvent investir dans des fonds sous-jacents. Ces Fonds peuvent être indirectement exposés au risque de marché, au risque de crédit et au risque de liquidité si les fonds sous-jacents investissent dans des instruments financiers qui sont exposés à ces risques.

L'exposition des Fonds au risque de marché, au risque de crédit et au risque de liquidité, le cas échéant, est décrite dans les « Notes propres au Fonds » de chaque Fonds.

Les conflits géopolitiques ont perturbé les marchés à l'échelle mondiale, et les conséquences à long terme de ces facteurs sont incertaines. De telles perturbations peuvent avoir un effet négatif sur les risques liés aux instruments financiers de chacun des Fonds.

(a) Risque de marché

i) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt découle de la possibilité que les fluctuations de taux d'intérêt aient une incidence sur les flux de trésorerie futurs ou sur la juste valeur des instruments financiers portant intérêt. Chaque Fonds est exposé au risque de taux d'intérêt essentiellement par ses placements dans des instruments de créance (tels que les obligations et les débentures) et dans des instruments dérivés sensibles aux taux d'intérêt, le cas échéant.

ii) Risque de change

Les Fonds peuvent investir dans des instruments monétaires et non monétaires libellés dans des monnaies autres que leur monnaie fonctionnelle, ou prendre des positions vendeur sur ces instruments. Le risque de change s'entend du risque que la valeur des instruments étrangers varie en raison des fluctuations des taux de change de ces monnaies par rapport à la monnaie fonctionnelle des Fonds. Les Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme, des contrats à terme sur devises ou des contrats d'options sur devises à des fins de couverture pour réduire leur exposition au risque de change.

iii) Risque de prix

Le risque de prix s'entend du risque que la juste valeur des instruments financiers des Fonds varie en raison des fluctuations des cours (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change) causées par des facteurs propres à un titre ou à son émetteur ou par tous les facteurs touchant un marché ou un segment de marché. L'exposition au risque de prix est surtout liée aux actions, aux fonds sous-jacents et aux instruments dérivés. Le risque maximum que peuvent causer ces instruments financiers correspond à leur juste valeur, sauf s'il s'agit d'options vendues, auquel cas les pertes éventuelles sont illimitées.

(b) Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque que l'émetteur d'un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement envers les Fonds. Le risque de crédit d'un Fonds provient principalement des placements dans des instruments financiers, comme les obligations, les débentures, les instruments du marché monétaire, les actions privilégiées et les instruments dérivés. La juste valeur des instruments financiers tient compte de la solvabilité de l'émetteur et, par conséquent, représente l'exposition maximale au risque de crédit des Fonds. Toutes les opérations sur titres et instruments dérivés cotés sont réglées à la livraison par l'intermédiaire de courtiers approuvés dont la notation est également approuvée. Le risque de défaut des contreparties est jugé minime, car les titres vendus ne sont livrés qu'après réception du paiement par le courtier. Les achats ne sont payés qu'une fois que le courtier a reçu les titres.

Le comité de surveillance de la gestion des opérations est chargé d'évaluer la conformité aux exigences réglementaires et, s'il y a lieu, d'approuver les politiques et les procédures de gestion des opérations. Il est également responsable de la sélection et du suivi des contreparties. Ce comité évalue régulièrement les contreparties pour s'assurer qu'elles respectent toujours les critères de solvabilité qu'il a établis. Les politiques et procédures établies par le comité relativement aux contreparties ont été examinées et approuvées par le conseil d'administration du gestionnaire.

Les Fonds effectuent des transactions avec des contreparties approuvées ayant une notation désignée, conformément à la réglementation sur les valeurs mobilières.

Les notations des émetteurs d'instruments de créance, des contreparties aux opérations sur instruments dérivés, des courtiers principaux et des dépositaires, le cas échéant, présentées dans les états financiers proviennent de l'agence de notation S&P Global Ratings ou d'autres agences approuvées, exprimées selon le système de S&P Global Ratings. Lorsque la notation est inférieure à la notation désignée, le gestionnaire prend les mesures appropriées.

Les Fonds peuvent également être exposés au risque de crédit advenant que leur dépositaire ne soit pas en mesure d'effectuer le règlement des opérations en trésorerie. La réglementation canadienne sur les valeurs mobilières exige que les Fonds recourent aux services d'un dépositaire qui satisfait à certaines exigences en matière de capital. Cette réglementation exige, entre autres choses, que le dépositaire d'un fonds soit une banque figurant à l'Annexe I, II ou III de la *Loi sur les banques* (Canada) ou une société constituée au Canada et affiliée à une banque dont les capitaux propres sont d'au moins 10 000 000 \$. Le dépositaire des Fonds, State Street Trust Company Canada, satisfait à toutes les exigences des autorités canadiennes en valeurs mobilières pour agir à titre de dépositaire des Fonds.

