

**Portefeuilles
fdp**



**États financiers
semestriels
non audités**

Relevés des placements
Au 30 juin 2021



États financiers semestriels (non audités) – Avis

Les états financiers semestriels non audités ci-joints n'ont pas fait l'objet d'une revue par les auditeurs externes des Portefeuilles.

Table des matières

Le présent rapport semestriel non audité comprend :

- ♦ les états de la situation financière au 30 juin 2021 (non audités) et au 31 décembre 2020 ;
- ♦ les états de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (non audités) pour les semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020 ;
- ♦ les états du résultat global (non audités) pour les semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020 ;
- ♦ les tableaux des flux de trésorerie (non audités) pour les semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020 ;
- ♦ les relevés des placements au 30 juin 2021 (non audités) ;
- ♦ et les notes afférentes aux états financiers pour les semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020 (non audités) pour les Portefeuilles suivants :

| | |
|--|----|
| Portefeuille FDP Équilibré | 2 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | 6 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | 11 |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 15 |
| Portefeuille FDP Gestion des liquidités | 21 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 27 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 46 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 55 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 64 |
| Portefeuille FDP Actions américaines | 72 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 76 |
| Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) pour les semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020 | 80 |

Portefeuille FDP Équilibré

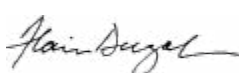
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 538 529 | 510 197 |
| Encaisse | 9 599 | 7 664 |
| Garanties à recevoir en trésorerie | — | 1 |
| Souscriptions à recevoir | 80 | 269 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 126 | 185 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 175 | 175 |
| | 548 509 | 518 491 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Rachats à payer | — | 997 |
| Frais de gestion à payer | 77 | 74 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 84 | 56 |
| | 161 | 1 127 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 548 348 | 517 364 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 28 350 | 28 223 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 19,342 | 18,331 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|----------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 517 364 | 477 181 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 31 626 | 28 |
| | 548 990 | 477 209 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (2 930) | (2 560) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (2 930) | (2 560) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 40 582 | 32 733 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 2 930 | 2 560 |
| Rachats de parts rachetables | (41 224) | (32 940) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 2 288 | 2 353 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 548 348 | 477 002 |

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Intérêts | 13 | 55 |
| Autres revenus | 175 | 1 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s | | |
| sur la vente de placements | 11 238 | 6 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats à terme | (1) | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (18) | 2 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 3 647 | 3 377 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 17 236 | (2 878) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 1 | 4 |
| | 32 291 | 567 |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 456 | 399 |
| Honoraires d'audit | 4 | 6 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 4 | 5 |
| Frais de garde | 43 | 9 |
| Frais juridiques | 13 | 2 |
| Droits et dépôts | 8 | 13 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 14 | 12 |
| Autres | 13 | 4 |
| Coût d'opération (note 9) | 35 | 3 |
| | 590 | 453 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 31 701 | 114 |
| Retenues fiscales étrangères | (75) | (86) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 31 626 | 28 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 31 626 | 28 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 28 357 | 28 216 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 1,115 | 0,001 |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 31 626 | 28 |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (11 238) | (6) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 18 | (2) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (17 236) | 2 878 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (1) | (4) |
| Distribution des revenus des fonds sous-jacents | (3 038) | (2 779) |
| Achats de placements | (81 115) | (30 802) |
| Produit de la vente de placements | 84 295 | 39 000 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Garanties à recevoir en trésorerie | 1 | (1) |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 59 | 16 |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | — | 219 |
| Frais de gestion à payer | 3 | (3) |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 28 | (74) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 3 402 | 8 470 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 40 771 | 32 412 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (42 221) | (33 070) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (1 450) | (658) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 1 952 | 7 812 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (18) | 2 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 1 | 4 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 7 664 | 4 997 |
| Encaisse à la clôture de la période | 9 599 | 12 815 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | — | 55 |
| Retenues d'impôts | 91 | 89 |

Portefeuille FDP Équilibré

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Marché monétaire (1,25 %) | | | |
| Municipalités (1,25 %) | | | |
| Administration Régionale Kativik | | | |
| 1,750 %, 2021-10-12 | 97 000 | 97 333 | 97 333 |
| Collège du Sacré-Cœur de Sherbrooke | | | |
| 2,400 %, 2022-03-01 | 339 000 | 343 150 | 343 150 |
| Sherbrooke CSC | | | |
| 2,150 %, 2021-12-13 | 211 000 | 212 533 | 212 533 |
| Ville de Acton Vale | | | |
| 1,550 %, 2022-03-17 | 107 000 | 107 750 | 107 750 |
| Ville de Beauharnois | | | |
| 2,050 %, 2022-03-29 | 156 000 | 157 715 | 157 715 |
| Ville de Brossard | | | |
| 2,100 %, 2022-04-09 | 96 000 | 97 132 | 97 132 |
| Ville de L'Assomption | | | |
| 1,900 %, 2021-09-01 | 334 000 | 334 768 | 334 768 |
| Ville de Lévis | | | |
| 2,000 %, 2022-03-08 | 227 000 | 229 236 | 229 236 |
| Ville de Longueuil | | | |
| 1,800 %, 2021-11-16 | 163 000 | 163 776 | 163 776 |
| Ville de Mascouche | | | |
| 2,650 %, 2021-10-02 | 351 000 | 352 879 | 352 879 |
| Ville de Montréal-Est | | | |
| 2,000 %, 2022-01-27 | 132 000 | 133 096 | 133 096 |
| Ville de Repentigny | | | |
| 1,150 %, 2022-03-24 | 211 000 | 211 905 | 211 905 |
| 2,300 %, 2021-09-26 | 112 000 | 112 465 | 112 465 |
| Ville de Saguenay | | | |
| 1,850 %, 2021-10-26 | 93 000 | 93 392 | 93 392 |
| 2,350 %, 2021-10-25 | 443 000 | 445 551 | 445 551 |
| 2,800 %, 2021-10-18 | 94 000 | 94 633 | 94 633 |
| 4,000 %, 2021-10-18 | 109 000 | 110 121 | 110 121 |
| Ville de Saint-Constant | | | |
| 0,600 %, 2021-09-30 | 173 000 | 173 035 | 173 035 |
| Ville de Sainte-Marie | | | |
| 2,500 %, 2022-04-24 | 111 000 | 112 733 | 112 733 |
| Ville de Sainte-Marthe-sur-le-Lac | | | |
| 2,000 %, 2022-02-22 | 143 000 | 144 329 | 144 329 |
| Ville de Saint-Félicien | | | |
| 2,050 %, 2022-02-28 | 142 000 | 143 398 | 143 398 |
| Ville de Salaberry-de-Valleyfield | | | |
| 2,250 %, 2021-11-01 | 146 000 | 146 836 | 146 836 |
| Ville de Shawinigan | | | |
| 2,000 %, 2021-10-09 | 100 000 | 100 399 | 100 399 |
| Ville de Sherbrooke | | | |
| 1,750 %, 2022-06-08 | 182 000 | 184 271 | 183 956 |
| 1,850 %, 2021-11-02 | 923 000 | 927 094 | 927 094 |
| Ville de Terrebonne | | | |
| 1,800 %, 2021-07-27 | 186 000 | 186 175 | 186 175 |
| 2,000 %, 2021-12-05 | 138 000 | 138 868 | 138 868 |
| 2,100 %, 2021-11-22 | 291 000 | 292 786 | 292 786 |
| 2,100 %, 2021-12-21 | 101 000 | 101 745 | 101 745 |
| Ville de Thetford Mines | | | |
| 2,050 %, 2021-11-04 | 127 000 | 127 658 | 127 658 |
| Ville de Trois-Rivières | | | |
| 2,300 %, 2021-10-26 | 113 000 | 113 638 | 113 638 |
| Ville de Val-d'Or | | | |
| 2,050 %, 2021-07-30 | 150 000 | 150 187 | 150 187 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|----------------------------|---------------------|-----------------------|
| Ville de Varennes | | | |
| 1,750 %, 2021-10-18 | 99 000 | 99 360 | 99 360 |
| 2,050 %, 2022-03-28 | 195 000 | 197 137 | 197 137 |
| Ville de Vaudreuil-Dorion | | | |
| 2,200 %, 2021-12-04 | 91 000 | 91 645 | 91 645 |
| 2,500 %, 2021-07-24 | 133 000 | 133 168 | 133 168 |
| Total du marché monétaire | | 6 861 897 | 6 861 582 |
| | Nombre de parts | | |
| Fonds de placements (96,96 %) | | | |
| Fonds d'actions (48,70 %) | | | |
| Portefeuille FDP Actions américaines | 166 590 | 2 409 277 | 3 278 487 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 6 176 576 | 139 443 937 | 207 952 974 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 2 011 633 | 22 735 188 | 49 914 644 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergent | 340 470 | 3 909 298 | 5 904 095 |
| | | 168 497 700 | 267 050 200 |
| Fonds d'obligations (35,74 %) | | | |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 13 964 144 | 168 785 337 | 170 502 195 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 2 710 219 | 26 113 231 | 25 470 635 |
| | | 194 898 568 | 195 972 830 |
| Fonds indiciels (12,52 %) | | | |
| iShares Core MSCI EAFE ETF | 178 985 | 15 525 434 | 16 591 755 |
| iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF | 550 000 | 16 669 111 | 17 633 000 |
| SPDR S&P 500 ETF Trust | 64 934 | 15 639 428 | 34 419 351 |
| | | 47 833 973 | 68 644 106 |
| Total des fonds de placements | | 411 230 241 | 531 667 136 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (17 036) | — |
| Total des placements (98,21 %) | | 418 075 102 | 538 528 718 |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (1,79 %) | | | 9 819 353 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 548 348 071 |

Portefeuille FDP Équilibré

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 5 116 324 \$ (6 759 473 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|-----------------|------------------|------------------|------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 51 163 244 | 9,33 | 67 594 725 | 13,07 |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| AA/Aa/A-2/F-2 | 100,00 | 100,00 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 6 861 582 | 531 667 136 | 4 999 273 | 505 197 965 |
| Encaisse | — | 9 599 487 | — | 7 664 181 |
| Autres actifs | — | 381 358 | — | 629 818 |
| Passifs | — | 161 492 | — | 1 127 368 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, de 28 852 \$ (3 424 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|-----------------|--------------|------------------|--------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 531 667 136 | 53 166 714 | 505 197 965 | 50 519 797 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 53 166 714 \$ (50 519 797 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Le Portefeuille investit principalement dans notre gamme de Portefeuilles FDP.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------------|----------------|--------------------|
| Actions canadiennes | 41,20 | 35,60 |
| Obligations et titres à revenu fixe | 35,70 | 39,30 |
| Actions internationales | 13,20 | 13,20 |
| Actions américaines | 6,90 | 10,70 |
| Encaisse | 3,00 | 1,20 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------------------|--------------------|------------------|-------------|--------------------|
| Fonds de placements | 531 667 136 | — | — | 531 667 136 |
| Instruments de marché monétaire | — | 6 861 582 | — | 6 861 582 |
| Total | 531 667 136 | 6 861 582 | — | 538 528 718 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Fonds de placements | 505 197 965 | — | — | 505 197 965 |
| Instruments de marché monétaire | — | 4 999 273 | — | 4 999 273 |
| Total | 505 197 965 | 4 999 273 | — | 510 197 238 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Équilibré croissance

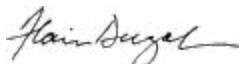
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 260 014 | 215 963 |
| Encaisse | 14 569 | 6 298 |
| Souscriptions à recevoir | 1 790 | 402 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 94 | 118 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 85 | 86 |
| | 276 552 | 222 867 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Montants à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 1 | — |
| Rachats à payer | — | 28 |
| Frais de gestion à payer | 128 | 99 |
| Acquisitions de titres à payer | 5 514 | — |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 45 | 44 |
| | 5 688 | 171 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 270 864 | 222 696 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 13 709 | 11 964 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 19,758 | 18,614 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|----------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 222 696 | 184 422 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 15 431 | (1 881) |
| | 238 127 | 182 541 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (707) | (452) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (707) | (452) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 51 804 | 28 816 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 707 | 452 |
| Rachats de parts rachetables | (19 067) | (19 223) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 33 444 | 10 045 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 270 864 | 192 134 |

Portefeuille FDP Équilibré croissance

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (non audité) |
| Revenus | | |
| Intérêts | 145 | 113 |
| Autres revenus | 86 | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 3 142 | 687 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | 13 | 5 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 1 515 | 1 159 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 11 432 | (3 225) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats de change à terme | (1) | — |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 10 | (1) |
| | 16 342 | (1 262) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 689 | 455 |
| Honoraires d'audit | 4 | 6 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 2 | 4 |
| Frais de garde | 24 | 24 |
| Frais juridiques | 5 | 8 |
| Droits et dépôts | 5 | 5 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 18 | 14 |
| Autres | 11 | 6 |
| Coût d'opération (note 9) | 33 | 18 |
| | 791 | 540 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 15 551 | (1 802) |
| Retenues fiscales étrangères | (120) | (79) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 15 431 | (1 881) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 15 431 | (1 881) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 12 794 | 11 242 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 1,206 | (0,167) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 15 431 | (1 881) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (3 142) | (687) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | (13) | (5) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (11 432) | 3 225 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme | 1 | — |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (10) | 1 |
| Distribution des revenus des fonds sous-jacents | (556) | (517) |
| Achats de placements | (83 329) | (28 168) |
| Produit de la vente de placements | 54 408 | 29 175 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 24 | 31 |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | 1 | 81 |
| Frais de gestion à payer | 29 | (1) |
| Acquisitions de titres à payer | 5 514 | — |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 1 | (44) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | (23 073) | 1 210 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 50 416 | 28 639 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (19 095) | (19 229) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | 31 321 | 9 410 |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 8 248 | 10 620 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | 13 | 5 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 10 | (1) |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 6 298 | 772 |
| Encaisse à la clôture de la période | 14 569 | 11 396 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 143 | 149 |
| Retenues d'impôts | 125 | 78 |

Portefeuille FDP Équilibré croissance

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|----------------------------|---------------------|-----------------------|
| Marché monétaire (1,84 %) | | | |
| Sociétés (1,84 %) | | | |
| Banque Toronto-Dominion 0,149 %, 2021-07-08 | 5 000 000 | 4 999 837 | 4 999 837 |
| Total du marché monétaire | | 4 999 837 | 4 999 837 |
| Obligations (4,93 %) | | | |
| Émises et garanties par le gouvernement du Canada (4,93 %) | | | |
| Gouvernement du Canada 2,250 %, 2029-06-01 | 12 400 000 | 13 568 552 | 13 350 657 |
| Total des obligations | | 13 568 552 | 13 350 657 |
| | Nombre de parts | | |
| Fonds de placements (89,22 %) | | | |
| Fonds d'actions (36,89 %) | | | |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 1 225 055 | 31 271 274 | 41 245 158 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 2 273 577 | 28 018 141 | 56 414 271 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergent | 130 790 | 1 598 574 | 2 268 026 |
| | | 60 887 989 | 99 927 455 |
| Fonds d'obligations (10,76 %) | | | |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 1 792 690 | 21 479 571 | 21 888 745 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 771 154 | 7 358 350 | 7 247 304 |
| | | 28 837 921 | 29 136 049 |
| Fonds indiciels (41,57 %) | | | |
| BMO MSCI EAFE Index ETF | 1 000 | 19 342 | 20 760 |
| BMO NASDAQ 100 Equity Index ETF | 100 | 5 153 | 5 829 |
| Invesco QQQ Trust, série 1 | 25 300 | 6 081 744 | 11 103 934 |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF | 35 000 | 6 163 388 | 6 532 713 |
| iShares Core MSCI EAFE ETF | 436 573 | 38 717 432 | 40 469 941 |
| iShares Core MSCI Emerging Markets ETF | 139 800 | 10 349 761 | 11 596 929 |
| iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF | 165 000 | 5 020 847 | 5 289 900 |
| iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond ETF | 14 100 | 1 999 969 | 1 963 555 |
| iShares NASDAQ 100 Index ETF (CAD-Hedged) | 100 | 10 078 | 11 384 |
| iShares S&P/TSX 60 Index ETF | 358 200 | 8 676 544 | 10 935 846 |
| iShares U.S. Small Cap Index ETF (CAD-Hedged) | 100 | 4 305 | 4 625 |
| Mackenzie Unconstrained Bond ETF | 100 | 2 078 | 2 076 |
| SPDR S&P 500 ETF Trust | 46 461 | 14 908 249 | 24 627 429 |
| Vanguard Growth ETF | 100 | 31 668 | 35 516 |
| | | 91 990 558 | 112 600 437 |
| Total des fonds de placements | | 181 716 468 | 241 663 941 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (48 112) | — |
| Total des placements (95,99 %) | | 200 236 745 | 260 014 435 |
| Contrats de change à terme (- 0,00 %) | | | (1 389) |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (4,01 %) | | | 10 850 866 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 270 863 912 |



Portefeuille FDP Équilibré croissance

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | | Achat | | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|---------------------------------|----------------|-----------|-----|-----------|-----|-------------------|-----------------------------------|
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 2 706 510 | CAD | 2 185 115 | USD | 2 juillet 2021 | (682) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 2 809 310 | CAD | 2 268 111 | USD | 2 juillet 2021 | (707) |
| | | | | | | | (1 389) |
| | | | | | | | (1 389) |

Portefeuille FDP Équilibré croissance

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 9 677 578 \$ (6 860 664 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 96 775 781 | 35,73 | 68 606 638 | 30,81 |