Les Fonds peuvent prêter des titres à des contreparties, c'est-à-dire qu'ils peuvent les échanger temporairement contre une garantie, moyennant l'engagement de la contrepartie de restituer les mêmes titres à une date ultérieure. Le risque de crédit lié à ces opérations est jugé minimal, car la notation de toutes les contreparties est approuvée, et la valeur de marché de la trésorerie ou des titres détenus à titre de garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés à la fin de chaque jour de bourse.

(c) Risque de liquidité

Tous les passifs financiers des Fonds comportent une échéance maximale d'un an, sauf mention contraire. L'exposition des Fonds au risque de liquidité découle principalement des rachats de parts. Les Fonds ne sont pas exposés à un risque de liquidité important lorsque les rachats de parts sont payés sous forme de titres ou de trésorerie, car ils investissent principalement dans des titres négociés sur des marchés actifs et pouvant facilement être vendus. En outre, chaque Fonds cherche à conserver des positions en trésorerie et en équivalents de trésorerie suffisantes pour maintenir sa liquidité. De temps à autre, les Fonds peuvent être partie à des contrats dérivés hors cote ou investir dans des titres qui ne sont pas négociés sur un marché actif et qui peuvent être non liquides. Les titres non liquides sont indiqués dans l'inventaire du portefeuille de chaque Fonds, s'il y a lieu.

(d) Risque de concentration

Le risque de concentration découle des instruments financiers dont les caractéristiques sont similaires et qui sont touchés de façon semblable par des changements de conditions économiques ou autres. Le risque de concentration est indiqué dans les « Notes propres au Fonds » de chacun des Fonds.

5. Frais de gestion

Les Fonds paient au gestionnaire des frais de gestion en contrepartie de la prestation directe ou indirecte des services suivants : la gestion des Fonds, les services de fiduciaire, les services de conseil en placement, la maintenance des systèmes de gestion du portefeuille, la mise à jour du site Web, le marketing, la promotion et le règlement de la rémunération des sous-conseillers.

Les frais de gestion correspondent à un pourcentage annualisé de la valeur liquidative des Fonds. Les frais de gestion versés par les Fonds sont calculés et comptabilisés quotidiennement et, en général, versés mensuellement, ou au moins trimestriellement.

Afin de favoriser les placements très importants dans les Fonds et de s'assurer que les frais de gestion sont concurrentiels pour ces placements, le gestionnaire peut, à son gré, réduire les frais qu'il facture habituellement aux Fonds pour les placements effectués par des porteurs détenant des parts d'une valeur totale spécifique. Une telle réduction dépend de certains facteurs, dont le montant investi, l'actif total des Fonds sous administration et le niveau d'activité prévu dans le compte. Les Fonds distribuent trimestriellement, au gré du gestionnaire, un montant en trésorerie correspondant à la différence entre les frais qui auraient été facturés et les frais réduits.

Les Fonds peuvent investir dans un ou plusieurs fonds sous-jacents imposant des frais de gestion. Afin que les frais de gestion ne soient pas facturés en double par les Fonds et les fonds sous-jacents qu'ils détiennent directement, le gestionnaire a convenu d'absorber la totalité des frais de gestion des fonds sous-jacents qu'encourent les Fonds dans le cadre de leurs placements, peu importe si les fonds sous-jacents sont gérés par le gestionnaire ou un tiers. Ces frais sont inclus dans l'état du résultat global, au poste « Charges absorbées par le gestionnaire » (le cas échéant).

Les frais de gestion annuels (hors taxes de vente) auxquels le gestionnaire a droit s'établissent comme suit :

Fonds	Frais de gestion
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	0,05 %
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	0,03 %
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	0,16 %
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	0,15 %
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	0,10 %
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	0,11 %
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	0,17 %
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	0,14 %
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	0,05 %

6. Frais d'administration à taux fixe et charges d'exploitation

Le gestionnaire assume les charges d'exploitation des Fonds, sauf certains frais engagés aux fins de conformité avec le Règlement 81-107 (y compris la rémunération et les dépenses des membres du comité d'examen indépendant), les frais et les commissions de courtage, les frais liés à l'utilisation d'instruments dérivés, les frais engagés pour se conformer à de nouvelles exigences du gouvernement ou des autorités de réglementation adoptées après le 20 octobre 2020, tout nouveau type de coûts, de frais ou d'honoraires non engagés avant le 20 octobre 2020, y compris ceux qui se rapportent aux services externes qui n'étaient pas communément facturés dans le secteur canadien des organismes de placement collectif, les nouveaux droits instaurés après le 20 octobre 2020 par une autorité en valeurs mobilières ou une autre autorité gouvernementale qui sont fondés sur les actifs ou d'autres critères à l'égard des fonds, les impôts, la taxe de vente harmonisée (TVH), les retenues d'impôt ainsi que les autres taxes et impôts.

Les Fonds sont tenus de payer la TVH sur les frais de gestion qui leur sont facturés. En général, le montant total de la TVH qu'ils paient dépend de la répartition par province de résidence de leurs porteurs de parts. Les modifications apportées aux taux de TVH en vigueur, au groupe de provinces ayant adopté l'harmonisation et à la répartition par province de résidence des porteurs de parts des Fonds auront une incidence sur l'évolution de leurs ratios de frais de gestion d'un exercice à l'autre.

Outre les frais d'établissement des Fonds, toutes les charges liées à l'émission de parts des Fonds sont assumées par les Fonds, à moins qu'elles ne soient abandonnées ou remboursées par le gestionnaire.

Les Fonds versent au gestionnaire des frais d'administration à taux fixe (les « frais d'administration à taux fixe ») et, sous réserve des exigences du Règlement 81-102, le gestionnaire paie les charges d'exploitation suivantes des Fonds (les « charges d'exploitation ») : honoraires d'agent des transferts et de tenue des registres; frais de comptabilité et d'évaluation des Fonds; droits de garde; honoraires d'audit et frais juridiques; frais d'administration; frais bancaires; coûts de préparation et de distribution des rapports annuels et semestriels, des prospectus, des aperçus et des états financiers des Fonds, des documents destinés aux investisseurs et des documents d'information continue; frais d'impression et d'envoi des rapports aux porteurs de parts; frais et charges se rapportant à l'exercice des droits de vote par procuration par un tiers; et droits d'inscription en bourse, frais de licence de l'indice et frais à payer à la CDS. Le gestionnaire peut, pendant certains exercices et à certaines occasions, payer une partie des frais d'administration à taux fixe des Fonds. Le gestionnaire n'est pas tenu de payer d'autres charges, coûts et frais, y compris ceux découlant de nouvelles exigences gouvernementales ou réglementaires concernant les charges, coûts et frais indiqués précédemment.

Les frais d'administration à taux fixe applicables à un Fonds sont échelonnés sur trois paliers, selon l'actif net de celui-ci à la fin du mois précédent. Les trois paliers sont : i) actif net de moins de 750 M\$; ii) actif net de 750 M\$ à 3 G\$; et iii) actif net de plus de 3 G\$. Les frais d'administration à taux fixe, calculés selon un pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative de chaque Fonds, comptabilisés quotidiennement et versés mensuellement, sont les suivants :

	Palier 1 Actif sous gestion inférieur à 750 M\$	Palier 2 Actif sous gestion inférieur à 3 000 M\$	Palier 3 Actif sous gestion supérieur à 3 000 M\$
Frais d'administration à taux fixe			
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	0,03 %	0,03 %	0,02 %
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	0,02 %	0,02 %	0,02 %
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	0,09 %	0,08 %	0,07 %
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	0,05 %	0,05 %	0,04 %
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	0,03 %	0,03 %	0,02 %
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	0,02 %	0,02 %	0,02 %
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	0,05 %	0,05 %	0,04 %
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	0,03 %	0,03 %	0,02 %
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	0,03 %	0,03 %	0,02 %

Les honoraires payés ou à payer à KPMG s.r.l./S.E.N.C.R.L. à titre d'auditeur externe de tous les Fonds gérés par le gestionnaire, y compris les fonds Dynamique, les FNB Dynamique, les fonds Scotia et les FNB Scotia, pour les exercices des Fonds s'établissent comme suit :

Honoraires d'audit	2 124 000 \$
Honoraires pour services autres que d'audit	433 000 \$

7. Parts rachetables

Les parts émises et en circulation représentent le capital de chaque Fonds. Chaque Fonds peut émettre un nombre illimité de parts. Chaque part est rachetable au gré du porteur conformément à la déclaration de fiducie et est de même rang que toutes les autres parts des Fonds. En outre, elle donne au porteur le droit à une quote-part indivise de la valeur liquidative des Fonds.