Risque de crédit (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| Titres de créance par cote de crédit | % | % |
| AAA/Aaa/A-1/F-1 | 72,75 | 72,16 |
| AA/Aa/A-2/F-2 | 27,25 | 27,84 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 18 350 494 | 241 663 941 | 17 954 049 | 198 008 564 |
| Encaisse | — | 14 568 637 | — | 6 297 814 |
| Autres actifs | — | 1 969 021 | — | 606 469 |
| Passifs | — | 5 688 181 | — | 170 563 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 043 910 \$ (1 079 203 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 241 663 941 | 24 166 394 | 198 008 564 | 19 800 856 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 24 166 394 \$ (19 800 856 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Le Portefeuille investit principalement dans notre gamme de Portefeuilles FDP.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Actions internationales | 40,40 | 37,70 |
| Actions canadiennes | 20,90 | 20,40 |
| Obligations et titres à revenu fixe | 16,20 | 20,20 |
| Actions américaines | 15,40 | 16,70 |
| Encaisse | 7,10 | 5,00 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|--------------------------------------|--------------------|-------------------|----------------|--------------------|
| Fonds de placements | 241 663 941 | — | — | 241 663 941 |
| Instruments de marchés monétaires | — | 4 999 837 | — | 4 999 837 |
| Obligations | — | 13 350 657 | — | 13 350 657 |
| Total | 241 663 941 | 18 350 494 | — | 260 014 435 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Fonds de placements | 198 008 564 | — | — | 198 008 564 |
| Instruments de marchés monétaires | — | 4 999 273 | — | 4 999 273 |
| Obligations | — | 12 954 776 | — | 12 954 776 |
| Total | 198 008 564 | 17 954 049 | — | 215 962 613 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Équilibré revenu

États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 193 837 | 190 053 |
| Encaisse | 3 689 | 3 703 |
| Souscriptions à recevoir | 15 | 22 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 5 | 6 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 107 | 107 |
| | 197 653 | 193 891 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Rachats à payer | — | 361 |
| Frais de gestion à payer | 6 | 6 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 67 | 58 |
| | 73 | 425 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 197 580 | 193 466 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 15 393 | 15 397 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 12,836 | 12,565 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|----------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 193 466 | 186 791 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 5 758 | 410 |
| | 199 224 | 187 201 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (1 583) | (1 535) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (1 583) | (1 535) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 21 240 | 17 050 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 1 583 | 1 531 |
| Rachats de parts rachetables | (22 884) | (19 936) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (61) | (1 355) |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 197 580 | 184 311 |

Portefeuille FDP Équilibré revenu

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (non audité) |
| Revenus | | |
| Intérêts | 33 | 76 |
| Autres revenus | 107 | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 1 065 | 38 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | — | 2 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 1 518 | 1 592 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 3 101 | (1 204) |
| | 5 824 | 504 |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 31 | 53 |
| Honoraires d'audit | 3 | 3 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 1 | 3 |
| Frais de garde | 21 | 21 |
| Frais juridiques | 7 | — |
| Droits et dépôts | — | 12 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 1 | — |
| Autres | 2 | — |
| | 66 | 92 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 5 758 | 412 |
| Retenues fiscales étrangères | — | (2) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 5 758 | 410 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 5 758 | 410 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 15 359 | 15 534 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 0,375 | 0,026 |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|----------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 5 758 | 410 |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (1 065) | (38) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | — | (2) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (3 101) | 1 204 |
| Distribution des revenus des fonds sous-jacents | (1 518) | (1 577) |
| Achats de placements | — | (6 000) |
| Produit de la vente de placements | 1 900 | 9 044 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 1 | 5 |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | — | 44 |
| Frais de gestion à payer | — | (5) |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 9 | (43) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 1 984 | 3 042 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 21 247 | 17 011 |
| Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties | — | (4) |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (23 245) | (19 963) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (1 998) | (2 956) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | (14) | 86 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | — | 2 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 3 703 | 2 284 |
| Encaisse à la clôture de la période | 3 689 | 2 372 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 34 | 77 |
| Retenues d'impôts | — | 3 |



Portefeuille FDP Équilibré revenu

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|----------------------------|---------------------|-----------------------|
| Obligations (1,35 %) | | | |
| Émises et garanties par la province (1,35 %) | | | |
| Province de l'Ontario | | | |
| 2,700 %, 2029-06-02 | 2 500 000 | 2 663 050 | 2 670 172 |
| Total des obligations | | 2 663 050 | 2 670 172 |
| | Nombre de parts | | |
| Fonds de placements (96,76 %) | | | |
| Fonds d'obligations (56,99 %) | | | |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 7 103 343 | 85 171 653 | 86 731 820 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 2 751 900 | 26 028 084 | 25 862 357 |
| | | 111 199 737 | 112 594 177 |
| Fonds d'actions (39,77 %) | | | |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 3 815 253 | 36 646 299 | 40 880 439 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 1 519 031 | 15 836 623 | 37 691 714 |
| | | 52 482 922 | 78 572 153 |
| Total des fonds de placements | | 163 682 659 | 191 166 330 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (1 048) | — |
| Total des placements (98,11 %) | | 166 344 661 | 193 836 502 |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (1,89 %) | | | 3 743 658 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 197 580 160 |

Portefeuille FDP Équilibré revenu

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 611 \$ (639 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 6 109 | — | 6 389 | — |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| AA/Aa/A-2/F-2 | 100,00 | 100,00 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 2 670 172 | 191 166 330 | 2 804 974 | 187 247 595 |
| Encaisse | — | 3 688 851 | — | 3 702 660 |
| Autres actifs | — | 127 375 | — | 135 459 |
| Passifs | — | 72 568 | — | 424 504 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 208 639 \$ (233 005 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| 191 166 330 | 19 116 633 | 187 247 595 | 18 724 760 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 19 116 633 \$ (18 724 760 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------|-------------------|-----------------------|
| Obligations | 58,30 | 61,60 |
| Actions canadiennes | 20,70 | 18,60 |
| Actions internationales | 19,10 | 19,20 |
| Encaisse | 1,90 | 0,60 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|--------------------|------------------|----------------|--------------------|
| Fonds de placements | 191 166 330 | — | — | 191 166 330 |
| Obligations | — | 2 670 172 | — | 2 670 172 |
| Total | 191 166 330 | 2 670 172 | — | 193 836 502 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Fonds de placements | 187 247 595 | — | — | 187 247 595 |
| Obligations | — | 2 804 974 | — | 2 804 974 |
| Total | 187 247 595 | 2 804 974 | — | 190 052 569 |

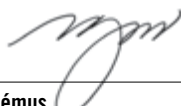
Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Obligations canadiennes

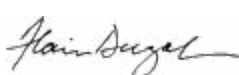
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|---|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 357 063 | 362 686 |
| Encaisse | — | 1 542 |
| Souscriptions à recevoir | 12 | 1 |
| Produit de la vente de placements à recevoir | 83 012 | 6 335 |
| Intérêts et dividendes à recevoir | 1 583 | 1 821 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 9 | 9 |
| | 441 679 | 372 394 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Découvert bancaire | 93 | — |
| Rachats à payer | — | 1 |
| Frais de gestion à payer | 269 | 288 |
| Acquisitions de titres à payer | 92 075 | 6 333 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 116 | 122 |
| | 92 553 | 6 744 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 349 126 | 365 650 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 28 835 | 29 004 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 12,108 | 12,607 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 335 162 | 349 410 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 13 964 | 16 240 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 27 450 | 27 459 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 1 385 | 1 545 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 12,210 | 12,725 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 10,085 | 10,511 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|-----------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 349 410 | 323 896 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | (11 214) | 23 397 |
| | 338 196 | 347 293 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (2 959) | (3 139) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (2 959) | (3 139) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 4 106 | 4 593 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 2 959 | 3 137 |
| Rachats de parts rachetables | (7 140) | (6 172) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (75) | 1 558 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 335 162 | 345 712 |
| SÉRIE I | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 16 240 | 13 465 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | (476) | 1 033 |
| | 15 764 | 14 498 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (203) | (190) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (203) | (190) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 203 | 190 |
| Rachats de parts rachetables | (1 800) | — |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (1 597) | 190 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 13 964 | 14 498 |
| TOTAL DES SÉRIES | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 365 650 | 337 361 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | (11 690) | 24 430 |
| | 353 960 | 361 791 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (3 162) | (3 329) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (3 162) | (3 329) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 4 106 | 4 593 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 3 162 | 3 327 |
| Rachats de parts rachetables | (8 940) | (6 172) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (1 672) | 1 748 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 349 126 | 360 210 |

Portefeuille FDP Obligations canadiennes

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (non audité) |
| Revenus | | |
| Intérêts | 4 509 | 4 904 |
| Dividendes | — | 38 |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 19 | 6 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | (1 046) | 5 913 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | — | (35) |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 144 | — |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | (13 510) | 15 463 |
| | (9 884) | 26 289 |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 1 635 | 1 626 |
| Honoraires d'audit | 4 | 3 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 5 | 5 |
| Frais de garde | 38 | 74 |
| Frais juridiques | 1 | 13 |
| Droits et dépôts | 24 | 2 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 50 | 53 |
| Autres | 18 | 22 |
| Charges pour dividendes | — | 38 |
| Coûts de financement | — | 3 |
| Coût d'opération (note 9) | 31 | 17 |
| | 1 806 | 1 856 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | (11 690) | 24 433 |
| Retenues fiscales étrangères | — | (3) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | (11 690) | 24 430 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | (11 214) | 23 397 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | (476) | 1 033 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 27 500 | 26 798 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 1 503 | 1 331 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | (0,408) | 0,873 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | (0,316) | 0,775 |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | (11 690) | 24 430 |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | 1 046 | (5 913) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | — | 35 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | 13 510 | (15 463) |
| Achats de placements | (3 988 528) | (4 566 366) |
| Produit de la vente de placements | 3 979 595 | 4 564 737 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Produit de la vente de placements à recevoir | (76 677) | (87 045) |
| Intérêts et dividendes à recevoir | 238 | 34 |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | — | 4 |
| Frais de gestion à payer | (19) | 4 |
| Acquisitions de titres à payer | 85 742 | 87 519 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | (6) | (71) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 3 211 | 1 905 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 4 095 | 5 275 |
| Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties | — | (2) |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (8 941) | (6 877) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (4 846) | (1 604) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | (1 635) | 301 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | — | (35) |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 1 542 | 266 |
| Découvert bancaire à la clôture de la période | (93) | 532 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 4 777 | 4 940 |
| Dividendes reçus inclus dans les activités opérationnelles | 2 | 36 |
| Dividendes payés inclus dans les activités opérationnelles | — | 38 |
| Retenues d'impôts | — | 3 |
| Coûts de financement payés inclus dans les activités opérationnelles | — | 3 |

Portefeuille FDP Obligations canadiennes

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Sociétés (suite) | | | |
| Fairfax Financial Holdings Limited | | | |
| 4,950 %, 2025-03-03 | 1 000 000 | 1 079 520 | 1 107 776 |
| Fédération des caisses Desjardins du Québec | | | |
| 1,093 %, 2026-01-21 | 2 000 000 | 2 000 000 | 1 953 649 |
| 1,992 %, 2031-05-28 | 1 000 000 | 1 000 000 | 998 672 |
| 2,417 %, 2024-10-04 | 6 000 000 | 6 194 750 | 6 213 075 |
| Financière Sun Life | | | |
| 2,580 %, 2032-05-10 | 1 000 000 | 999 620 | 1 032 438 |
| 3,050 %, 2028-09-19 | 1 350 000 | 1 420 619 | 1 406 100 |
| Gibson Energy Inc. | | | |
| 2,450 %, 2025-07-14 | 500 000 | 499 020 | 512 258 |
| 3,600 %, 2029-09-17 | 1 000 000 | 1 011 980 | 1 063 487 |
| Granite REIT Holdings Limited Partnership | | | |
| 3,062 %, 2027-06-04 | 1 000 000 | 1 000 000 | 1 051 814 |
| Great-West Lifeco Inc. | | | |
| 3,337 %, 2028-02-28 | 600 000 | 600 000 | 651 549 |
| Hydro One Inc. | | | |
| 2,710 %, 2050-02-28 | 2 000 000 | 1 928 699 | 1 846 031 |
| 4,890 %, 2037-03-13 | 1 000 000 | 1 262 035 | 1 245 760 |
| L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie | | | |
| 3,664 %, 2028-03-15 | 1 700 000 | 1 793 602 | 1 772 404 |
| Lower Mattagami Energy LP | | | |
| 4,944 %, 2043-09-21 | 400 000 | 494 720 | 517 657 |
| Metro inc. | | | |
| 2,680 %, 2022-12-05 | 1 000 000 | 1 015 400 | 1 024 285 |
| 3,390 %, 2027-12-06 | 1 000 000 | 1 120 940 | 1 078 327 |
| 3,413 %, 2050-02-28 | 300 000 | 297 051 | 285 391 |
| North West Redwater Partnership / NWR Financing Company Ltd. | | | |
| 1,200 %, 2023-12-01 | 1 000 000 | 999 690 | 1 001 130 |
| 3,750 %, 2051-06-01 | 1 000 000 | 995 740 | 1 010 950 |
| Nova Scotia Power Incorporated | | | |
| 3,612 %, 2045-05-01 | 300 000 | 300 000 | 315 385 |
| Ontario Power Generation Inc. | | | |
| 3,215 %, 2030-04-08 | 1 000 000 | 1 114 360 | 1 073 486 |
| 3,651 %, 2050-09-13 | 300 000 | 355 173 | 319 964 |
| Pembina Pipeline Corporation | | | |
| 3,540 %, 2025-02-03 | 3 500 000 | 3 745 028 | 3 717 149 |
| 3,710 %, 2026-08-11 | 1 100 000 | 1 219 999 | 1 183 828 |
| 4,750 %, 2048-03-26 | 1 000 000 | 1 098 190 | 1 077 438 |
| Rogers Communications Inc. | | | |
| 3,650 %, 2027-03-31 | 1 000 000 | 1 094 000 | 1 073 958 |
| 6,680 %, 2039-11-04 | 400 000 | 540 521 | 539 675 |
| Saputo inc. | | | |
| 2,242 %, 2027-06-16 | 1 000 000 | 1 004 940 | 1 007 265 |
| Shaw Communications Inc. | | | |
| 6,750 %, 2039-11-09 | 300 000 | 362 931 | 404 213 |
| Société Canadian Tire Limitée | | | |
| 3,167 %, 2023-07-06 | 1 000 000 | 1 050 450 | 1 039 780 |
| Société financière Manuvie | | | |
| 2,818 %, 2035-05-13 | 1 000 000 | 967 600 | 1 022 159 |
| Stantec Inc. | | | |
| 2,048 %, 2027-10-08 | 1 500 000 | 1 500 000 | 1 477 595 |
| Suncor Énergie inc. | | | |
| 3,100 %, 2029-05-24 | 1 000 000 | 1 061 670 | 1 047 039 |
| 3,950 %, 2051-03-04 | 500 000 | 492 730 | 501 553 |
| TELUS Corporation | | | |
| 2,350 %, 2028-01-27 | 1 100 000 | 1 129 851 | 1 111 427 |
| 3,950 %, 2050-02-16 | 1 000 000 | 1 063 065 | 1 004 506 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|-----------------------------|---------------------|-----------------------|
| TransCanada Pipelines Limited | | | |
| 3,800 %, 2027-04-05 | 1 000 000 | 1 120 420 | 1 086 990 |
| 4,340 %, 2049-10-15 | 2 000 000 | 2 096 871 | 2 109 371 |
| TransCanada Trust | | | |
| 4,650 %, 2077-05-18 | 300 000 | 283 704 | 311 419 |
| TriSummit Utilities Inc. | | | |
| 3,150 %, 2026-04-06 | 1 000 000 | 1 012 483 | 1 060 896 |
| 4,260 %, 2028-12-05 | 1 500 000 | 1 688 175 | 1 705 539 |
| WSP Global Inc. | | | |
| 2,408 %, 2028-04-19 | 1 000 000 | 1 002 065 | 1 008 481 |
| | | 160 116 051 | 159 898 528 |
| Municipalités (2,08 %) | | | |
| Ville de Montréal | | | |
| 2,400 %, 2041-12-01 | 2 500 000 | 2 378 975 | 2 378 975 |
| 3,500 %, 2038-12-01 | 3 000 000 | 3 443 400 | 3 384 687 |
| Ville de Toronto | | | |
| 2,800 %, 2049-11-22 | 1 500 000 | 1 569 467 | 1 498 965 |
| | | 7 391 842 | 7 262 627 |
| Total des obligations | | 352 129 066 | 353 292 141 |
| | Nombre d'actions | | |
| Fonds de placements (1,08 %) | | | |
| Fonds indiciels (1,08 %) | | | |
| BMO Equal Weight Banks Index ETF | 31 000 | 1 061 166 | 1 118 790 |
| FNB BMO canadien de dividendes | 65 000 | 1 173 033 | 1 222 650 |
| iShares S&P/TSX Capped Energy ETF | 76 000 | 482 650 | 687 800 |
| iShares U.S. High Yield Bond Index ETF (CAD-Hedged) | 39 000 | 741 034 | 741 390 |
| Total des fonds de placements | | 3 457 883 | 3 770 630 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (558) | — |
| Total des placements (102,27 %) | | 355 586 391 | 357 062 771 |
| Trésorerie et autres passifs net (- 2,27 %) | | | (7 936 426) |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 349 126 345 |

Portefeuille FDP Obligations canadiennes

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 448 \$ (1 490 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|-----------------|------------------|------------------|------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 14 478 | — | 14 895 | — |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| AAA/Aaa/A-1/F-1 | 19,75 | 12,70 |
| AA/Aa/A-2/F-2 | 34,99 | 39,77 |
| A/A-3/F-3 | 21,91 | 23,12 |
| BBB/Baa | 23,35 | 24,41 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--------------------|--------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 353 292 141 | 3 770 630 | 362 685 558 | — |
| Découvert bancaire | — | (92 864) | — | 1 541 830 |
| Autres actifs | — | 84 616 155 | — | 8 166 305 |
| Passifs | — | 92 459 717 | — | 6 743 957 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 39 395 231 \$ (39 160 270 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à détenir de 75 % à 100 % de son actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en actifs portant intérêt.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|-----------------|--------------|------------------|--------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 3 770 630 | 377 063 | — | — |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 377 063 \$ (0 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|------------------------------|----------------|--------------------|
| Fédéral/provincial/municipal | 54,20 | 53,50 |
| Services financiers | 28,30 | 30,00 |
| Énergie | 5,30 | 5,60 |
| Services de communication | 3,30 | 3,40 |
| Services aux collectivités | 3,10 | 3,30 |
| Produits industriels | 1,20 | 1,10 |
| Consommation de base | 1,20 | 2,40 |
| Biens de consommation | 0,30 | 0,30 |
| Autres | — | 0,40 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|------------------|--------------------|-------------|--------------------|
| Fonds de placements | 3 770 630 | — | — | 3 770 630 |
| Obligations | — | 353 292 141 | — | 353 292 141 |
| Total | 3 770 630 | 353 292 141 | — | 357 062 771 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Obligations | — | 362 685 558 | — | 362 685 558 |
| Total | — | 362 685 558 | — | 362 685 558 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Obligations canadiennes