Chaque jour de bourse, un courtier désigné peut placer un ordre de souscription visant un nombre prescrit de parts des Fonds ou un

multiple entier de ce nombre. Si l'ordre de souscription est accepté, le Fonds concerné émettra des parts en faveur du courtier désigné dans les deux jours ouvrables suivant la date d'effet de son ordre. Les souscriptions sont payables par le courtier désigné au moyen d'un panier de valeurs mobilières et de trésorerie dont le montant est équivalent à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts.

En tout temps pendant les jours de bourse, les porteurs de parts des Fonds peuvent échanger le nombre prescrit de parts des Fonds contre des valeurs mobilières et de la trésorerie s'ils respectent les exigences de souscription minimales. Pour procéder à un échange de parts, un porteur doit présenter une demande d'échange, selon le modèle et le lieu prescrits par le Fonds, au plus tard à la date et à l'heure établies dans le prospectus. Le prix d'échange, qui est payable sous forme de valeurs mobilières et de trésorerie, correspondra à la valeur liquidative des parts visées par l'échange, telle qu'elle est établie à l'heure d'évaluation de la date d'échange. Les parts seront rachetées lors de l'échange. Le gestionnaire indiquera également, chaque jour de bourse, le nombre de parts des Fonds prescrit aux fins de rachat pour les investisseurs, les courtiers et les courtiers désignés. La date d'effet d'une demande d'échange correspond au jour de bourse au cours duquel l'heure d'évaluation aux fins du rachat a été établie.

Le gestionnaire peut (à sa discrétion) satisfaire la demande d'échange d'un porteur de parts en lui offrant une contrepartie en trésorerie équivalant à la valeur liquidative du nombre prescrit de parts présentées aux fins d'échange, telle qu'elle est déterminée à la date et à l'heure d'évaluation de la demande d'échange, si le porteur de parts convient de payer les frais d'administration applicables, y compris les frais de courtage liés, les commissions, les coûts de transactions, et les autres charges que les Fonds engagent ou prévoient engager pour la vente de titres sur le marché en vue de financer l'échange.

Si une demande d'échange est reçue après l'heure limite applicable, l'ordre d'échange sera exécuté le jour de bourse suivant. Le règlement des échanges contre des valeurs mobilières et de la trésorerie a normalement lieu le deuxième jour de bourse suivant la date d'effet de la demande d'échange.

Pendant les jours de bourse, les porteurs de parts de chaque Fonds peuvent demander le rachat i) de leurs parts du Fonds contre un montant en trésorerie par part équivalant à 95 % du cours de clôture des parts à la Bourse de Toronto à la date d'effet de rachat, sous réserve d'un prix de rachat par part maximum équivalant à la valeur liquidative par part à la date d'effet du rachat, moins tous les frais d'administration applicables établis à l'occasion par le gestionnaire (à sa discrétion) ou ii) d'un nombre prescrit de parts du Fonds ou un multiple de ce nombre contre un montant en trésorerie équivalant à la valeur liquidative d'un tel nombre de parts du Fonds, moins tous les frais d'administration applicables établis à l'occasion par le gestionnaire (à sa discrétion). Le gestionnaire et le Fonds n'imposent aucuns frais ou charges aux porteurs pour la vente de parts à la Bourse de Toronto. Ce prix de rachat réduit fait en sorte que les flux de trésorerie liés aux rachats ne sont pas basés de façon significative sur la valeur liquidative, et les parts sont par conséquent classées dans les passifs financiers conformément aux exigences de l'IAS 32.

Pour qu'un rachat en trésorerie soit effectué un jour de bourse donné, une demande de rachat en trésorerie visant les parts du Fonds doit être présentée au gestionnaire, selon le modèle et le lieu prescrits par celui-ci, au plus tard à l'heure établie dans le prospectus du Fonds

en question. Toute demande reçue après l'heure limite sera traitée le jour de bourse suivant. Dans la mesure du possible, le paiement du prix de rachat sera versé au plus tard le deuxième jour de bourse suivant la date de rachat effective. Veuillez communiquer avec un

courtier inscrit pour obtenir un formulaire de demande de rachat en trésorerie. Le capital de chaque Fonds est géré conformément à l'objectif, aux politiques et aux restrictions de placement du Fonds tels qu'ils sont mentionnés dans son prospectus.

Le tableau qui suit présente le nombre de parts émises, réinvesties et rachetées au cours des périodes closes les 31 décembre 2023 et 2022 :

Fonds	31 décembre 2023					31 décembre 2022				
	Nombre de parts, à l'ouverture de la période	Parts émises	Parts réinvesties	Parts rachetées	Nombre de parts, à la clôture de la période	Nombre de parts, à l'ouverture de la période	Parts émises	Parts réinvesties	Parts rachetées	Nombre de parts, à la clôture de la période
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	13 600 000	7 100 000	—	(1 550 000)	19 150 000	9 300 000	4 950 000	—	(650 000)	13 600 000
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	3 375 000	900 000	—	(1 925 000)	2 350 000	1 200 000	2 275 000	—	(100 000)	3 375 000
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	4 475 000	450 000	—	(400 000)	4 525 000	—	4 475 000	—	—	4 475 000
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	10 275 000	1 650 000	—	(900 000)	11 025 000	7 875 000	2 550 000	—	(150 000)	10 275 000
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	1 250 000	450 000	—	—	1 700 000	—	1 600 000	—	(350 000)	1 250 000
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	125 000	75 000	—	(25 000)	175 000	—	125 000	—	—	125 000
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	675 000	325 000	—	—	1 000 000	—	675 000	—	—	675 000
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	1 700 000	900 000	—	(200 000)	2 400 000	—	1 800 000	—	(100 000)	1 700 000
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	23 500 000	3 800 000	—	(3 700 000)	23 600 000	17 500 000	8 100 000	—	(2 100 000)	23 500 000

Le cours de clôture des parts rachetables cotées de chaque Fonds aux 31 décembre 2023 et 2022 est indiqué ci-dessous :

Fonds	31 décembre 2023 (\$)	31 décembre 2022 (\$)
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	17,19	16,63
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	27,35	25,22
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia	22,63	21,67
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	24,37	21,89
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	18,55	17,91
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	19,71	17,45
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	20,09	17,56
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	21,68	17,17
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	28,43	23,21

8. Impôt sur le revenu

Chacun des Fonds, à l'exception du FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia, du FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia, du FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia, du FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia et du FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia, répond à la définition de fiducie de fonds commun de placement de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) (la « Loi de l'impôt »).

À l'heure actuelle, le FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia, le FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia, le FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia, le FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia et le FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia ne répondent pas à cette définition. Chaque Fonds distribue aux porteurs de parts une tranche suffisante de son revenu net de placement, y compris ses gains en capital nets réalisés (le cas échéant), moins le montant retenu par chaque Fonds afin d'utiliser toute perte fiscale ou, le cas échéant, tout remboursement d'impôt découlant des rachats de la période, de sorte qu'aucun impôt ne soit payé ou payable par le

Fonds. Ces revenus nets de placement, y compris les gains en capital nets réalisés, sont imposables entre les mains des porteurs de parts. Un Fonds qui ne répond pas à la définition de fiducie de fonds commun de placement pourrait aussi être assujéti à un impôt minimum de remplacement en vertu de la Loi de l'impôt. À l'heure actuelle, les Fonds ne s'attendent pas à être assujétis à l'impôt minimum de remplacement ni à d'autres impôts sur le revenu; par conséquent, ils ne comptabilisent pas d'impôt canadien dans leurs états financiers.

Lorsqu'un Fonds ne répond pas à la définition de « fiducie de fonds commun de placement » au sens de la Loi de l'impôt et que plus de 50 % de la juste valeur de marché de toutes les participations dans le Fonds est détenue par des « institutions financières », au sens attribué à ce terme aux fins des règles concernant les « biens évalués à la valeur du marché » dans la Loi de l'impôt, le Fonds est considéré comme une « institution financière » aux fins de ces règles. Si tel est le cas, les gains et les pertes du Fonds sur des biens qui sont des « biens évalués à la valeur du marché » aux fins de ces règles seront entièrement compris dans le revenu ou déduits de celui-ci à la valeur du marché sur une base annuelle. Un Fonds qui cesse d'être une institution financière aux fins des règles susmentionnées est alors considéré comme ayant une fin d'année d'imposition à ce moment-là et comme ayant cédé certains biens à leur juste valeur de marché et les ayant immédiatement réacquis. Une fin d'année d'imposition réputée entraîne une distribution imprévue du revenu net du Fonds, le cas échéant, aux porteurs de parts de sorte que le Fonds ne sera pas assujéti à l'impôt sur le revenu sur ces montants en vertu de la partie I de la Loi de l'impôt. Au 31 décembre 2023, aucun des Fonds n'était assujéti aux règles concernant les « biens évalués à la valeur du marché » décrites ci-dessus et aucun n'est censé l'être à l'avenir.

Les Fonds peuvent distribuer un remboursement de capital. Un remboursement de capital n'est généralement pas imposable pour les porteurs de parts, mais réduit le prix de base rajusté des parts détenues.