Prêt de titres

Le Portefeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portefeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portefeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------|--------------|------------------|
| | \$ | \$ |
| Juste valeur des titres prêtés | 8 680 652 | 27 355 061 |
| Juste valeur de la garantie | 9 121 804 | 28 736 125 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portefeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portefeuille.

| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
|---|--------------|--------------|
| | \$ | \$ |
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 34 320 | 9 962 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (15 273) | (4 299) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 19 047 | 5 663 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

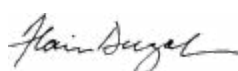
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|---|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 92 926 | 117 819 |
| Encaisse | 1 432 | 525 |
| Souscriptions à recevoir | 841 | 640 |
| Intérêts et dividendes à recevoir | 471 | 615 |
| | 95 670 | 119 599 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Rachats à payer | — | 343 |
| Frais de gestion à payer | 28 | 34 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 8 | 42 |
| | 36 | 419 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 95 634 | 119 180 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 10 266 | 12 731 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 9,316 | 9,361 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|-----------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 119 180 | 71 760 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 59 | 858 |
| | 119 239 | 72 618 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (590) | (606) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (590) | (606) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 60 114 | 90 464 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 590 | 605 |
| Rachats de parts rachetables | (83 719) | (63 656) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (23 015) | 27 413 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 95 634 | 99 425 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (non audité) |
| Revenus | | |
| Intérêts | 810 | 798 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | (119) | 21 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | (358) | 244 |
| | 333 | 1 063 |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 189 | 142 |
| Honoraires d'audit | 4 | 3 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 3 | 5 |
| Frais de garde | 27 | 26 |
| Frais juridiques | 10 | 1 |
| Droits et dépôts | 13 | 14 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 21 | 10 |
| Autres | 7 | 4 |
| | 274 | 205 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 59 | 858 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 59 | 858 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 11 796 | 8 845 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 0,005 | 0,097 |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|-----------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 59 | 858 |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | 119 | (21) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | 358 | (244) |
| Achats de placements | (54 306) | (219 608) |
| Produit de la vente de placements | 78 722 | 194 712 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Intérêts et dividendes à recevoir | 144 | (215) |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | — | (19) |
| Frais de gestion à payer | (6) | 7 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | (34) | (67) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 25 056 | (24 597) |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 59 913 | 88 351 |
| Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties | — | (1) |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (84 062) | (63 504) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (24 149) | 24 846 |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 907 | 249 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 525 | 143 |
| Encaisse à la clôture de la période | 1 432 | 392 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 954 | 583 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Marché monétaire (94,19) | | | | | | | |
| Municipalités (94,19 %) | | | | | | | |
| Administration Régionale Kativik | | | | Sherbrooke CSC | | | |
| 1,750 %, 2021-10-12 | 1 900 000 | 1 906 022 | 1 906 022 | 2,150 %, 2021-12-13 | 1 078 000 | 1 094 952 | 1 086 171 |
| 2,000 %, 2022-03-22 | 254 000 | 257 632 | 256 703 | Société de transport de Laval | | | |
| 2,150 %, 2021-12-05 | 1 446 000 | 1 455 888 | 1 455 888 | 1,850 %, 2022-05-09 | 235 000 | 238 296 | 237 561 |
| 2,750 %, 2021-11-01 | 1 477 000 | 1 487 875 | 1 487 875 | 2,800 %, 2021-12-11 | 1 164 000 | 1 175 588 | 1 175 588 |
| 4,000 %, 2021-10-12 | 100 000 | 103 525 | 100 959 | Société de transport de Lévis | | | |
| Autorité régionale de transport métropolitain | | | | 1,850 %, 2021-10-06 | 100 000 | 101 072 | 100 368 |
| 2,050 %, 2022-02-04 | 901 000 | 908 930 | 908 930 | 2,000 %, 2021-10-10 | 1 056 000 | 1 059 981 | 1 059 981 |
| Bassin de La Prairie | | | | Société de transport de l'Outaouais | | | |
| 1,900 %, 2022-05-24 | 115 000 | 116 732 | 116 351 | 1,850 %, 2022-04-13 | 152 000 | 154 424 | 153 544 |
| Communauté métropolitaine de Montréal | | | | 3,600 %, 2021-09-07 | 100 000 | 100 544 | 100 544 |
| 2,250 %, 2021-12-05 | 1 422 000 | 1 432 332 | 1 432 332 | Société de transport de Sherbrooke | | | |
| Municipalité de Beloeil | | | | 1,850 %, 2021-10-26 | 202 000 | 204 198 | 202 895 |
| 2,000 %, 2021-12-13 | 500 000 | 503 154 | 503 154 | Ville d'Amos | | | |
| Municipalité de Boisbriand | | | | 1,850 %, 2021-11-02 | 148 000 | 149 702 | 148 690 |
| 2,100 %, 2021-12-20 | 271 000 | 275 401 | 273 079 | 1,900 %, 2022-03-14 | 1 000 000 | 1 016 860 | 1 009 670 |
| Municipalité de Brownsburg-Chatham | | | | 2,400 %, 2022-02-27 | 1 049 000 | 1 073 211 | 1 061 997 |
| 1,900 %, 2021-08-20 | 201 000 | 203 002 | 201 406 | Ville de Beauharnois | | | |
| Municipalité de Chambord | | | | 2,050 %, 2022-03-29 | 50 000 | 50 913 | 50 562 |
| 2,650 %, 2022-02-20 | 157 000 | 161 011 | 159 145 | 3,600 %, 2021-09-27 | 142 000 | 146 428 | 143 071 |
| Municipalité de Chelsea | | | | Ville de Bedford | | | |
| 1,900 %, 2021-09-03 | 256 000 | 258 772 | 256 645 | 2,650 %, 2021-08-21 | 138 000 | 138 364 | 138 364 |
| Municipalité de McMasterville | | | | Ville de Blainville | | | |
| 2,600 %, 2022-01-29 | 115 000 | 117 749 | 116 402 | 2,450 %, 2021-07-24 | 686 000 | 687 235 | 686 899 |
| Municipalité de Morin-Heights | | | | 2,600 %, 2021-10-02 | 1 481 000 | 1 488 421 | 1 488 421 |
| 2,750 %, 2021-08-22 | 81 000 | 81 119 | 81 119 | 3,450 %, 2022-06-27 | 100 000 | 103 523 | 102 796 |
| Municipalité de Rawdon | | | | Ville de Bois-des-Filion | | | |
| 0,550 %, 2021-09-01 | 298 000 | 297 865 | 297 865 | 0,600 %, 2021-09-29 | 323 000 | 322 869 | 322 869 |
| 2,350 %, 2021-09-26 | 86 000 | 86 335 | 86 335 | Ville de Bromont | | | |
| Municipalité de Saint-Calixte | | | | 2,050 %, 2021-12-20 | 130 000 | 132 105 | 130 966 |
| 2,050 %, 2022-03-28 | 195 000 | 197 141 | 197 141 | Ville de Brossard | | | |
| Municipalité de Saint-Donat | | | | 2,000 %, 2022-03-08 | 378 000 | 384 234 | 381 844 |
| 2,300 %, 2022-03-27 | 108 000 | 110 339 | 109 407 | 2,100 %, 2022-04-09 | 811 000 | 820 456 | 820 455 |
| Municipalité de Saint-Félix-de-Valois | | | | 2,500 %, 2021-07-25 | 3 495 000 | 3 499 655 | 3 499 655 |
| 2,550 %, 2021-07-24 | 267 000 | 267 277 | 267 277 | Ville de Châteauguay | | | |
| Municipalité régionale de comté de Charlevoix-Est | | | | 4,000 %, 2021-10-04 | 174 000 | 180 222 | 175 606 |
| 2,050 %, 2021-10-08 | 234 000 | 237 054 | 235 006 | Ville de Côte Saint-Luc | | | |
| Municipalité régionale de comté de Témiscouata | | | | 1,900 %, 2022-05-23 | 793 000 | 806 264 | 802 294 |
| 0,500 %, 2022-05-20 | 187 000 | 186 790 | 186 790 | 2,750 %, 2021-10-30 | 277 000 | 283 343 | 279 100 |
| Municipalité régionale de comté du Roché-Percé | | | | 3,900 %, 2021-10-26 | 232 000 | 240 271 | 234 559 |
| 0,400 %, 2022-01-26 | 242 000 | 241 761 | 241 761 | Ville de Coteau-du-Lac | | | |
| Municipalité régionale de comté de Montmagny | | | | 1,000 %, 2022-05-27 | 100 000 | 100 430 | 100 370 |
| 0,450 %, 2022-02-23 | 206 000 | 205 853 | 205 853 | Ville de Cowansville | | | |
| Régie intermunicipale du centre de valorisation des matières résiduelles du Haut-Saint-François et Sherbrooke | | | | 1,850 %, 2022-04-18 | 200 000 | 203 264 | 202 062 |
| 2,650 %, 2021-09-06 | 318 000 | 319 102 | 319 102 | Ville de Delson | | | |
| Régie intermunicipale de gestion des déchets solides de la région de Coaticook | | | | 1,850 %, 2021-08-23 | 408 000 | 408 588 | 408 693 |
| 1,950 %, 2021-08-28 | 82 000 | 82 162 | 82 162 | Ville de Dollard-des-Ormeaux | | | |
| Réseau de transport de la Capitale | | | | 0,600 %, 2021-10-27 | 418 000 | 417 926 | 417 926 |
| 1,800 %, 2021-11-09 | 1 775 000 | 1 794 258 | 1 783 413 | Ville de Drummondville | | | |
| 3,350 %, 2022-02-09 | 114 000 | 117 759 | 115 976 | 2,200 %, 2021-12-05 | 515 000 | 522 372 | 518 832 |
| Réseau de transport métropolitain | | | | 3,700 %, 2021-08-02 | 113 000 | 116 356 | 113 308 |
| 2,400 %, 2022-02-28 | 107 000 | 109 446 | 108 345 | Ville de Gaspé | | | |
| | | | | 2,500 %, 2022-02-20 | 588 000 | 601 483 | 595 468 |
| | | | | Ville de Gatineau | | | |
| | | | | 0,650 %, 2021-09-08 | 4 092 000 | 4 091 079 | 4 091 079 |
| | | | | 2,000 %, 2021-11-30 | 2 000 000 | 2 029 840 | 2 012 740 |
| | | | | 2,150 %, 2021-12-13 | 2 540 000 | 2 558 280 | 2 558 280 |
| | | | | 2,650 %, 2021-09-13 | 1 094 000 | 1 098 492 | 1 098 492 |
| | | | | 3,450 %, 2022-03-07 | 390 000 | 404 660 | 397 598 |
| | | | | 3,600 %, 2021-09-14 | 490 500 | 493 237 | 493 593 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Municipalités (suite) | | | | Ville de Pointe-Claire | | | |
| Ville de Havre-Saint-Pierre | | | | 4,000 %, 2021-07-19 | 320 000 | 330 182 | 320 465 |
| 2,050 %, 2022-02-22 | 214 000 | 217 709 | 216 119 | Ville de Repentigny | | | |
| Ville de Joliette | | | | 3,350 %, 2022-03-28 | 127 000 | 131 618 | 129 571 |
| 0,500 %, 2021-11-10 | 259 000 | 258 842 | 258 842 | 3,600 %, 2021-09-27 | 421 700 | 424 580 | 424 752 |
| 1,850 %, 2021-09-21 | 2 160 000 | 2 182 774 | 2 166 696 | Ville de Rimouski | | | |
| Ville de Kirkland | | | | 2,100 %, 2022-05-28 | 150 000 | 152 974 | 152 050 |
| 2,050 %, 2022-01-27 | 138 000 | 140 164 | 139 232 | Ville de Rivière-du-Loup | | | |
| Ville de Lachute | | | | 1,700 %, 2022-06-13 | 137 000 | 138 819 | 138 423 |
| 0,650 %, 2021-10-28 | 422 000 | 421 862 | 421 862 | 2,050 %, 2021-11-30 | 110 000 | 111 598 | 110 724 |
| 1,950 %, 2022-03-21 | 742 000 | 754 450 | 749 605 | 2,150 %, 2021-12-06 | 407 000 | 409 585 | 409 585 |
| 2,250 %, 2021-10-23 | 306 000 | 311 025 | 307 704 | Ville de Rouyn-Noranda | | | |
| 2,450 %, 2022-02-20 | 200 000 | 204 070 | 202 476 | 1,950 %, 2022-03-14 | 302 000 | 306 973 | 305 026 |
| Ville de L'Ancienne-Lorette | | | | 1,950 %, 2022-06-25 | 150 000 | 152 402 | 151 965 |
| 1,800 %, 2022-03-10 | 132 000 | 133 898 | 133 168 | Ville de Saguenay | | | |
| Ville de L'Assomption | | | | 1,850 %, 2022-04-20 | 1 003 000 | 1 019 065 | 1 013 391 |
| 1,900 %, 2021-08-27 | 108 000 | 109 115 | 108 248 | 2,600 %, 2022-04-26 | 231 000 | 236 114 | 234 851 |
| Ville de Lavaltrie | | | | 2,800 %, 2021-10-18 | 100 000 | 102 212 | 100 698 |
| 1,950 %, 2022-03-21 | 800 000 | 814 240 | 808 200 | 3,350 %, 2022-02-08 | 343 600 | 355 499 | 349 531 |
| Ville de Lévis | | | | 4,000 %, 2021-10-18 | 215 300 | 222 536 | 217 578 |
| 0,650 %, 2021-09-08 | 3 251 000 | 3 250 269 | 3 250 269 | Ville de Saint-Césaire | | | |
| 1,850 %, 2021-09-08 | 353 000 | 353 676 | 353 867 | 1,750 %, 2021-08-23 | 170 000 | 170 229 | 170 229 |
| 2,000 %, 2022-03-08 | 642 000 | 652 143 | 648 529 | Ville de Saint-Eustache | | | |
| 2,650 %, 2021-09-05 | 1 889 000 | 1 895 910 | 1 895 910 | 2,100 %, 2021-11-27 | 1 038 000 | 1 044 474 | 1 044 474 |
| 3,300 %, 2022-06-06 | 750 000 | 778 088 | 768 126 | 2,100 %, 2021-12-20 | 403 000 | 409 255 | 406 091 |
| 3,600 %, 2021-09-14 | 505 000 | 520 589 | 507 881 | 4,000 %, 2021-10-25 | 223 000 | 231 499 | 225 311 |
| 3,700 %, 2021-12-06 | 50 000 | 51 638 | 50 685 | Ville de Saint-Hyacinthe | | | |
| Ville de Longueuil | | | | 2,050 %, 2021-12-06 | 422 000 | 428 402 | 424 882 |
| 1,100 %, 2022-05-06 | 76 000 | 76 439 | 76 340 | 2,450 %, 2022-02-28 | 1 023 000 | 1 047 358 | 1 036 197 |
| 1,800 %, 2021-11-16 | 1 719 000 | 1 739 132 | 1 727 578 | 3,500 %, 2021-09-20 | 200 000 | 205 814 | 201 346 |
| 2,150 %, 2021-11-14 | 112 000 | 113 739 | 112 697 | Ville de Saint-Jean-sur-Richelieu | | | |
| 4,000 %, 2021-10-19 | 922 000 | 956 839 | 931 847 | 1,750 %, 2022-06-13 | 280 000 | 284 127 | 283 041 |
| Ville de Lorraine | | | | 2,000 %, 2021-12-21 | 152 000 | 154 198 | 153 100 |
| 2,800 %, 2021-11-20 | 495 000 | 506 484 | 499 460 | Ville de Saint-Jérôme | | | |
| Ville de Magog | | | | 1,850 %, 2021-09-14 | 525 000 | 527 793 | 526 491 |
| 1,850 %, 2021-09-01 | 750 000 | 757 720 | 751 762 | 2,650 %, 2022-02-05 | 1 321 000 | 1 337 390 | 1 337 390 |
| Ville de Marieville | | | | 4,000 %, 2021-10-13 | 212 700 | 214 635 | 214 718 |
| 2,200 %, 2021-12-05 | 204 000 | 205 338 | 205 338 | Ville de Saint-Lambert | | | |
| Ville de Mascouche | | | | 2,000 %, 2021-07-25 | 1 171 000 | 1 172 172 | 1 172 172 |
| 1,750 %, 2021-07-20 | 100 000 | 100 104 | 100 071 | Ville de Saint-Lazare | | | |
| 2,000 %, 2021-07-25 | 1 446 000 | 1 461 299 | 1 447 533 | 2,800 %, 2021-11-27 | 310 000 | 317 293 | 312 929 |
| 2,650 %, 2021-10-02 | 1 661 000 | 1 669 535 | 1 669 535 | Ville de Sainte-Anne-des-Plaines | | | |
| Ville de Mirabel | | | | 2,050 %, 2022-02-28 | 120 000 | 122 154 | 121 228 |
| 2,000 %, 2021-11-30 | 1 064 000 | 1 076 868 | 1 070 778 | 3,750 %, 2021-11-23 | 102 000 | 105 483 | 103 228 |
| 2,100 %, 2021-09-12 | 53 000 | 53 147 | 53 147 | Ville de Sainte-Julie | | | |
| 2,150 %, 2021-12-12 | 150 000 | 152 395 | 151 131 | 2,150 %, 2021-11-21 | 328 000 | 329 903 | 329 902 |
| Ville de Mont-Laurier | | | | Ville de Salaberry-de-Valleyfield | | | |
| 1,850 %, 2022-04-11 | 500 000 | 507 945 | 505 055 | 1,850 %, 2021-11-02 | 250 000 | 252 928 | 251 165 |
| 2,000 %, 2021-11-29 | 275 000 | 278 850 | 276 727 | 3,300 %, 2022-01-31 | 152 000 | 157 102 | 154 382 |
| Ville de Mont-Saint-Hilaire | | | | Ville de Sept-Îles | | | |
| 2,200 %, 2021-11-29 | 381 000 | 387 458 | 383 705 | 2,650 %, 2021-09-27 | 1 084 000 | 1 089 205 | 1 089 205 |
| Ville de Nicolet | | | | 4,000 %, 2021-10-12 | 126 000 | 130 672 | 127 260 |
| 2,000 %, 2021-12-21 | 88 000 | 89 294 | 88 637 | Ville de Shawinigan | | | |
| Ville de Notre-Dame-de-l'Île-Perrot | | | | 3,400 %, 2022-05-16 | 205 000 | 213 141 | 210 051 |
| 2,100 %, 2022-01-31 | 81 000 | 82 398 | 81 759 | 3,500 %, 2021-12-22 | 310 000 | 320 326 | 314 425 |
| Ville de Pincourt | | | | Ville de Sherbrooke | | | |
| 1,800 %, 2022-05-23 | 400 000 | 405 991 | 404 332 | 3,900 %, 2021-10-20 | 6 170 000 | 6 231 987 | 6 231 987 |
| Ville de Plessisville | | | | Ville de Sorel-Tracy | | | |
| 2,800 %, 2021-10-16 | 128 000 | 130 819 | 128 877 | 2,150 %, 2021-12-15 | 411 000 | 417 897 | 414 152 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Municipalités (suite) | | | |
| Ville de Terrebonne | | | |
| 2,050 %, 2022-05-07 | 75 000 | 76 489 | 75 941 |
| 2,100 %, 2021-12-21 | 322 000 | 327 131 | 324 483 |
| 2,550 %, 2022-01-29 | 114 000 | 116 580 | 115 357 |
| 3,600 %, 2021-12-20 | 234 000 | 242 761 | 237 449 |
| Ville de Trois-Rivières | | | |
| 1,450 %, 2022-04-22 | 1 455 000 | 1 465 083 | 1 465 083 |
| 1,700 %, 2021-10-19 | 141 700 | 141 721 | 142 227 |
| 1,850 %, 2022-04-20 | 250 000 | 254 035 | 252 590 |
| Ville de Val-d'Or | | | |
| 2,700 %, 2021-10-30 | 250 000 | 255 587 | 251 852 |
| Ville de Vaudreuil-Dorion | | | |
| 2,050 %, 2021-11-30 | 290 000 | 294 241 | 291 908 |
| 2,750 %, 2021-12-04 | 250 000 | 255 795 | 252 435 |
| Total du marché monétaire | | 90 462 697 | 90 072 373 |
| Obligations (2,98 %) | | | |
| Municipalités (2,98 %) | | | |
| Municipalité de Morin-Heights | | | |
| 2,850 %, 2022-08-22 | 168 000 | 174 150 | 172 185 |
| Ville de Bois-des-Filion | | | |
| 2,150 %, 2022-08-29 | 164 000 | 167 470 | 166 809 |
| Ville de Bromont | | | |
| 2,700 %, 2022-07-24 | 100 000 | 102 744 | 102 185 |
| Ville de La Prairie | | | |
| 2,250 %, 2022-09-07 | 210 000 | 214 921 | 213 891 |
| Ville de L'Ancienne-Lorette | | | |
| 3,300 %, 2022-07-25 | 485 000 | 505 928 | 498 265 |
| Ville de Lévis | | | |
| 3,300 %, 2022-09-06 | 145 000 | 150 641 | 149 476 |
| Ville de Longueuil | | | |
| 3,350 %, 2022-07-11 | 123 000 | 127 846 | 126 280 |
| Ville de Pointe-Claire | | | |
| 2,150 %, 2022-07-20 | 105 000 | 107 384 | 106 668 |
| Ville de Repentigny | | | |
| 3,300 %, 2022-09-26 | 121 000 | 126 272 | 124 879 |
| Ville de Saint-Hyacinthe | | | |
| 2,200 %, 2022-08-30 | 498 000 | 508 797 | 506 825 |
| Ville de Saint-Lambert | | | |
| 3,300 %, 2022-07-25 | 135 000 | 140 765 | 138 818 |
| Ville de Saint-Lin-Laurentides | | | |
| 2,700 %, 2022-08-27 | 110 000 | 113 765 | 112 577 |
| Ville de Terrebonne | | | |
| 1,850 %, 2022-07-06 | 227 000 | 230 453 | 229 813 |
| Ville de Trois-Rivières | | | |
| 2,450 %, 2022-10-26 | 200 000 | 205 524 | 204 540 |
| Total des obligations | | 2 876 660 | 2 853 211 |
| Total des placements (97,17 %) | | 93 339 357 | 92 925 584 |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (2,83 %) | | | 2 708 401 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 95 633 985 |