Si un Fonds ne distribue pas une part suffisante de son revenu net ou de ses gains en capital nets au cours d'un exercice, une distribution

automatiquement réinvestie en parts additionnelles sera versée aux porteurs à la fin de l'exercice. Le nombre de parts en circulation est consolidé immédiatement après ce réinvestissement pour que la valeur liquidative par part après la distribution et le réinvestissement soit la même qu'avant la distribution.

Reports prospectifs de pertes

Les pertes en capital peuvent être reportées indéfiniment afin de réduire tout gain en capital net réalisé futur. Les pertes autres qu'en capital aux fins de l'impôt peuvent être reportées pendant au plus vingt ans et déduites de toutes les sources de revenu. Étant donné que les Fonds ne comptabilisent pas d'impôt différé, l'économie d'impôt liée aux pertes en capital et autres qu'en capital n'a pas été reflétée à titre d'actif d'impôt différé dans l'état de la situation financière.

Le tableau qui suit présente les pertes en capital et les pertes autres qu'en capital pouvant être reportées dont disposaient les Fonds à la clôture de l'année d'imposition 2023 :

Fonds	Année d'expiration	Total des pertes en capital (\$)	Total des pertes autres qu'en capital (\$)
FNB indicel d'obligations canadiennes Scotia		3 983 908	—
FNB indicel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia		249 723	—
FNB indicel d'actions des marchés émergents Scotia		833 989	—
FNB indicel d'actions internationales Scotia		2 650 294	—
FNB indicel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	2042	39 396	932 180
FNB indicel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia		—	—
FNB indicel d'actions internationales à investissement responsable Scotia		—	—
FNB indicel d'actions américaines à investissement responsable Scotia		—	—
FNB indicel d'actions américaines Scotia		2 572 627	—

Retenues d'impôts

Les Fonds pourraient être assujettis à des retenues d'impôts sur les revenus de placement et, dans certains cas, 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 à titre de charge distincte à l'état du résultat global.

Positions fiscales incertaines

Les Fonds peuvent investir dans des titres émis par des entités qui ne sont pas domiciliées au Canada. Les pays étrangers peuvent exiger un impôt sur les gains en capital réalisés par les non-résidents. En outre, les Fonds peuvent avoir à évaluer eux-mêmes cet impôt sur les gains en capital. Il est donc possible qu'il ne soit pas déduit à la source par le courtier des Fonds.

S'il y a lieu, les Fonds appliquent la méthode du montant le plus probable pour calculer le passif d'impôt incertain, les pénalités et les intérêts concernant les gains en capital étrangers. Les Fonds comptabilisent le passif d'impôt incertain, le cas échéant, en tant que provision pour position fiscale incertaine dans l'état de la situation financière et en tant que retenues d'impôts étrangers/remboursements d'impôts dans l'état du résultat global. Bien que cette provision constitue la meilleure estimation du gestionnaire, l'écart entre celle-ci et le montant réel à payer pourrait être important.

9. Accords de paiement indirect

Les accords de paiement indirect sont des ententes en vertu desquelles le conseiller en valeurs confie les opérations de ses clients

à une maison de courtage et obtient en retour, de cette maison de courtage ou par son entremise, des produits ou services autres que l'exécution d'opérations sur titres. Aucun paiement indirect vérifiable lié aux opérations du portefeuille de placements n'a été effectué pour les périodes closes les 31 décembre 2023 et 2022.

10. Opérations avec des parties liées

Le gestionnaire est une filiale en propriété exclusive de la Banque Scotia.

Le gestionnaire peut effectuer des opérations ou conclure des accords au nom des Fonds avec d'autres membres de la Banque Scotia ou certaines sociétés liées ou rattachées au gestionnaire (chacune une « partie liée »). Toutes les opérations entre les Fonds et les parties liées sont conclues dans le cours normal des activités.

- Le gestionnaire reçoit des frais de gestion pour ses services à titre de fiduciaire et/ou de gestionnaire des Fonds, comme il est indiqué à la note 5. Les montants des frais de gestion sont présentés dans un poste distinct de l'état du résultat global.
- La Banque Scotia détient, directement ou indirectement, 100 % du courtier en placement Scotia Capitaux Inc. (qui comprend les entités Scotia McLeod et Scotia iTRADE) ou d'autres maisons de courtage liées dans lesquelles la Banque Scotia détient une participation importante (les « courtiers liés »). Les décisions d'acheter ou de vendre les titres des portefeuilles des Fonds sont prises par le gestionnaire de portefeuille de chaque Fonds. Certaines opérations de portefeuille peuvent également être exécutées par une partie liée des Fonds, pourvu que ses tarifs, services et autres conditions soient comparables à ceux offerts par d'autres courtiers. La partie liée recevra alors des commissions de courtage versées par les Fonds. Aucune commission de courtage n'a été versée aux parties liées pour les périodes closes les 31 décembre 2023 et 2022.
- Scotia Capitaux Inc., société affiliée du gestionnaire, est un courtier désigné pour les Fonds. À ce titre, Scotia Capitaux Inc. peut souscrire des parts des Fonds ou recevoir du gestionnaire des parts, de temps à autre. Les Fonds n'ont pas engagé de frais connexes et n'en ont pas payé à Scotia Capitaux Inc. pour ses services à titre de courtier désigné pour la période close les 31 décembre 2023 et 2022.
- Le comité d'examen indépendant des Fonds a autorisé le gestionnaire à acheter des titres de parties liées.