Portefeuille FDP Gestion des liquidités

Risque de change (voir note 6)

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille n'était pas directement exposé au risque de change puisqu'il ne détenait aucun placement direct dans des actifs libellés en devises.

Risque de crédit (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| Titres de créance par cote de crédit | % | % |
| R1 Bas | 100,00 | 100,00 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé. Ces titres doivent avoir, en général, une échéance maximale de un an (365 jours) lors de leur date de règlement.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 92 925 584 | — | 117 818 683 | — |
| Encaisse | | 1 432 435 | — | 525 460 |
| Autres actifs | | 1 311 655 | — | 1 254 851 |
| Passifs | | 35 689 | — | 419 243 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 378 375 \$ (742 961 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à détenir 100 % de son portefeuille de placements en actifs portant intérêt.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Durée | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|----------------|----------------|--------------------|
| 0-3 mois | 30,40 | 16,40 |
| 3-6 mois | 44,40 | 22,90 |
| 6-9 mois | 13,20 | 21,30 |
| 9 mois et plus | 12,00 | 39,40 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------------------|-------------|--------------------|-------------|--------------------|
| Obligations | — | 2 853 211 | — | 2 853 211 |
| Instruments de marché monétaire | — | 90 072 373 | — | 90 072 373 |
| Total | — | 92 925 584 | — | 92 925 584 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Obligations | — | 16 057 734 | — | 16 057 734 |
| Instruments de marché monétaire | — | 101 760 949 | — | 101 760 949 |
| Total | — | 117 818 683 | — | 117 818 683 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

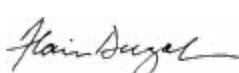
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | 31 décembre 2020 \$ (audité) |
|---|---|---------------------------------------|
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 171 724 | 205 619 |
| Encaisse | 7 461 | 5 198 |
| Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 59 | 3 743 |
| Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats à terme | — | 39 |
| Garanties à recevoir en trésorerie | 634 | 222 |
| Souscriptions à recevoir | 145 | 298 |
| Produit de la vente de placements à recevoir | 1 218 | 338 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 2 111 | 2 627 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 6 | 5 |
| | 183 358 | 218 089 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Montants à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 2 261 | 474 |
| Montants à payer à l'égard des opérations de contrats à terme | 223 | 6 |
| Rachats à payer | — | 114 |
| Frais de gestion à payer | 95 | 104 |
| Acquisitions de titres à payer | 4 384 | 651 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 195 | 170 |
| Autres éléments de passif à payer | 10 | 102 |
| | 7 168 | 1 621 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 176 190 | 216 468 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 17 990 | 22 023 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 9,794 | 9,829 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 62 517 | 61 222 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 113 673 | 155 246 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 6 652 | 6 524 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 11 338 | 15 498 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 9,398 | 9,384 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 10,026 | 10,017 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ (non audité) | 2020 \$ (non audité) |
|---|----------------------------|----------------------------|
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 61 222 | 59 326 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 1 117 | (2 157) |
| | 62 339 | 57 169 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (1 016) | (978) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (1 016) | (978) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 569 | 126 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 1 016 | 978 |
| Rachats de parts rachetables | (391) | (538) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 1 194 | 566 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 62 517 | 56 757 |
| SÉRIE I | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 155 246 | 149 961 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 3 086 | (4 803) |
| | 158 332 | 145 158 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (3 260) | (3 399) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (3 260) | (3 399) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 12 910 | 9 513 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 3 260 | 3 399 |
| Rachats de parts rachetables | (57 569) | (9 622) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (41 399) | 3 290 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 113 673 | 145 049 |
| TOTAL DES SÉRIES | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 216 468 | 209 287 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 203 | (6 960) |
| | 220 671 | 202 327 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (4 276) | (4 377) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (4 276) | (4 377) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 13 479 | 9 639 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 4 276 | 4 377 |
| Rachats de parts rachetables | (57 960) | (10 160) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | (40 205) | 3 856 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 176 190 | 201 806 |

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Intérêts | 4 588 | 4 931 |
| Dividendes | 90 | 127 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | (1 667) | (3 244) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats à terme | 885 | (92) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 11 475 | (7 683) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (684) | 4 046 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 178 | 140 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | (4 191) | (387) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats à terme | (256) | (89) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats de change à terme | (5 471) | (3 945) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 59 | 82 |
| | 5 006 | (6 114) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 602 | 569 |
| Honoraires d'audit | 5 | 5 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 2 | 4 |
| Frais de garde | 80 | 130 |
| Frais juridiques | 7 | 9 |
| Droits et dépôts | 6 | 10 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 33 | 36 |
| Autres | 16 | 13 |
| Coût d'opération (note 9) | 18 | 24 |
| | 769 | 800 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 4 237 | (6 914) |
| Retenues fiscales étrangères | (34) | (46) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 203 | (6 960) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 1 117 | (2 157) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 3 086 | (4 803) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 6 584 | 6 371 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 14 325 | 15 265 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 0,170 | (0,339) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 0,215 | (0,315) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|-----------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 203 | (6 960) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | 1 667 | 3 244 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur contrats de change à terme | (11 475) | 7 683 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 684 | (4 046) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | 4 191 | 387 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats à terme | 256 | 89 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme | 5 471 | 3 945 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (59) | (82) |
| Achats de placements | (151 526) | (87 235) |
| Produit de la vente de placements | 179 563 | 85 609 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | (1) | — |
| Garanties à recevoir en trésorerie | (412) | (524) |
| Produit de la vente de placements à recevoir | (880) | (614) |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 516 | 41 |
| Frais de gestion à payer | (9) | (7) |
| Acquisitions de titres à payer | 3 733 | 855 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 25 | (129) |
| Autres éléments de passifs à payer | (92) | 66 |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 35 855 | 2 322 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 13 632 | 9 668 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (58 074) | (10 116) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (44 442) | (448) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | (8 587) | 1 874 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 11 475 | (7 683) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (684) | 4 046 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 59 | 82 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 5 198 | 7 926 |
| Encaisse à la clôture de la période | 7 461 | 6 245 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 5 091 | 4 968 |
| Dividendes reçus inclus dans les activités opérationnelles | 105 | 123 |
| Retenues d'impôts | 38 | 53 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Obligations (82,60 %) | | | |
| Allemagne (1,14 %) | | | |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 %, 2027-02-11 | 305 000 | 445 606 | 453 336 |
| Deutsche Bank AG 6,000 %, 2025-10-30 | 200 000 | 267 396 | 262 829 |
| E.ON SE 0,375 %, 2027-09-29 | 10 000 | 16 039 | 14 880 |
| Gruenenthal GMBH 4,125 %, 2028-05-15 | 160 000 | 240 517 | 242 690 |
| KfW 1,125 %, 2022-05-12 | 480 000 | 72 982 | 69 462 |
| Landwirtschaftliche Rentenbank 2,700 %, 2022-09-05 | 120 000 | 114 334 | 114 976 |
| 5,375 %, 2024-04-23 | 125 000 | 128 562 | 121 191 |
| Nidda BondCo GmbH 5,000 %, 2025-09-30 | 130 000 | 191 415 | 192 122 |
| Nidda Healthcare Holding AG 3,500 %, 2024-09-30 | 210 000 | 309 209 | 308 128 |
| Novelis Sheet Ingot GmbH 3,375 %, 2029-04-15 | 135 000 | 200 486 | 203 763 |
| | | 1 986 546 | 1 983 377 |
| Arabie Saoudite (0,31 %) | | | |
| Saudi Arabian Oil Company 3,500 %, 2029-04-16 | 200 000 | 266 840 | 268 696 |
| 4,375 %, 2049-04-16 | 200 000 | 262 526 | 285 899 |
| | | 529 366 | 554 595 |
| Argentine (0,18 %) | | | |
| Pampa Energia SA 7,500 %, 2027-01-24 | 290 000 | 375 540 | 322 342 |
| Australie (0,91 %) | | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Limited 0,625 %, 2023-02-21 | 153 000 | 238 099 | 228 580 |
| Export Finance & Insurance Corp. 0,515 %, 2024-01-29 | 80 000 | 76 739 | 74 844 |
| FMG Resources (August 2006) Pty Limited 4,375 %, 2031-04-01 | 294 000 | 370 405 | 389 969 |
| Gouvernement d'Australie 0,250 %, 2025-11-21 | 165 000 | 153 657 | 150 719 |
| 0,500 %, 2026-09-21 | 190 000 | 181 285 | 173 652 |
| 1,750 %, 2051-06-21 | 100 000 | 91 709 | 82 281 |
| New South Wales Treasury Corporation 1,000 %, 2024-02-08 | 65 000 | 62 948 | 61 525 |
| 1,250 %, 2025-03-20 | 105 000 | 102 209 | 99 917 |
| Sydney Airport Finance Company Property Limited 3,625 %, 2026-04-28 | 95 000 | 124 671 | 127 937 |
| Treasury Corporation of Victoria 2,250 %, 2021-10-29 | 120 000 | 110 867 | 112 370 |
| Western Australian Treasury Corporation 2,500 %, 2024-07-23 | 110 000 | 115 612 | 108 647 |
| | | 1 628 201 | 1 610 441 |
| Autriche (0,10 %) | | | |
| République d'Autriche 0,500 %, 2029-02-20 | 115 000 | 175 060 | 177 882 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Belgique (0,28 %) | | | |
| Ontex Group NV 3,500 %, 2026-07-15 | 335 000 | 494 135 | 491 935 |
| Bermudes (0,23 %) | | | |
| Viking Cruises Ltd. 5,875 %, 2027-09-15 | 164 000 | 226 646 | 200 939 |
| 6,250 %, 2025-05-15 | 115 000 | 159 237 | 142 253 |
| Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd. 5,625 %, 2029-02-15 | 50 000 | 64 025 | 62 695 |
| | | 449 908 | 405 887 |
| Brésil (0,89 %) | | | |
| Light Servicos de Eletricidade SA / Light Energia SA 4,375 %, 2026-06-18 | 415 000 | 505 490 | 517 749 |
| République fédérative du Brésil 10,000 %, 2023-01-01 | 1 180 000 | 308 423 | 302 109 |
| 10,000 %, 2025-01-01 | 1 525 000 | 421 219 | 397 150 |
| 10,000 %, 2027-01-01 | 885 000 | 237 293 | 231 640 |
| Simpar Finance SARL 10,750 %, 2028-02-12 | 545 000 | 128 839 | 123 932 |
| | | 1 601 264 | 1 572 580 |
| Canada (7,58 %) | | | |
| 1011778 B.C. Unlimited Liability Company / New Red Finance, Inc. 3,500 %, 2029-02-15 | 186 000 | 226 062 | 227 733 |
| 3,875 %, 2028-01-15 | 202 000 | 262 327 | 253 576 |
| 4,000 %, 2030-10-15 | 282 000 | 372 112 | 338 288 |
| 4,250 %, 2024-05-15 | 75 000 | 102 806 | 93 952 |
| 4,375 %, 2028-01-15 | 175 000 | 231 535 | 219 985 |
| 1011778 B.C. Unlimited Liability Company prêt à terme B4 1,854 %, 2026-11-19 | 149 620 | 179 734 | 183 046 |
| Air Canada 4,000 %, 2025-07-01 | 231 000 | 371 753 | 444 346 |
| Banque de Montréal 0,125 %, 2023-03-26 | 176 000 | 271 912 | 261 078 |
| 0,625 %, 2024-02-01 | 110 000 | 106 568 | 110 432 |
| 3,250 %, 2022-10-06 | 110 000 | 106 711 | 106 021 |
| Banque Royale du Canada 1,600 %, 2023-04-17 | 10 000 | 13 242 | 12 655 |
| Bausch Health Companies Inc. 5,000 %, 2028-01-30 | 141 000 | 188 943 | 165 898 |
| 5,250 %, 2030-01-30 | 120 000 | 161 403 | 138 380 |
| 5,250 %, 2031-02-15 | 45 000 | 58 797 | 52 174 |
| 5,500 %, 2025-11-01 | 60 000 | 82 559 | 76 323 |
| 9,000 %, 2025-12-15 | 55 000 | 79 896 | 73 116 |
| Baytex Energy Corp. 8,750 %, 2027-04-01 | 623 000 | 696 007 | 778 288 |
| Bombardier Inc. 7,125 %, 2026-06-15 | 160 000 | 193 752 | 207 688 |
| Brookfield Residential Properties Inc. / Brookfield Residential US Corp. 6,250 %, 2027-09-15 | 366 000 | 486 579 | 479 910 |
| Cenovus Energy Inc. 3,500 %, 2028-02-07 | 100 000 | 102 621 | 104 881 |
| 5,250 %, 2037-06-15 | 39 000 | 51 121 | 57 883 |
| 5,400 %, 2047-06-15 | 69 000 | 91 749 | 105 958 |
| 6,750 %, 2039-11-15 | 250 000 | 411 208 | 421 274 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|-------------------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Canada (suite) | | | | Chili (0,09 %) | | | |
| Enbridge Inc. | | | | République du Chili | | | |
| 3,125 %, 2029-11-15 | 100 000 | 135 887 | 132 750 | 1,625 %, 2025-01-30 | 105 000 | 163 367 | 163 190 |
| Exportation et développement Canada | | | | Colombie (0,36 %) | | | |
| 0,875 %, 2021-12-07 | 140 000 | 226 029 | 240 304 | République de Colombie | | | |
| 2,860 %, 2022-04-15 | 1 000 000 | 192 591 | 191 644 | 3,250 %, 2032-04-22 | 205 000 | 254 013 | 249 272 |
| Fiducie du Canada pour l'habitation | | | | 7,500 %, 2026-08-26 | 450 000 000 | 155 172 | 158 133 |
| 1,250 %, 2026-06-15 | 75 000 | 75 177 | 75 094 | 10,000 %, 2024-07-24 | 618 000 000 | 262 196 | 233 701 |
| 1,950 %, 2025-12-15 | 85 000 | 90 363 | 88 035 | | | 671 381 | 641 106 |
| First Quantum Minerals Ltd. | | | | Émirats Arabe Unis (0,27 %) | | | |
| 6,875 %, 2027-10-15 | 355 000 | 469 026 | 479 578 | Émirat d'Abu Dhabi | | | |
| Garda World Security Corp. | | | | 1,700 %, 2031-03-02 | 170 000 | 223 815 | 203 450 |
| 9,500 %, 2027-11-01 | 236 000 | 321 506 | 324 251 | 3,125 %, 2030-04-16 | 200 000 | 291 021 | 269 681 |
| GFL Environmental Inc. | | | | | | 514 836 | 473 131 |
| 4,000 %, 2028-08-01 | 100 000 | 129 636 | 122 508 | Espagne (1,38 %) | | | |
| 4,750 %, 2029-06-15 | 90 000 | 109 801 | 115 855 | Aedas Homes Opco SL | | | |
| Golden Credit Card Trust | | | | 4,000 %, 2026-08-15 | 105 000 | 153 368 | 158 044 |
| Série 2018-4A, cat. A | | | | Banco Santander, SA | | | |
| 3,440 %, 2025-08-15 | 120 000 | 166 926 | 158 092 | 4,750 %, 2009-12-31 | 200 000 | 243 810 | 251 251 |
| Gouvernement du Canada | | | | Cellnex Telecom, SA | | | |
| 0,250 %, 2024-04-01 | 65 000 | 64 551 | 64 303 | 1,875 %, 2029-06-26 | 100 000 | 159 339 | 149 983 |
| 2,250 %, 2024-03-01 | 349 000 | 359 800 | 364 251 | Grupo Antolin Irausa SA | | | |
| HudBay Minerals, Inc. | | | | 3,500 %, 2028-04-30 | 265 000 | 391 423 | 388 677 |
| 6,125 %, 2029-04-01 | 138 000 | 181 801 | 182 207 | International Consolidated Airlines Group SA | | | |
| IAMGOLD Corporation | | | | 3,750 %, 2029-03-25 | 400 000 | 593 245 | 590 040 |
| 5,750 %, 2028-10-15 | 257 000 | 338 572 | 331 482 | Neinor Homes SA | | | |
| Intertape Polymer Group Inc. | | | | 4,500 %, 2026-10-15 | 100 000 | 150 008 | 150 795 |
| 4,375 %, 2029-06-15 | 185 000 | 222 934 | 232 597 | NH Hotel Group, SA | | | |
| Ivanhoe Mines Ltd. | | | | 4,000 %, 2026-07-02 | 125 000 | 184 497 | 183 723 |
| 2,500 %, 2026-04-15 | 175 000 | 218 662 | 267 367 | Royaume d'Espagne | | | |
| MDC Partners Inc. | | | | 0,250 %, 2024-07-30 | 85 000 | 132 242 | 127 442 |
| 7,500 %, 2024-05-01 | 659 000 | 781 347 | 827 260 | 0,800 %, 2027-07-30 | 85 000 | 134 822 | 131 329 |
| MEG Energy Corp. | | | | Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA | | | |
| 5,875 %, 2029-02-01 | 140 000 | 178 304 | 180 976 | 5,250 %, 2026-04-01 | 200 000 | 296 623 | 306 183 |
| 7,125 %, 2027-02-01 | 315 000 | 410 839 | 416 601 | | | 2 439 377 | 2 437 467 |
| Northrivers Midstream Finance LP | | | | États-Unis (47,30 %) | | | |
| 5,625 %, 2026-02-15 | 400 000 | 522 433 | 515 341 | AECOM | | | |
| NOVA Chemicals Corporation | | | | 5,125 %, 2027-03-15 | 90 000 | 118 507 | 124 445 |
| 5,250 %, 2027-06-01 | 20 000 | 26 269 | 26 724 | AECOM, prêt à terme B | | | |
| Precision Drilling Corporation | | | | 1,854 %, 2028-04-13 | 90 000 | 111 288 | 111 552 |
| 6,875 %, 2029-01-15 | 185 000 | 221 471 | 236 244 | Aethon United BR LP / | | | |
| Province de l'Alberta | | | | Aethon United Finance Corp. | | | |
| 0,625 %, 2025-04-18 | 175 000 | 271 551 | 265 598 | 8,250 %, 2026-02-15 | 235 000 | 298 591 | 315 437 |
| 3,400 %, 2023-12-01 | 30 000 | 32 061 | 31 959 | AHP Health Partners, Inc. | | | |
| Province de la Colombie-Britannique | | | | 5,750 %, 2029-07-15 | 100 000 | 122 845 | 125 687 |
| 2,850 %, 2025-06-18 | 141 000 | 150 626 | 150 895 | Albertsons Cos Inc. / Safeway Inc. / | | | |
| Province de l'Ontario | | | | New Albertsons LP / Albertsons LLC | | | |
| 0,500 %, 2023-12-15 | 105 000 | 176 668 | 180 484 | 4,875 %, 2030-02-15 | 15 000 | 21 697 | 19 833 |
| 1,350 %, 2030-12-02 | 885 000 | 869 807 | 837 693 | 5,750 %, 2025-03-15 | 47 000 | 58 245 | 59 699 |
| 2,900 %, 2028-06-02 | 95 000 | 101 146 | 102 928 | Allied Universal Holdco LLC / | | | |
| 3,450 %, 2045-06-02 | 105 000 | 124 855 | 121 415 | Allied Universal Finance Corp. | | | |
| Province de Québec | | | | 6,625 %, 2026-07-15 | 200 000 | 280 852 | 262 886 |
| 0,200 %, 2025-04-07 | 150 000 | 232 310 | 224 874 | 9,750 %, 2027-07-15 | 170 000 | 246 963 | 232 088 |
| Stoneway Capital Corporation | | | | Ambience Merger Sub, Inc. | | | |
| 10,000 %, 2027-03-01 | 952 002 | 1 264 014 | 347 765 | 4,875 %, 2028-07-15 | 55 000 | 67 862 | 68 447 |
| Tervita Corporation | | | | 7,125 %, 2029-07-15 | 85 000 | 104 877 | 106 571 |
| 11,000 %, 2025-12-01 | 260 000 | 335 406 | 361 150 | | | | |
| TransCanada Pipelines Limited | | | | | | | |
| 4,100 %, 2030-04-15 | 175 000 | 261 887 | 249 228 | | | | |
| | | 14 113 653 | 13 360 338 | | | | |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | Belden Inc. | | | |
| American Airlines, Inc. / | | | | 3,375 %, 2027-07-15 | 316 000 | 477 778 | 477 661 |
| AAdvantage Loyalty IP Ltd. | | | | 3,875 %, 2028-03-15 | 135 000 | 215 904 | 207 163 |
| 5,500 %, 2026-04-20 | 125 000 | 157 656 | 164 075 | Bentley Systems, Incorporated | | | |
| 5,750 %, 2029-04-20 | 105 000 | 141 375 | 140 748 | 0,375 %, 2027-07-01 | 230 000 | 283 785 | 293 353 |
| American Axle & Manufacturing, Inc. | | | | Berkshire Hathaway Finance Corporation | | | |
| 6,250 %, 2026-03-15 | 460 000 | 589 208 | 588 230 | 2,375 %, 2039-06-19 | 100 000 | 166 305 | 184 496 |
| American Tower Corporation | | | | Berkshire Hathaway Inc. | | | |
| 0,500 %, 2028-01-15 | 100 000 | 153 972 | 145 708 | 0,000 %, 2025-03-12 | 100 000 | 149 465 | 147 307 |
| 1,500 %, 2028-01-31 | 105 000 | 122 804 | 126 590 | Berry Global, Inc. | | | |
| 1,875 %, 2030-10-15 | 60 000 | 72 624 | 71 798 | 5,625 %, 2027-07-15 | 40 000 | 55 514 | 52 446 |
| 4,000 %, 2025-06-01 | 55 000 | 74 071 | 75 087 | Billet du Trésor des États-Unis | | | |
| Amsted Industries Incorporated | | | | 0,125 %, 2022-10-31 | 120 000 | 155 405 | 148 561 |
| 4,625 %, 2030-05-15 | 285 000 | 376 998 | 362 180 | 0,250 %, 2025-08-31 | 160 000 | 210 603 | 194 189 |
| APi Group DE, Inc. | | | | 0,375 %, 2025-11-30 | 85 000 | 110 524 | 103 377 |
| 4,125 %, 2029-07-15 | 130 000 | 158 346 | 160 276 | 0,375 %, 2026-01-31 | 210 000 | 267 824 | 254 873 |
| Apple Inc. | | | | 0,500 %, 2026-02-28 | 245 000 | 300 492 | 298 839 |
| 0,875 %, 2025-05-24 | 100 000 | 155 593 | 152 678 | 0,750 %, 2026-05-31 | 50 000 | 60 819 | 61 567 |
| APX Group, Inc. | | | | 2,375 %, 2024-02-29 | 205 000 | 273 595 | 267 278 |
| 6,750 %, 2027-02-15 | 175 000 | 232 549 | 231 355 | Boyd Gaming Corporation | | | |
| Aramark Services, Inc. | | | | 4,750 %, 2031-06-15 | 95 000 | 118 229 | 122 197 |
| 6,375 %, 2025-05-01 | 100 000 | 130 633 | 131 724 | Bravo Residential Funding Trust | | | |
| Aramark Services, Inc., | | | | Série 2019-1, cat. A1C | | | |
| prêt à terme B3 | | | | 3,500 %, 2058-03-25 | 36 593 | 48 793 | 46 510 |
| 1,823 %, 2025-03-11 | 32 000 | 38 530 | 39 291 | Série 2019-NQM1, cat. A1 | | | |
| Archrock Partners LP / | | | | 2,666 %, 2059-07-25 | 38 157 | 50 785 | 47 730 |
| Archrock Partners Finance Corp. | | | | Broadcom Inc. | | | |
| 6,875 %, 2027-04-01 | 350 000 | 470 190 | 461 451 | 4,150 %, 2030-11-15 | 70 000 | 95 320 | 97 301 |
| Arcosa, Inc. | | | | 4,750 %, 2029-04-15 | 106 000 | 145 165 | 152 828 |
| 4,375 %, 2029-04-15 | 140 000 | 175 959 | 176 743 | Brown Group Holding, LLC, prêt à terme B | | | |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / | | | | 3,250 %, 2028-06-07 | 65 000 | 80 663 | 80 168 |
| Ardagh Metal Packaging Finance PLC | | | | Builders FirstSource, Inc. | | | |
| 4,000 %, 2029-09-01 | 200 000 | 253 200 | 246 112 | 5,000 %, 2030-03-01 | 35 000 | 46 538 | 45 631 |
| Asbury Automotive Group, Inc. | | | | 6,750 %, 2027-06-01 | 35 000 | 49 816 | 46 549 |
| 4,500 %, 2028-03-01 | 154 000 | 204 787 | 196 324 | Burlington Coat Factory Warehouse Corporation | | | |
| 4,750 %, 2030-03-01 | 157 000 | 209 263 | 203 502 | prêt à terme B | | | |
| Ascent Resources Utica Holdings LLC / | | | | 2,095 %, 2028-06-24 | 20 000 | 24 525 | 24 720 |
| ARU Finance Corp. | | | | BX Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,875 %, 2029-06-30 | 185 000 | 223 674 | 229 372 | Série 2019-XL, cat. A | | | |
| Atkore Inc. | | | | 0,993 %, 2036-10-15 | 104 106 | 138 773 | 129 229 |
| 4,250 %, 2031-06-01 | 95 000 | 114 480 | 119 295 | Série 2020-BXLP, cat. A | | | |
| Avation Capital SA | | | | 0,873 %, 2036-12-15 | 111 606 | 146 717 | 138 540 |
| 8,250 %, 2026-10-31 | 12 688 | — | — | Cable One, Inc. | | | |
| Avery Dennison Corporation | | | | 4,000 %, 2030-11-15 | 120 000 | 155 180 | 149 339 |
| 1,250 %, 2025-03-03 | 110 000 | 170 320 | 168 520 | Calpine Corporation | | | |
| Ball Corporation | | | | 4,625 %, 2029-02-01 | 125 000 | 167 119 | 152 612 |
| 2,875 %, 2030-08-15 | 95 000 | 126 820 | 115 623 | CAMB Commercial Mortgage Trust | | | |
| 4,000 %, 2023-11-15 | 110 000 | 146 862 | 144 483 | Série 2019-LIFE, cat. A | | | |
| 4,875 %, 2026-03-15 | 251 000 | 344 110 | 346 578 | 1,143 %, 2037-12-15 | 130 000 | 172 367 | 161 543 |
| 5,000 %, 2022-03-15 | 25 000 | 34 895 | 31 812 | Carpenter Technology Corporation | | | |
| 5,250 %, 2025-07-01 | 105 000 | 146 952 | 147 136 | 6,375 %, 2028-07-15 | 315 000 | 427 959 | 428 416 |
| Bank of America Corporation | | | | CCO Holdings, LLC / | | | |
| 2,592 %, 2031-04-29 | 75 000 | 104 267 | 95 813 | CCO Holdings Capital Corp. | | | |
| Beacon Roofing Supply, Inc. | | | | 4,250 %, 2031-02-01 | 30 000 | 41 160 | 37 892 |
| 4,125 %, 2029-05-15 | 230 000 | 287 580 | 284 464 | 4,500 %, 2030-08-15 | 160 000 | 216 020 | 206 541 |
| Beazer Homes USA, Inc. | | | | 4,500 %, 2033-06-01 | 95 000 | 119 306 | 120 522 |
| 5,875 %, 2027-10-15 | 190 000 | 234 517 | 246 606 | 4,750 %, 2030-03-01 | 100 000 | 135 466 | 131 105 |
| 7,250 %, 2029-10-15 | 190 000 | 249 878 | 262 080 | 5,125 %, 2027-05-01 | 175 000 | 238 575 | 227 570 |
| | | | | CDW LLC / CDW Finance Corp. | | | |
| | | | | 4,250 %, 2028-04-01 | 95 000 | 131 144 | 123 875 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | CSC Holdings, LLC | | | |
| CEC Entertainment, LLC | | | | 4,625 %, 2030-12-01 | 100 000 | 138 613 | 121 646 |
| 6,750 %, 2026-05-01 | 45 000 | 56 491 | 57 256 | 5,375 %, 2028-02-01 | 195 000 | 243 925 | 255 763 |
| Centene Corporation | | | | DB Master Finance LLC | | | |