11. Prêt de titres

Les Fonds peuvent conclure des opérations de prêt de titres en vertu d'un programme de prêt de titres avec State Street Bank and Trust Company. Ces opérations consistent en un prêt temporaire de titres, l'emprunteur fournissant des garanties et s'engageant à remettre les mêmes titres au Fonds à une date ultérieure. Conformément à la réglementation sur les valeurs mobilières, les Fonds reçoivent une garantie représentant minimalement 102 % de la valeur des titres prêtés. Cette garantie est composée de titres de créance du gouvernement du Canada, de gouvernements provinciaux canadiens, du gouvernement des États-Unis et de certaines institutions financières ou d'autres titres admissibles, et n'est pas présentée dans l'inventaire du portefeuille. Les Fonds ne reçoivent aucune garantie en trésorerie dans le cadre de leurs opérations de prêt de titres. La valeur de marché totale des titres prêtés par un Fonds ne peut

excéder 50 % de l'actif net du Fonds. La juste valeur des titres prêtés et de la garantie détenue est calculée chaque jour. Les arrangements de prêt de titres peuvent être résiliés en tout temps par l'emprunteur, l'agent de prêt de titres ou le Fonds.

Le revenu tiré de ces opérations de prêt de titres est inscrit au poste « Prêt de titres » de l'état du résultat global (le cas échéant).

La valeur de marché totale des titres prêtés et des garanties reçues par les Fonds aux 31 décembre 2023 et 2022 ainsi que les revenus générés par les opérations de prêt de titres pour les périodes closes les 31 décembre 2023 et 2022 s'établissent comme suit :

Fonds	Au 31 décembre 2023		Pour la période close le 31 décembre 2023		
	Valeur de marché des titres prêtés (\$)	Valeur de marché de la garantie reçue (\$)	Montant net reçu par le Fonds (\$)	Montant reçu par l'agent de prêt de titres (\$)	Revenus bruts tirés des opérations de prêt de titres (\$)
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	32 812 651	35 240 296	24 963	10 690	35 653
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	829 876	876 540	283	121	404
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	2 862 465	3 119 688	23 631	10 118	33 750
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	5 059 983	5 487 160	3 865	1 644	5 509
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia	—	—	27	11	38
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	114 409	120 987	717	304	1 021
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	1 942 846	2 035 398	1 291	539	1 830
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	16 011 701	16 781 679	12 294	5 251	17 545

Fonds	Au 31 décembre 2022		Pour la période close le 31 décembre 2022		
	Valeur de marché des titres prêtés (\$)	Valeur de marché de la garantie reçue (\$)	Montant net reçu par le Fonds (\$)	Montant reçu par l'agent de prêt de titres (\$)	Revenus bruts tirés des opérations de prêt de titres (\$)
FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia	43 864 077	45 601 499	10 980	4 701	15 681
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia	—	—	101	44	145
FNB indiciel d'actions internationales Scotia	3 999 719	4 229 495	18 901	8 094	26 995
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia	3 487 379	3 962 512	869	369	1 238
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia	87 344	91 929	—	103	345
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia	61 553	69 581	38	15	53
FNB indiciel d'actions américaines Scotia	727 683	890 076	5 942	2 528	8 470

12. Code des monnaies

La liste qui suit présente les codes des monnaies pouvant être utilisés dans les états financiers :

AUD	Dollar australien	MXN	Peso mexicain
BMD	Dollar des Bermudes	MYR	Ringgit malais
BRL	Réal brésilien	NOK	Couronne norvégienne
CAD	Dollar canadien	NZD	Dollar néo-zélandais
CHF	Franc suisse	PEN	Nouveau sol péruvien
DKK	Couronne danoise	PHP	Peso philippin
EUR	Euro	PKR	Roupie pakistanaise
GBP	Livre sterling	PLN	Zloty polonais
HKD	Dollar de Hong Kong	SEK	Couronne suédoise
IDR	Roupie indonésienne	SGD	Dollar de Singapour
ILS	Shekel israélien	THB	Baht thaïlandais
INR	Roupie indienne	TWD	Nouveau dollar taïwanais
JPY	Yen japonais	USD	Dollar américain
KRW	Won sud-coréen	ZAR	Rand sud-africain



KPMG s.r.l./s.e.n.c.r.l.