| 2,500 %, 2031-03-01 | 90 000 | 114 165 | 110 054 | Série 2017-1A, cat. A2I | | | |
| 3,000 %, 2030-10-15 | 165 000 | 221 813 | 210 149 | 3,629 %, 2047-11-20 | 58 050 | 73 036 | 73 094 |
| 3,375 %, 2030-02-15 | 215 000 | 290 057 | 278 661 | Série 2019-1A, cat. A2I | | | |
| 4,625 %, 2029-12-15 | 45 000 | 64 125 | 61 353 | 3,787 %, 2049-05-20 | 77 618 | 104 223 | 97 822 |
| CenturyLink, Inc., prêt à terme B | | | | Série 2019-1A, cat. A2II | | | |
| 2,354 %, 2027-03-15 | 418 625 | 551 163 | 512 098 | 4,021 %, 2049-05-20 | 49 125 | 65 474 | 64 453 |
| CF Industries, Inc. | | | | Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC | | | |
| 5,375 %, 2044-03-15 | 20 000 | 31 860 | 30 721 | 8,000 %, 2028-02-01 | 327 000 | 436 552 | 437 871 |
| Charter Communications Operating, LLC / | | | | Delek Logistics Partners LP / | | | |
| Charter Communications Operating | | | | Delek Logistics Finance Corp. | | | |
| Capital Corporation | | | | 7,125 %, 2028-06-01 | 295 000 | 355 932 | 385 887 |
| 2,800 %, 2031-04-01 | 70 000 | 96 204 | 88 716 | Dell International LLC / EMC Corp. | | | |
| 5,050 %, 2029-03-30 | 80 000 | 118 138 | 117 166 | 8,350 %, 2046-07-15 | 63 000 | 98 352 | 127 795 |
| 5,125 %, 2049-07-01 | 110 000 | 151 257 | 162 513 | Dell International LLC, prêt à terme B | | | |
| 5,750 %, 2048-04-01 | 95 000 | 149 978 | 149 987 | 2,000 %, 2025-09-19 | 284 525 | 356 794 | 352 657 |
| 6,484 %, 2045-10-23 | 70 000 | 107 452 | 119 578 | Delta Air Lines, Inc. | | | |
| Cheniere Energy Partners, LP | | | | 2,900 %, 2024-10-28 | 50 000 | 65 650 | 63 035 |
| 4,000 %, 2031-03-01 | 145 000 | 180 769 | 187 858 | 4,375 %, 2028-04-19 | 191 000 | 262 736 | 248 079 |
| 4,500 %, 2029-10-01 | 45 000 | 57 689 | 59 972 | 7,000 %, 2025-05-01 | 221 000 | 314 380 | 319 550 |
| Clarivate Science Holdings Corporation | | | | 7,375 %, 2026-01-15 | 30 000 | 41 489 | 43 618 |
| 3,875 %, 2028-06-30 | 50 000 | 60 512 | 62 556 | Série 2020-1, cat. A, fiducie intermédiaire | | | |
| Clearwater Paper Corp. | | | | 2,500 %, 2029-12-10 | 36 386 | 48 739 | 45 784 |
| 4,750 %, 2028-08-15 | 137 000 | 184 408 | 169 223 | Delta Air Lines, Inc. / SkyMiles IP Ltd. | | | |
| Clearway Energy Operating LLC | | | | 4,500 %, 2025-10-20 | 60 000 | 82 034 | 79 877 |
| 3,750 %, 2031-02-15 | 200 000 | 252 460 | 246 755 | 4,750 %, 2028-10-20 | 480 000 | 670 684 | 661 291 |
| Cleveland-Cliffs Inc. | | | | Diamond Sports Group LLC / | | | |
| 4,875 %, 2031-03-01 | 100 000 | 127 210 | 130 181 | Diamond Sports Finance Co. | | | |
| Coeur Mining, Inc. | | | | 6,625 %, 2027-08-15 | 210 000 | 280 685 | 128 071 |
| 5,125 %, 2029-02-15 | 250 000 | 315 400 | 307 510 | Diebold Nixdorf, Incorporated | | | |
| Colgate Energy Partners III, LLC | | | | 9,375 %, 2025-07-15 | 35 000 | 47 035 | 48 192 |
| 7,750 %, 2026-02-15 | 415 000 | 522 320 | 565 143 | DISH DBS Corporation | | | |
| CommScope, Inc. | | | | 5,875 %, 2022-07-15 | 70 000 | 96 523 | 90 534 |
| 6,000 %, 2026-03-01 | 210 000 | 289 533 | 274 852 | DISH Network Corp. | | | |
| CommScope, Inc., prêt à terme B2 | | | | 3,375 %, 2026-08-15 | 30 000 | 36 995 | 38 003 |
| 3,354 %, 2026-04-04 | 230 888 | 303 438 | 285 066 | Domino's Pizza Master Issuer LLC | | | |
| Continental Resources, Inc. | | | | Série 2015-1A, cat. A2II | | | |
| 5,750 %, 2031-01-15 | 240 000 | 344 158 | 356 259 | 4,474 %, 2045-10-25 | 100 275 | 130 524 | 130 355 |
| CoreLogic, Inc. | | | | Driven Brands Funding LLC | | | |
| 4,500 %, 2028-05-01 | 480 000 | 601 824 | 589 926 | Série 2019-2A, cat. A2 | | | |
| CoStar Group, Inc. | | | | 3,981 %, 2049-10-20 | 68 950 | 90 680 | 90 722 |
| 2,800 %, 2030-07-15 | 125 000 | 169 577 | 157 496 | Série 2018-1A, cat. A2 | | | |
| Covanta Holding Corporation | | | | 4,739 %, 2048-04-20 | 67 900 | 89 751 | 89 807 |
| 5,000 %, 2030-09-01 | 365 000 | 485 450 | 475 812 | Dycom Industries, Inc. | | | |
| CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC | | | | 4,500 %, 2029-04-15 | 319 000 | 402 355 | 398 950 |
| 5,500 %, 2031-06-15 | 630 000 | 760 882 | 813 862 | Edgewell Personal Care Company | | | |
| Crown Americas LLC / | | | | 5,500 %, 2028-06-01 | 65 000 | 89 159 | 85 480 |
| Crown Americas Capital Corp. IV | | | | Energizer Holdings, Inc. | | | |
| 4,500 %, 2023-01-15 | 24 000 | 32 627 | 31 168 | 4,750 %, 2028-06-15 | 176 000 | 239 073 | 223 771 |
| Crown Americas LLC / | | | | Energy Transfer LP | | | |
| Crown Americas Capital Corp. V | | | | 7,125 %, 2099-12-31 | 355 000 | 462 103 | 454 982 |
| 4,250 %, 2026-09-30 | 15 000 | 21 235 | 19 973 | EnLink Midstream Partners, LP | | | |
| Crown Castle International Corp. | | | | 5,450 %, 2047-06-01 | 271 000 | 280 016 | 299 238 |
| 2,250 %, 2031-01-15 | 30 000 | 40 774 | 36 707 | Enphase Energy, Inc., coupon zéro | | | |
| 3,650 %, 2027-09-01 | 115 000 | 152 979 | 157 186 | 0,000 %, 2028-03-01 | 249 000 | 275 442 | 300 358 |
| Crown Cork & Seal Company Inc. | | | | Entegris, Inc. | | | |
| 7,375 %, 2026-12-15 | 80 000 | 120 991 | 121 706 | 3,625 %, 2029-05-01 | 165 000 | 206 217 | 207 446 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | Harvest Midstream I LP | | | |
| Entercom Media Corp. | | | | 7,500 %, 2028-09-01 | 336 000 | 447 299 | 452 683 |
| 6,750 %, 2029-03-31 | 95 000 | 119 401 | 122 345 | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC | | | |
| EQM Midstream Partners, LP | | | | 3,375 %, 2026-06-15 | 280 000 | 339 766 | 349 758 |
| 4,750 %, 2031-01-15 | 75 000 | 91 272 | 95 816 | HCA Inc. | | | |
| EQT Corporation | | | | 3,500 %, 2030-09-01 | 346 000 | 453 351 | 456 727 |
| 3,125 %, 2026-05-15 | 80 000 | 96 736 | 101 650 | 4,125 %, 2029-06-15 | 160 000 | 238 365 | 223 269 |
| 3,900 %, 2027-10-01 | 60 000 | 77 508 | 79 685 | 5,375 %, 2025-02-01 | 185 000 | 261 418 | 258 695 |
| Equinix, Inc. | | | | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | |
| 3,200 %, 2029-11-18 | 125 000 | 164 883 | 166 212 | 3,625 %, 2032-02-15 | 90 000 | 114 624 | 110 203 |
| Etsy, Inc. | | | | 3,750 %, 2029-05-01 | 185 000 | 241 832 | 231 679 |
| 0,250 %, 2028-06-15 | 70 000 | 84 634 | 95 956 | 4,000 %, 2031-05-01 | 180 000 | 235 296 | 225 168 |
| États-Unis (suite) | | | | 4,875 %, 2030-01-15 | 55 000 | 76 434 | 72 840 |
| Everi Holdings Inc. | | | | Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / | | | |
| 5,000 %, 2029-07-15 | 40 000 | 49 532 | 49 532 | Hilton Grand Vacations Borrower Esc | | | |
| Expedia Group, Inc. | | | | 5,000 %, 2029-06-01 | 255 000 | 307 670 | 323 266 |
| 3,800 %, 2028-02-15 | 91 000 | 111 973 | 122 629 | Hilton Grand Vacations Borrower LLC | | | |
| 5,000 %, 2026-02-15 | 48 000 | 66 275 | 67 846 | prêt à terme B | | | |
| Fidelity National Information Services, Inc. | | | | 3,500 %, 2028-05-20 | 50 000 | 60 026 | 62 021 |
| 1,500 %, 2027-05-21 | 100 000 | 150 918 | 155 980 | Host Hotels & Resorts LP | | | |
| First Brands Group LLC | | | | 3,375 %, 2029-12-15 | 25 000 | 30 674 | 32 499 |
| prêt à terme | | | | 3,500 %, 2030-09-15 | 25 000 | 31 329 | 32 521 |
| 6,000 %, 2027-03-30 | 452 633 | 571 630 | 567 970 | Hyatt Hotels Corporation | | | |
| FirstEnergy Corp. | | | | 5,750 %, 2030-04-23 | 95 000 | 139 689 | 142 956 |
| 4,400 %, 2027-07-15 | 95 000 | 133 974 | 128 062 | Icahn Enterprises LP / | | | |
| 7,375 %, 2031-11-15 | 170 000 | 302 940 | 288 634 | Icahn Enterprises Finance Corp. | | | |
| Ford Motor Company | | | | 5,250 %, 2027-05-15 | 20 000 | 27 845 | 25 606 |
| 7,450 %, 2031-07-16 | 30 000 | 49 173 | 48 897 | Insmmed Incorporated | | | |
| Ford Motor Credit Company LLC | | | | 0,750 %, 2028-06-01 | 75 000 | 90 735 | 102 566 |
| 3,350 %, 2022-11-01 | 200 000 | 263 774 | 254 136 | Intel Corporation | | | |
| 3,370 %, 2023-11-17 | 200 000 | 264 638 | 257 054 | 4,000 %, 2022-12-01 | 60 000 | 59 628 | 58 673 |
| 3,375 %, 2025-11-13 | 235 000 | 304 795 | 302 117 | Iron Mountain Incorporated | | | |
| 3,625 %, 2031-06-17 | 500 000 | 619 275 | 631 923 | 4,500 %, 2031-02-15 | 159 000 | 212 257 | 199 597 |
| 3,815 %, 2027-11-02 | 260 000 | 330 011 | 335 762 | iStar Inc. | | | |
| 4,000 %, 2030-11-13 | 200 000 | 259 400 | 259 733 | 4,250 %, 2025-08-01 | 415 000 | 550 746 | 530 108 |
| 5,584 %, 2024-03-18 | 175 000 | 233 039 | 237 603 | J.B. Poindexter & Co., Inc. | | | |
| Fortress Transportation and | | | | 7,125 %, 2026-04-15 | 440 000 | 610 447 | 576 628 |
| Infrastructure Investors LLC | | | | J2 Global, Inc. | | | |
| 9,750 %, 2027-08-01 | 130 000 | 174 181 | 186 456 | 4,625 %, 2030-10-15 | 60 000 | 79 920 | 77 014 |
| Freedom Mortgage Corporation | | | | Jack In The Box Funding, LLC | | | |
| 6,625 %, 2027-01-15 | 240 000 | 297 251 | 299 680 | Série 2019-1A, cat. A2II | | | |
| 8,125 %, 2024-11-15 | 248 000 | 322 132 | 318 542 | 4,476 %, 2049-08-25 | 89 325 | 116 725 | 116 987 |
| Freeport-McMoRan Inc. | | | | Joseph T. Ryerson & Son, Inc. | | | |
| 4,125 %, 2028-03-01 | 25 000 | 33 262 | 32 351 | 8,500 %, 2028-08-01 | 165 000 | 223 344 | 227 523 |
| 4,625 %, 2030-08-01 | 90 000 | 127 762 | 122 187 | JPMorgan Chase & Co. | | | |
| 5,450 %, 2043-03-15 | 245 000 | 384 604 | 371 238 | 2,750 %, 2022-08-24 | 100 000 | 169 002 | 152 240 |
| Gartner, Inc. | | | | KB Home | | | |
| 3,750 %, 2030-10-01 | 185 000 | 230 079 | 234 666 | 4,000 %, 2031-06-15 | 345 000 | 416 432 | 431 486 |
| GCI, LLC | | | | KBR, Inc. | | | |
| 4,750 %, 2028-10-15 | 40 000 | 53 452 | 50 795 | 4,750 %, 2028-09-30 | 240 000 | 316 164 | 297 712 |
| GE Capital Funding, LLC | | | | Ken Garff Automotive LLC | | | |
| 4,400 %, 2030-05-15 | 200 000 | 281 346 | 288 812 | 4,875 %, 2028-09-15 | 100 000 | 131 740 | 126 772 |
| General Motors Financial Company, Inc. | | | | Kinder Morgan, Inc. | | | |
| 3,600 %, 2030-06-21 | 30 000 | 41 830 | 40 261 | 2,000 %, 2031-02-15 | 65 000 | 78 498 | 77 465 |
| Genesis Energy LP / | | | | KNDL Mortgage Trust | | | |
| Genesis Energy Finance Corp. | | | | Série 2019-KNSQ, cat. D | | | |
| 8,000 %, 2027-01-15 | 155 000 | 197 121 | 201 893 | 1,423 %, 2036-05-15 | 100 000 | 134 325 | 124 011 |
| Greif Inc. | | | | Koppers Inc. | | | |
| 6,500 %, 2027-03-01 | 275 000 | 384 470 | 360 317 | 6,000 %, 2025-02-15 | 383 000 | 504 147 | 491 113 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | | | | |
| Kraft Heinz Foods Company | | | | MVW Owner Trust | | | |
| 3,000 %, 2026-06-01 | 24 000 | 33 513 | 31 664 | Série 2018-1A, cat. A | | | |
| 3,875 %, 2027-05-15 | 55 000 | 77 487 | 74 884 | 3,450 %, 2036-01-21 | 46 045 | 61 098 | 59 130 |
| 4,250 %, 2031-03-01 | 150 000 | 216 641 | 211 208 | Nationstar Mortgage Holdings Inc. | | | |
| 4,375 %, 2046-06-01 | 45 000 | 61 503 | 63 248 | 5,500 %, 2028-08-15 | 225 000 | 302 063 | 281 440 |
| 4,625 %, 2039-10-01 | 110 000 | 154 590 | 159 095 | Navient Student Loan Trust | | | |
| 6,875 %, 2039-01-26 | 130 000 | 227 143 | 231 824 | Série 2018-A, cat. A2 | | | |
| 7,125 %, 2039-08-01 | 30 000 | 54 421 | 54 400 | 3,190 %, 2042-02-18 | 61 747 | 77 764 | 77 505 |
| L Brands, Inc. | | | | NBM US Holdings Inc. | | | |
| 6,625 %, 2030-10-01 | 105 000 | 138 322 | 150 662 | 7,000 %, 2026-05-14 | 200 000 | 280 112 | 267 290 |
| Lamb Weston Holdings Inc. | | | | NCR Corp. | | | |
| 4,875 %, 2028-05-15 | 5 000 | 7 306 | 6 857 | 5,000 %, 2028-10-01 | 145 000 | 191 523 | 185 938 |
| Leeward Renewable Energy Operations, LLC | | | | 5,250 %, 2030-10-01 | 70 000 | 92 460 | 90 042 |
| 4,250 %, 2029-07-01 | 95 000 | 116 703 | 119 403 | 8,125 %, 2025-04-15 | 30 000 | 42 038 | 40 697 |
| Legacy LifePoint Health LLC | | | | Nesco Holdings II, Inc. | | | |
| 6,750 %, 2025-04-15 | 105 000 | 148 502 | 138 892 | 5,500 %, 2029-04-15 | 185 000 | 230 843 | 239 394 |
| Level 3 Financing, Inc. | | | | Netflix, Inc. | | | |
| 4,625 %, 2027-09-15 | 30 000 | 41 085 | 38 671 | 3,625 %, 2025-06-15 | 100 000 | 137 074 | 133 355 |
| Liberty Media Corporation | | | | 4,375 %, 2026-11-15 | 50 000 | 71 755 | 70 488 |
| 2,750 %, 2049-12-01 | 125 000 | 163 489 | 162 991 | 4,875 %, 2028-04-15 | 55 000 | 78 976 | 79 261 |
| Liberty Mutual Group Inc. | | | | 5,875 %, 2028-11-15 | 80 000 | 121 886 | 121 721 |
| 3,625 %, 2059-05-23 | 224 000 | 335 433 | 343 544 | New Residential Mortgage Loan Trust | | | |
| LifePoint Health, Inc. | | | | Série 2018-4A, cat. A1S | | | |
| 5,375 %, 2029-01-15 | 55 000 | 71 275 | 66 500 | 0,842 %, 2048-01-25 | 60 068 | 78 407 | 74 614 |
| Lions Gate Capital Holdings, LLC | | | | Newell Brands Inc. | | | |
| 5,500 %, 2029-04-15 | 360 000 | 451 782 | 469 212 | 4,700 %, 2026-04-01 | 30 000 | 42 351 | 41 472 |
| LogMeIn Inc. | | | | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | | | |
| 5,500 %, 2027-09-01 | 350 000 | 468 137 | 449 463 | 2,200 %, 2026-12-02 | 160 000 | 144 323 | 149 979 |
| Lumen Technologies, Inc. | | | | Nicolet Bankshares Inc. | | | |
| 4,500 %, 2029-01-15 | 200 000 | 261 820 | 242 013 | 3,125 %, 2031-07-15 | 20 000 | 24 675 | 24 766 |
| Marriott International, Inc. | | | | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co. | | | |
| 4,625 %, 2030-06-15 | 75 000 | 102 566 | 107 043 | 4,500 %, 2029-07-15 | 80 000 | 96 572 | 99 465 |
| Marriott Ownership Resorts, Inc. | | | | 4,750 %, 2031-07-15 | 85 000 | 102 608 | 105 650 |
| 4,500 %, 2029-06-15 | 85 000 | 103 638 | 106 834 | Obligation du Trésor des États-Unis | | | |
| Marriott Ownership Resorts, Inc., prêt à terme B | | | | 2,000 %, 2026-11-15 | 180 000 | 231 348 | 235 284 |
| 1,850 %, 2025-08-31 | 95 000 | 114 539 | 116 330 | 2,375 %, 2029-05-15 | 110 000 | 150 416 | 147 014 |
| Match Group, Inc. | | | | 2,625 %, 2029-02-15 | 185 000 | 253 545 | 251 251 |
| 4,125 %, 2030-08-01 | 65 000 | 86 433 | 82 059 | 2,750 %, 2042-11-15 | 290 000 | 367 389 | 404 514 |
| Mercer International Inc. | | | | 3,000 %, 2049-02-15 | 710 000 | 974 997 | 1 052 868 |
| 5,125 %, 2029-02-01 | 400 000 | 506 200 | 510 303 | 4,375 %, 2038-02-15 | 280 000 | 455 156 | 477 382 |
| MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc. | | | | Occidental Petroleum Corporation | | | |
| 4,625 %, 2025-06-15 | 20 000 | 27 484 | 26 509 | 3,200 %, 2026-08-15 | 28 000 | 34 422 | 35 032 |
| MGM Resorts International | | | | 3,400 %, 2026-04-15 | 45 000 | 56 383 | 57 134 |
| 4,750 %, 2028-10-15 | 15 000 | 19 800 | 19 773 | 4,400 %, 2046-04-15 | 390 000 | 433 586 | 464 467 |
| Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd. | | | | 6,125 %, 2031-01-01 | 150 000 | 210 877 | 218 767 |
| 6,500 %, 2027-06-20 | 365 000 | 496 915 | 498 194 | 6,625 %, 2030-09-01 | 144 000 | 201 530 | 214 201 |
| MSCI Inc. | | | | 7,500 %, 2031-05-01 | 20 000 | 29 488 | 31 237 |
| 3,625 %, 2030-09-01 | 259 000 | 336 565 | 328 763 | Olin Corporation | | | |
| 3,875 %, 2031-02-15 | 80 000 | 111 624 | 102 937 | 5,625 %, 2029-08-01 | 510 000 | 667 185 | 695 176 |
| MSCI Inc., cat. A | | | | OneMain Finance Corporation | | | |
| 3,625 %, 2031-11-01 | 98 000 | 120 667 | 124 632 | 3,500 %, 2027-01-15 | 205 000 | 249 700 | 256 073 |
| Murphy Oil Corporation | | | | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV | | | |
| 5,750 %, 2025-08-15 | 140 000 | 177 462 | 178 129 | 4,125 %, 2028-04-30 | 200 000 | 251 690 | 252 873 |
| Murphy Oil USA, Inc. | | | | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corporation | | | |
| 3,750 %, 2031-02-15 | 210 000 | 265 020 | 257 391 | 4,250 %, 2029-01-15 | 120 000 | 153 636 | 149 822 |
| | | | | 6,250 %, 2025-06-15 | 160 000 | 225 040 | 210 094 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | Sasol Financing USA LLC | | | |
| Ovintiv Inc. | | | | 5,500 %, 2031-03-18 | 420 000 | 527 877 | 548 951 |
| 6,500 %, 2034-08-15 | 95 000 | 149 822 | 155 548 | SBA Communications Corporation | | | |
| 6,500 %, 2038-02-01 | 20 000 | 31 745 | 33 025 | 3,125 %, 2029-02-01 | 99 000 | 125 285 | 118 483 |
| Owens Corning | | | | 3,875 %, 2027-02-15 | 205 000 | 279 542 | 261 308 |
| 3,950 %, 2029-08-15 | 70 000 | 97 937 | 98 029 | Schweitzer-Mauduit International, Inc. | | | |
| P&L Development LLC / PLD Finance Corp. | | | | 6,875 %, 2026-10-01 | 400 000 | 517 482 | 526 124 |
| 7,750 %, 2025-11-15 | 195 000 | 259 750 | 254 431 | Scientific Games International, Inc. | | | |
| Par Pharmaceutical, Inc. | | | | 3,375 %, 2026-02-15 | 265 000 | 405 012 | 391 410 |
| 7,500 %, 2027-04-01 | 310 000 | 412 781 | 392 957 | SCIH Salt Holdings Inc. | | | |
| Party City Holdings Inc. | | | | 4,875 %, 2028-05-01 | 175 000 | 218 715 | 217 231 |
| 8,750 %, 2026-02-15 | 174 000 | 224 178 | 230 277 | SCIH Salt Holdings Inc., prêt à terme B | | | |
| Patrick Industries Inc. | | | | 4,750 %, 2027-03-16 | 90 000 | 111 936 | 111 807 |
| 4,750 %, 2029-05-01 | 210 000 | 263 624 | 259 130 | SESI LLC | | | |
| 7,500 %, 2027-10-15 | 146 000 | 195 460 | 196 156 | 7,750 %, 2024-09-15 | 200 000 | 175 250 | 97 207 |
| PBF Holding Company LLC / | | | | Sierracol Energy Andina, LLC | | | |
| PBF Finance Corporation | | | | 6,000 %, 2028-06-15 | 390 000 | 469 932 | 489 433 |
| 7,250 %, 2025-06-15 | 250 000 | 308 431 | 235 686 | Silgan Holdings Inc. | | | |
| 9,250 %, 2025-05-15 | 110 000 | 140 722 | 137 397 | 2,250 %, 2028-06-01 | 150 000 | 214 282 | 221 917 |
| Penske Automotive Group, Inc. | | | | Simmons Foods Inc. / Simmons Prepared | | | |
| 3,750 %, 2029-06-15 | 375 000 | 452 644 | 467 841 | Foods Inc. / Simmons Pet Food Inc. / | | | |
| PG&E Corporation | | | | Simmons Feed | | | |
| 5,250 %, 2030-07-01 | 210 000 | 267 473 | 263 251 | 4,625 %, 2029-03-01 | 400 000 | 490 740 | 500 258 |
| Plantronics, Inc. | | | | Sirius XM Radio Inc. | | | |
| 4,750 %, 2029-03-01 | 260 000 | 325 429 | 320 033 | 4,000 %, 2028-07-15 | 235 000 | 285 923 | 300 094 |
| Plastipak Holdings, Inc., prêt à terme B | | | | 4,125 %, 2030-07-01 | 20 000 | 27 550 | 25 046 |
| 2,610 %, 2024-10-14 | 447 433 | 556 250 | 552 918 | 5,000 %, 2027-08-01 | 75 000 | 97 708 | 97 528 |
| Post Holdings, Inc. | | | | Southwest Airlines Co. | | | |
| 4,500 %, 2031-09-15 | 165 000 | 207 331 | 204 238 | 1,250 %, 2025-05-01 | 110 000 | 240 200 | 206 959 |
| 4,625 %, 2030-04-15 | 100 000 | 136 755 | 126 069 | Southwestern Energy Company | | | |
| 5,500 %, 2029-12-15 | 105 000 | 147 965 | 139 732 | 6,450 %, 2025-01-23 | 25 000 | 33 464 | 34 334 |
| 5,625 %, 2028-01-15 | 230 000 | 317 529 | 302 763 | Spectacle Gary Holdings, LLC | | | |
| 5,750 %, 2027-03-01 | 120 000 | 156 869 | 155 654 | Term, prêt B | | | |
| PowerTeam Services LLC | | | | 11,000 %, 2025-12-23 | 685 000 | 875 679 | 926 697 |
| 9,033 %, 2025-12-04 | 430 000 | 583 298 | 586 381 | Term, prêt DD | | | |
| Prime Healthcare Services, Inc. | | | | 11,000 %, 2025-12-23 | 50 000 | 63 918 | 67 642 |
| 7,250 %, 2025-11-01 | 235 000 | 309 239 | 315 413 | Spectrum Brands, Inc. | | | |
| Prime Security Services Borrower, LLC / | | | | 5,500 %, 2030-07-15 | 305 000 | 418 292 | 408 406 |
| Prime Finance, Inc. | | | | Sprint Capital Corporation | | | |
| 3,375 %, 2027-08-31 | 70 000 | 92 638 | 84 189 | 8,750 %, 2032-03-15 | 81 000 | 146 048 | 152 585 |
| 5,750 %, 2026-04-15 | 300 000 | 402 752 | 411 351 | Square, Inc. | | | |
| 6,250 %, 2028-01-15 | 300 000 | 391 275 | 395 644 | 3,500 %, 2031-06-01 | 35 000 | 42 177 | 43 774 |
| Provident Funding Associates LP / | | | | Standard Industries, Inc. | | | |
| PFG Finance Corp. | | | | 3,375 %, 2031-01-15 | 45 000 | 58 556 | 53 414 |
| 6,375 %, 2025-06-15 | 390 000 | 506 988 | 490 930 | 4,750 %, 2028-01-15 | 353 000 | 476 548 | 458 080 |
| PTC Inc. | | | | 5,000 %, 2027-02-15 | 30 000 | 41 769 | 38 519 |
| 4,000 %, 2028-02-15 | 55 000 | 72 729 | 70 593 | Staples Inc. | | | |
| Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc. | | | | 7,500 %, 2026-04-15 | 144 000 | 181 117 | 184 913 |
| 6,500 %, 2028-09-15 | 55 000 | 73 051 | 71 648 | Summer (BC) Bidco B LLC | | | |
| Rain CII Carbon LLC | | | | 5,500 %, 2026-10-31 | 271 000 | 338 223 | 341 600 |
| 7,250 %, 2025-04-01 | 210 000 | 268 343 | 269 373 | Summit Hotel Properties Inc. | | | |
| Renewable Energy Group, Inc. | | | | 1,500 %, 2026-02-15 | 88 000 | 111 773 | 112 839 |
| 5,875 %, 2028-06-01 | 260 000 | 316 953 | 338 568 | SunCoke Energy Partner LP | | | |
| Reynolds Group Issuer Inc. / | | | | 7,500 %, 2025-06-15 | 375 000 | 478 840 | 482 496 |
| Reynolds Group Issuer LLC / | | | | SunCoke Energy, Inc. | | | |
| Reynolds Group Issuer (Luxembourg) SA | | | | 4,875 %, 2029-06-30 | 260 000 | 314 288 | 321 958 |
| 4,000 %, 2027-10-15 | 125 000 | 166 613 | 153 909 | Surgery Center Holdings, Inc. | | | |
| Sabre GBLB Inc. | | | | 10,000 %, 2027-04-15 | 315 000 | 422 935 | 429 469 |
| 4,000 %, 2025-04-15 | 45 000 | 91 759 | 101 695 | Surgery Center Holdings, Inc., prêt à terme | | | |
| | | | | 4,500 %, 2026-08-31 | 44 888 | 54 945 | 55 884 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | | Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC | | | |
| Switch, Ltd. | | | | 3,250 %, 2030-05-15 | 90 000 | 127 387 | 120 768 |
| 4,125 %, 2029-06-15 | 110 000 | 132 209 | 139 959 | Travel + Leisure Co. | | | |
| Taco Bell Funding, LLC | | | | 6,625 %, 2026-07-31 | 75 000 | 107 782 | 105 500 |
| 4,970 %, 2046-05-25 | 139 200 | 194 424 | 186 717 | TriMas Corporation | | | |
| Talen Energy Supply, LLC | | | | 4,125 %, 2029-04-15 | 370 000 | 462 093 | 464 989 |
| 7,625 %, 2028-06-01 | 280 000 | 388 542 | 324 929 | Triumph Group Inc. | | | |
| 10,500 %, 2026-01-15 | 300 000 | 332 189 | 269 098 | 8,875 %, 2024-06-01 | 42 000 | 55 637 | 57 925 |
| Targa Resources Partners LP / | | | | Tronox Inc. | | | |
| Targa Resources Partners Finance Corp. | | | | 4,625 %, 2029-03-15 | 540 000 | 683 478 | 676 198 |
| 4,000 %, 2032-01-15 | 40 000 | 50 944 | 51 018 | U.S. Bancorp | | | |
| 5,500 %, 2030-03-01 | 20 000 | 26 926 | 27 268 | 0,850 %, 2024-06-07 | 270 000 | 408 418 | 407 606 |
| Taylor Morrison Communities, Inc. | | | | 1,375 %, 2030-07-22 | 80 000 | 101 870 | 95 600 |
| 5,875 %, 2027-06-15 | 248 000 | 332 618 | 348 392 | 3,000 %, 2029-07-30 | 65 000 | 85 344 | 87 283 |
| Terex Corporation | | | | Uber Technologies, Inc. | | | |
| 5,000 %, 2029-05-15 | 195 000 | 242 522 | 252 033 | 0,000 %, 2025-12-15 | 110 000 | 147 693 | 138 801 |
| The AES Corporation | | | | 7,500 %, 2025-05-15 | 90 000 | 126 136 | 120 416 |
| 3,950 %, 2030-07-15 | 55 000 | 74 796 | 74 688 | 8,000 %, 2026-11-01 | 80 000 | 107 582 | 107 025 |
| The Boeing Company | | | | United Airlines, fiducie intermédiaire | | | |
| 2,196 %, 2026-02-04 | 80 000 | 99 880 | 100 027 | Série 2020-1, cat. A | | | |
| 5,040 %, 2027-05-01 | 110 000 | 152 785 | 157 244 | 5,875 %, 2029-04-15 | 133 231 | 178 471 | 183 403 |
| 5,150 %, 2030-05-01 | 270 000 | 401 048 | 396 229 | United Airlines, Inc. | | | |
| The Enterprise Development Authority | | | | 4,375 %, 2026-04-15 | 65 000 | 81 497 | 83 422 |
| prêt à terme B | | | | 4,625 %, 2029-04-15 | 65 000 | 81 497 | 83 407 |
| 5,000 %, 2028-02-01 | 523 375 | 656 624 | 651 336 | United Airlines, Inc., prêt à terme B | | | |
| The Goldman Sachs Group, Inc. | | | | 4,500 %, 2028-04-21 | 95 000 | 115 845 | 119 346 |
| 1,375 %, 2024-05-15 | 54 000 | 83 855 | 81 412 | United Rentals (North America), Inc. | | | |
| 2,000 %, 2028-11-01 | 31 000 | 49 468 | 50 325 | 3,875 %, 2031-02-15 | 175 000 | 233 621 | 220 766 |
| 3,375 %, 2025-03-27 | 45 000 | 79 635 | 74 125 | 4,000 %, 2030-07-15 | 195 000 | 260 787 | 249 195 |
| The Hertz Corporation, prêt à terme B | | | | 4,875 %, 2028-01-15 | 90 000 | 119 940 | 118 329 |
| 4,000 %, 2028-06-30 | 82 800 | 101 561 | 102 574 | 5,500 %, 2027-05-15 | 85 000 | 110 979 | 111 702 |
| The Hertz Corporation, prêt à terme C | | | | United States Treasury Inflation Indexed Bond | | | |
| 4,000 %, 2028-06-30 | 15 400 | 18 889 | 19 078 | 0,125 %, 2030-01-15 | 202 350 | 289 535 | 275 271 |
| The Scotts Miracle-Gro Company | | | | United Wholesale Mortgage, LLC | | | |
| 4,000 %, 2031-04-01 | 260 000 | 326 781 | 321 356 | 5,500 %, 2029-04-15 | 245 000 | 309 411 | 303 728 |
| The Williams Companies, Inc. | | | | UnitedHealth Group Incorporated | | | |
| 3,500 %, 2030-11-15 | 25 000 | 35 849 | 33 836 | 2,875 %, 2029-08-15 | 95 000 | 138 187 | 127 019 |
| 3,750 %, 2027-06-15 | 190 000 | 265 080 | 261 562 | Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc. / | | | |
| Thermo Fisher Scientific Inc. | | | | CSL Capital LLC | | | |
| 0,500 %, 2028-03-01 | 105 000 | 151 689 | 156 031 | 6,500 %, 2029-02-15 | 345 000 | 439 392 | 428 878 |
| T-Mobile USA, Inc. | | | | Univision Communications Inc. | | | |
| 2,625 %, 2026-04-15 | 95 000 | 118 710 | 120 578 | 4,500 %, 2029-05-01 | 55 000 | 66 844 | 68 775 |
| 2,625 %, 2029-02-15 | 75 000 | 95 899 | 91 828 | USB Capital IX | | | |
| 2,875 %, 2031-02-15 | 290 000 | 371 217 | 356 863 | 3,500 %, 2021-07-19 | 144 000 | 161 388 | 176 978 |
| 3,375 %, 2029-04-15 | 40 000 | 49 800 | 51 237 | Valley National Bancorp | | | |
| 3,500 %, 2031-04-15 | 70 000 | 87 150 | 89 784 | 3,000 %, 2031-06-15 | 30 000 | 36 212 | 37 701 |
| 3,875 %, 2030-04-15 | 116 000 | 180 750 | 161 059 | Verint Systems Inc. | | | |
| 4,500 %, 2026-02-01 | 85 000 | 121 065 | 107 577 | 0,250 %, 2026-04-15 | 180 000 | 227 477 | 219 672 |
| 4,750 %, 2028-02-01 | 30 000 | 42 613 | 39 842 | Verizon Communications Inc. | | | |
| TMS International Corp. | | | | 3,500 %, 2023-02-17 | 60 000 | 59 937 | 58 315 |
| 6,250 %, 2029-04-15 | 380 000 | 481 121 | 494 670 | VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc. | | | |
| Towd Point Mortgage Trust | | | | 4,125 %, 2030-08-15 | 20 000 | 27 287 | 25 501 |
| Série 2017- 3, cat. A1 | | | | Victoria's Secret & Co. | | | |
| 2,750 %, 2057-07-25 | 48 054 | 62 305 | 60 745 | 4,625 %, 2029-07-15 | 105 000 | 130 021 | 130 022 |
| Série 2018- 3, cat. A1 | | | | Vine Energy Holdings LLC | | | |
| 3,750 %, 2058-05-25 | 78 225 | 104 375 | 102 272 | 6,750 %, 2029-04-15 | 410 000 | 515 309 | 534 992 |
| Série 2019- 4, cat. A1 | | | | VistaJet Malta Finance PLC / | | | |
| 2,900 %, 2059-10-25 | 72 742 | 96 506 | 93 364 | XO Management Holding Inc. | | | |
| Townsquare Media, Inc. | | | | 10,500 %, 2024-06-01 | 422 000 | 555 182 | 570 351 |
| 6,875 %, 2026-02-01 | 70 000 | 91 584 | 92 857 | | | | |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| États-Unis (suite) | | | |
| Vroom, Inc. | | | |
| 0,750 %, 2026-07-01 | 55 000 | 66 985 | 70 695 |
| Wells Fargo & Company | | | |
| 1,338 %, 2025-05-04 | 107 000 | 172 972 | 162 955 |
| 1,362 %, 2021-07-27 | 50 000 | 48 966 | 46 522 |
| Western Alliance Bancorporation | | | |
| 3,000 %, 2031-06-15 | 45 000 | 54 493 | 56 247 |
| Western Global Airlines LLC | | | |
| 10,375 %, 2025-08-15 | 640 000 | 871 358 | 908 916 |
| Western Midstream Operating, LP | | | |
| 5,300 %, 2030-02-01 | 85 000 | 113 907 | 118 188 |
| Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp. | | | |
| 7,750 %, 2028-08-15 | 295 000 | 392 350 | 376 714 |
| WMG Acquisition Corp. | | | |
| 3,000 %, 2031-02-15 | 180 000 | 222 419 | 211 745 |
| Wyndham Hotels & Resorts, Inc. | | | |
| 4,375 %, 2028-08-15 | 130 000 | 162 738 | 167 619 |
| Xerox Holdings Corporation | | | |
| 5,000 %, 2025-08-15 | 25 000 | 34 060 | 32 718 |
| YUM! Brands, Inc. | | | |
| 3,625 %, 2031-03-15 | 270 000 | 351 969 | 333 087 |
| 4,625 %, 2032-01-31 | 225 000 | 281 700 | 293 305 |
| 4,750 %, 2030-01-15 | 125 000 | 174 440 | 167 777 |
| YUM! Brands, Inc., prêt à terme B | | | |
| 1,832 %, 2028-03-15 | 80 000 | 98 008 | 99 276 |
| | | 83 941 915 | 83 338 927 |
| Finlande (0,15 %) | | | |
| République de Finlande | | | |
| 0,000 %, 2030-09-15 | 65 000 | 102 992 | 96 091 |
| SpA Holdings 3 Oy | | | |
| 3,625 %, 2028-02-04 | 115 000 | 171 540 | 170 566 |
| | | 274 532 | 266 657 |
| France (0,89 %) | | | |
| Altice France SA | | | |
| 5,500 %, 2028-01-15 | 250 000 | 341 555 | 321 633 |
| 7,375 %, 2026-05-01 | 200 000 | 268 834 | 257 859 |
| BNP Paribas SA | | | |
| 4,500 %, 2030-02-25 | 200 000 | 251 163 | 251 839 |
| CAB SELAS | | | |
| 3,375 %, 2028-02-01 | 140 000 | 217 320 | 205 058 |
| Constellium SE | | | |
| 3,125 %, 2029-07-15 | 360 000 | 528 074 | 526 281 |
| | | 1 606 946 | 1 562 670 |
| Hongrie (0,07 %) | | | |
| République de Hongrie | | | |
| 1,125 %, 2026-04-28 | 85 000 | 127 901 | 131 684 |
| Îles Caïmans (0,66 %) | | | |
| Global Aircraft Leasing Co., Ltd | | | |
| 6,500 %, 2024-09-15 | 338 250 | 449 257 | 421 483 |
| QNB Finance Ltd. | | | |
| 1,625 %, 2025-09-22 | 210 000 | 276 003 | 262 338 |
| Shelf Drilling Holdings, Ltd. | | | |
| 8,250 %, 2025-02-15 | 207 000 | 264 557 | 204 433 |
| 8,875 %, 2024-11-15 | 205 000 | 251 235 | 263 044 |
| | | 1 241 052 | 1 151 298 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Îles Marshall (0,51 %) | | | |
| Danaos Corporation | | | |
| 8,500 %, 2028-03-01 | 368 000 | 479 774 | 501 405 |
| Seaspan Corporation | | | |
| 6,500 %, 2026-04-29 | 300 000 | 374 940 | 392 509 |
| | | 854 714 | 893 914 |
| Inde (0,29 %) | | | |
| Adani Ports and Special Economic Zone Limited | | | |
| 4,000 %, 2027-07-30 | 200 000 | 262 233 | 258 508 |
| Indian Railway Finance Corporation Limited | | | |
| 3,249 %, 2030-02-13 | 200 000 | 267 913 | 251 515 |
| | | 530 146 | 510 023 |
| Indonésie (1,32 %) | | | |
| Perusahaan Listrik Negara PT | | | |
| 5,450 %, 2028-05-21 | 200 000 | 256 728 | 289 298 |
| République d'Indonésie | | | |
| 2,150 %, 2024-07-18 | 115 000 | 169 378 | 179 180 |
| 6,125 %, 2028-05-15 | 569 000 000 | 51 116 | 48 665 |
| 6,500 %, 2025-06-15 | 4 763 000 000 | 445 718 | 427 448 |
| 6,625 %, 2033-05-15 | 356 000 000 | 31 824 | 30 348 |
| 7,000 %, 2027-05-15 | 2 000 000 | 195 | 181 |
| 7,000 %, 2030-09-15 | 2 681 000 000 | 248 321 | 237 177 |
| 7,500 %, 2032-08-15 | 394 000 000 | 39 709 | 35 566 |
| 7,500 %, 2035-06-15 | 801 000 000 | 75 368 | 70 800 |
| 7,500 %, 2038-05-15 | 1 431 000 000 | 138 265 | 125 690 |
| 8,125 %, 2024-05-15 | 1 263 000 000 | 116 843 | 117 829 |
| 8,250 %, 2029-05-15 | 1 741 000 000 | 170 943 | 166 006 |
| 8,375 %, 2024-03-15 | 712 000 000 | 70 853 | 66 506 |
| 8,375 %, 2026-09-15 | 2 795 000 000 | 281 958 | 268 716 |
| 8,750 %, 2031-05-15 | 1 604 000 000 | 168 889 | 158 293 |
| 9,000 %, 2029-03-15 | 1 044 000 000 | 115 524 | 103 423 |
| | | 2 381 632 | 2 325 126 |
| Irlande (1,10 %) | | | |
| Aragvi Finance International Designated Activity Company | | | |
| 8,450 %, 2026-04-29 | 240 000 | 300 912 | 310 194 |
| ASG Finance Designated Activity Company | | | |
| 7,875 %, 2024-12-03 | 375 000 | 495 830 | 456 236 |
| Jazz Securities Designated Activity Company | | | |
| 4,375 %, 2029-01-15 | 200 000 | 250 070 | 257 084 |
| République d'Irlande | | | |
| 0,200 %, 2027-05-15 | 115 000 | 174 841 | 173 701 |
| 3,400 %, 2024-03-18 | 85 000 | 152 599 | 138 320 |
| 3,900 %, 2023-03-20 | 25 000 | 44 615 | 39 565 |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC | | | |
| 7,750 %, 2025-05-06 | 200 000 | 264 470 | 257 814 |
| Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC | | | |
| 4,875 %, 2028-07-15 | 170 000 | 289 753 | 296 081 |
| | | 1 973 090 | 1 928 995 |
| Italie (1,16 %) | | | |
| Gamma Bidco SPA | | | |
| 5,125 %, 2025-07-15 | 260 000 | 385 609 | 394 964 |
| Guala Closures SPA | | | |
| 3,250 %, 2028-06-15 | 385 000 | 565 085 | 568 016 |
| International Design Group SPA | | | |
| 6,500 %, 2025-11-15 | 295 000 | 441 871 | 453 484 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Italie (suite) | | | |
| Nexi Spa | | | |
| 2,125 %, 2029-04-30 | 350 000 | 525 028 | 509 695 |
| République d'Italie | | | |
| 1,850 %, 2025-07-01 | 75 000 | 122 951 | 118 405 |
| | | 2 040 544 | 2 044 564 |
| Japon (0,34 %) | | | |
| Gouvernement du Japon | | | |
| 0,100 %, 2023-12-20 | 49 050 000 | 601 921 | 550 344 |
| Sony Group Corporation, Convertible | | | |
| 0,000 %, 2022-09-30 | 2 000 000 | 41 261 | 48 666 |
| | | 643 182 | 599 010 |
| Jersey (0,25 %) | | | |
| Galaxy Bidco Limited | | | |
| 6,500 %, 2026-07-31 | 130 000 | 211 004 | 234 971 |
| IDB Trust Services Limited | | | |
| 0,037 %, 2024-12-04 | 135 000 | 197 266 | 198 971 |
| | | 408 270 | 433 942 |
| Liberia (0,29 %) | | | |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | |
| 4,250 %, 2026-07-01 | 80 000 | 97 444 | 99 064 |
| 5,500 %, 2028-04-01 | 140 000 | 176 452 | 181 779 |
| 9,125 %, 2023-06-15 | 50 000 | 67 430 | 68 030 |
| 11,500 %, 2025-06-01 | 118 000 | 168 468 | 168 594 |
| | | 509 794 | 517 467 |
| Luxembourg (4,57 %) | | | |
| Allergan Funding SCS | | | |
| 1,250 %, 2024-06-01 | 100 000 | 150 696 | 148 985 |
| Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp. | | | |
| 3,625 %, 2028-06-01 | 270 000 | 397 276 | 394 071 |
| ArcelorMittal SA | | | |
| 4,550 %, 2026-03-11 | 20 000 | 28 896 | 28 026 |
| 7,000 %, 2041-03-01 | 35 000 | 60 441 | 60 270 |
| 7,250 %, 2039-10-15 | 25 000 | 45 510 | 43 782 |
| Atento Luxco 1 SA | | | |
| 8,000 %, 2026-02-10 | 507 000 | 667 044 | 685 056 |
| Avation Capital SA | | | |
| 8,250 %, 2026-10-31 | 725 000 | 935 141 | 747 279 |
| Becton Dickinson Euro Finance Sarl | | | |
| 1,208 %, 2026-06-04 | 110 000 | 164 963 | 169 102 |
| Cidron Aida Finco SARL | | | |
| 5,000 %, 2028-04-01 | 225 000 | 336 173 | 335 641 |
| 6,250 %, 2028-04-01 | 100 000 | 173 076 | 174 914 |
| ContourGlobal Power Holdings SA | | | |
| 2,750 %, 2026-01-01 | 185 000 | 285 375 | 276 455 |
| 3,125 %, 2028-01-01 | 100 000 | 154 257 | 149 064 |
| Dana Financing Luxembourg SARL | | | |
| 3,000 %, 2029-07-15 | 195 000 | 286 278 | 294 079 |
| Fonds européen de stabilité financière | | | |
| 0,500 %, 2023-01-20 | 100 000 | 155 847 | 149 401 |
| FS Luxembourg Sarl | | | |
| 10,000 %, 2025-12-15 | 200 000 | 257 460 | 277 390 |
| Garfunkelux Holdco 3 SA | | | |
| 6,750 %, 2025-11-01 | 105 000 | 163 443 | 160 862 |
| 7,750 %, 2025-11-01 | 165 000 | 283 043 | 294 493 |
| GOL Equity Finance SA | | | |
| 3,750 %, 2024-07-15 | 272 000 | 314 256 | 303 346 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Gol Finance SA | | | |
| 7,000 %, 2025-01-31 | 325 000 | 377 998 | 388 656 |
| 8,000 %, 2026-06-30 | 485 000 | 599 735 | 610 347 |
| Hidrovias International Finance SARL | | | |
| 4,950 %, 2031-02-08 | 85 000 | 108 690 | 107 098 |
| ICON Luxembourg SARL, prêt à terme B | | | |
| 3,000 %, 2028-07-01 | 281 450 | 341 064 | 349 473 |
| Jazz Financing Lux SARL, prêt à terme | | | |
| 4,000 %, 2028-04-22 | 50 000 | 62 205 | 62 181 |
| Kenbourne Invest SA | | | |
| 4,700 %, 2028-01-22 | 70 000 | 88 585 | 87 420 |
| Kernel Holding SA | | | |
| 6,500 %, 2024-10-17 | 305 000 | 403 126 | 406 499 |
| Minerva Luxembourg SA | | | |
| 4,375 %, 2031-03-18 | 250 000 | 312 500 | 307 950 |
| Simpar Europe SA | | | |
| 5,200 %, 2031-01-26 | 370 000 | 468 230 | 470 945 |
| Swiss Insured Brazil Power Finance SARL | | | |
| 9,850 %, 2032-07-16 | 844 656 | 318 167 | 218 344 |
| Trinseo | | | |
| 5,125 %, 2029-04-01 | 270 000 | 336 906 | 342 343 |
| | | 8 276 381 | 8 043 472 |
| Malaisie (0,42 %) | | | |
| Fédération de Malaisie | | | |
| 3,733 %, 2028-06-15 | 345 000 | 110 533 | 107 510 |
| 3,828 %, 2034-07-05 | 210 000 | 67 901 | 62 435 |
| 3,844 %, 2033-04-15 | 498 000 | 146 902 | 150 997 |
| 3,882 %, 2025-03-14 | 280 000 | 91 932 | 87 571 |
| 3,885 %, 2029-08-15 | 105 000 | 32 655 | 32 933 |
| 3,899 %, 2027-11-16 | 297 000 | 96 831 | 93 385 |
| 4,059 %, 2024-09-30 | 310 000 | 98 502 | 97 303 |
| 4,160 %, 2021-07-15 | 346 000 | 112 526 | 103 292 |
| | | 757 782 | 735 426 |
| Mexique (2,21 %) | | | |
| Aerovias de Mexico SA de CV | | | |
| 7,000 %, 2025-02-05 | 200 000 | 264 510 | 197 179 |
| Banco Mercantil del Norte SA | | | |
| 6,750 %, 2024-09-27 | 227 000 | 299 969 | 303 118 |
| 8,375 %, 2030-10-14 | 200 000 | 271 400 | 300 090 |
| Cemex, SAB de CV | | | |
| 3,875 %, 2031-07-11 | 200 000 | 254 430 | 252 056 |
| Credito Real, SAB de CV, SOFOM, ER | | | |
| 8,000 %, 2028-01-21 | 425 000 | 544 128 | 453 014 |
| Grupo Aeromexico SAB de CV, prêt à terme DD | | | |
| 15,500 %, 2022-08-19 | 96 115 | 125 230 | 122 143 |
| Grupo Posadas SAB de CV | | | |
| 7,875 %, 2022-06-30 | 202 000 | 270 919 | 148 481 |
| Petroleos Mexicanos | | | |
| 6,875 %, 2025-10-16 | 245 000 | 322 989 | 336 225 |
| Total Play Telecomunicaciones SA de CV | | | |
| 7,500 %, 2025-11-12 | 325 000 | 421 525 | 427 160 |
| Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR | | | |
| 8,375 %, 2028-01-27 | 480 000 | 623 500 | 557 235 |
| États-Unis mexicains | | | |
| 5,750 %, 2026-03-05 | 2 870 000 | 170 677 | 173 717 |
| 7,500 %, 2027-06-03 | 5 790 000 | 418 311 | 375 649 |
| 7,750 %, 2031-05-29 | 3 670 000 | 275 637 | 241 107 |
| | | 4 263 225 | 3 887 174 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Norvège (0,87 %) | | | |
| Aker BP ASA | | | |
| 2,875 %, 2026-01-15 | 150 000 | 192 141 | 195 820 |
| 3,750 %, 2030-01-15 | 160 000 | 208 171 | 214 012 |
| Royaume de Norvège | | | |
| 2,000 %, 2023-05-24 | 3 635 000 | 559 328 | 536 529 |
| Kommunalbanken AS | | | |
| 1,125 %, 2021-12-15 | 125 000 | 211 695 | 214 750 |
| 1,750 %, 2029-10-15 | 2 000 000 | 290 640 | 287 377 |
| 4,500 %, 2023-04-17 | 85 000 | 87 923 | 84 960 |
| | | 1 549 898 | 1 533 448 |
| Nouvelle-Zélande (0,15 %) | | | |
| Gouvernement de Nouvelle-Zélande | | | |
| 5,500 %, 2023-04-15 | 40 000 | 38 366 | 37 681 |
| New Zealand Local Government Funding Agency Limited | | | |
| 2,750 %, 2022-04-14 | 137 000 | 125 669 | 120 717 |
| 2,750 %, 2025-04-15 | 120 000 | 99 691 | 109 638 |
| | | 263 726 | 268 036 |
| Panama (0,23 %) | | | |
| Carnival Corporation | | | |
| 5,750 %, 2027-03-01 | 125 000 | 159 156 | 162 333 |
| 7,625 %, 2026-03-01 | 100 000 | 154 890 | 162 973 |
| 10,500 %, 2026-02-01 | 55 000 | 74 447 | 79 381 |
| | | 388 493 | 404 687 |
| Pays-Bas (1,31 %) | | | |
| BMW Finance NV | | | |
| 1,000 %, 2024-11-14 | 45 000 | 69 444 | 68 703 |
| BNG Bank NV | | | |
| 0,250 %, 2023-02-22 | 25 000 | 38 323 | 37 182 |
| 0,250 %, 2024-06-07 | 60 000 | 91 313 | 89 971 |
| Dufry One BV | | | |
| 3,375 %, 2028-04-15 | 125 000 | 187 510 | 182 645 |
| Energizer Gamma Acquisition BV | | | |
| 3,500 %, 2029-06-30 | 195 000 | 287 291 | 285 736 |
| ING Groep NV | | | |
| 5,750 %, 2026-11-16 | 200 000 | 273 016 | 274 515 |
| Metinvest BV | | | |
| 7,750 %, 2029-10-17 | 300 000 | 392 095 | 413 622 |
| OCI NV | | | |
| 4,625 %, 2025-10-15 | 252 000 | 336 609 | 326 436 |
| Petrobras Global Finance BV | | | |
| 6,900 %, 2049-03-19 | 179 000 | 251 885 | 264 546 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV | | | |
| 2,800 %, 2023-07-21 | 290 000 | 319 452 | 358 295 |
| | | 2 246 938 | 2 301 651 |
| Pérou (0,20 %) | | | |
| Auna SA | | | |
| 6,500 %, 2025-11-20 | 280 000 | 366 674 | 359 253 |
| Philippines (0,07 %) | | | |
| République des Philippines | | | |
| 6,250 %, 2024-03-12 | 4 675 000 | 119 457 | 130 914 |