Bay Adelaide Centre
333, rue Bay, bureau 4600
Toronto (Ontario) M5H 2S5
Canada
Téléphone 416-777-8500
Télécopieur 416-777-8818

RAPPORT DE L'AUDITEUR INDÉPENDANT

Aux porteurs de parts et au fiduciaire des

FNB indiciel d'obligations canadiennes Scotia
FNB indiciel d'actions internationales Scotia
FNB indiciel d'actions américaines Scotia
FNB indiciel d'actions américaines à investissement responsable Scotia
FNB indiciel d'actions des marchés émergents Scotia
FNB indiciel d'actions canadiennes à grande capitalisation Scotia
FNB indiciel d'obligations canadiennes à investissement responsable Scotia
FNB indiciel d'actions canadiennes à investissement responsable Scotia
FNB indiciel d'actions internationales à investissement responsable Scotia

(collectivement, les « Fonds »)

Opinion

Nous avons effectué l'audit des états financiers des Fonds, qui comprennent :

- les états de la situation financière au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022;
- les états du résultat global pour les périodes closes à cette date, selon ce qui est indiqué à la note 1;
- les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables pour les périodes closes à cette date, selon ce qui est indiqué à la note 1;
- les tableaux des flux de trésorerie pour les périodes closes à cette date, selon ce qui est indiqué à la note 1;
- ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des informations significatives sur les méthodes comptables;

(ci-après, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière des Fonds au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, ainsi que de leur performance financière et de leurs flux de trésorerie pour les périodes closes à cette date, selon ce qui est indiqué à la note 1, conformément aux normes IFRS de comptabilité.

Fondement de l'opinion

Nous avons effectué nos audits conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « **Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers** » de notre rapport de l'auditeur.

Nous sommes indépendants des Fonds conformément aux règles de déontologie qui s'appliquent à nos audits des états financiers au Canada et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités déontologiques qui nous incombent selon ces règles.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe à la direction. Les autres informations se composent :

- des informations contenues dans les rapports annuels de la direction sur le rendement du fonds de chacun des Fonds.

Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons et n'exprimerons aucune forme d'assurance que ce soit sur ces informations.

En ce qui concerne nos audits des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations désignées ci-dessus et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours des audits, et à demeurer attentifs aux éléments indiquant que les autres informations semblent comporter une anomalie significative.

Nous avons obtenu les informations contenues dans les rapports annuels de la direction sur le rendement du fonds de chacun des Fonds déposés auprès des commissions des valeurs mobilières canadiennes compétentes à la date du présent rapport de l'auditeur. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués sur ces autres informations, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans ces autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait dans le rapport de l'auditeur.

Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

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

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

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

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

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

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion.

L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister.

Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

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

En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;

- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour les audits afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne des Fonds;
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que des informations y afférentes fournies par cette dernière;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par la direction du principe comptable de continuité de l'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité des Fonds à poursuivre leur exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport de l'auditeur sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport de l'auditeur. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener les Fonds à cesser leur exploitation;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle;



Page 4

- nous communiquons aux responsables de la gouvernance notamment l'étendue et le calendrier prévus des travaux des audits et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de nos audits.
- nous fournissons aux responsables de la gouvernance une déclaration précisant que nous nous sommes conformés aux règles de déontologie pertinentes concernant l'indépendance, et leur communiquons toutes les relations et les autres facteurs qui peuvent raisonnablement être considérés comme susceptibles d'avoir des incidences sur notre indépendance ainsi que les sauvegardes connexes, s'il y a lieu.

KPMG A.R.L. / S.E.N. C.R.L.

Comptables professionnels agréés, experts-comptables autorisés

L'associé responsable de la mission d'audit au terme de laquelle le présent rapport de l'auditeur est délivré est Peter Hayes.

Toronto, Canada

Le 21 mars 2024

Cette page a été laissée en blanc intentionnellement.

Pour en savoir plus sur les FNB Scotia :
www.banquescotia.com/FNB
1-866-977-0477

Gestion d'actifs 1832 S.E.C.
40, rue Temperance, 16^e étage
Toronto (Ontario)
M5H 0B4

Scotia Gestion mondiale d'actifs[®]