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Portugal (0,43 %) | | | |
| République du Portugal | | | |
| 0,700 %, 2027-10-15 | 57 000 | 89 428 | 88 057 |
| 2,875 %, 2025-10-15 | 50 000 | 87 809 | 83 874 |
| 5,125 %, 2024-10-15 | 65 000 | 85 068 | 91 446 |
| TAP – Transportes Aereos Portugueses, SGPS SA | | | |
| 5,625 %, 2024-12-02 | 400 000 | 561 260 | 489 352 |
| | | 823 565 | 752 729 |
| Qatar (0,02 %) | | | |
| État du Qatar | | | |
| 4,000 %, 2029-03-14 | 30 000 | 40 117 | 42 830 |
| Royaume-Uni (2,19 %) | | | |
| Boparan Finance PLC | | | |
| 7,625 %, 2025-11-30 | 160 000 | 278 107 | 250 101 |
| Deuce FinCo PLC | | | |
| 5,500 %, 2027-06-15 | 155 000 | 265 543 | 265 676 |
| International Game Technology PLC | | | |
| 2,375 %, 2028-04-15 | 340 000 | 494 678 | 490 288 |
| Jerrold Finco PLC | | | |
| 5,250 %, 2027-01-15 | 260 000 | 450 080 | 460 952 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | |
| 7,500 %, 2025-09-27 | 200 000 | 290 696 | 290 381 |
| Natwest Group PLC | | | |
| 6,000 %, 2025-12-29 | 200 000 | 284 950 | 276 656 |
| Neptune Energy Bondco PLC | | | |
| 6,625 %, 2025-05-15 | 355 000 | 457 986 | 452 769 |
| Obligation du Trésor britannique | | | |
| 3,750 %, 2021-09-07 | 10 000 | 17 305 | 17 228 |
| Pinnacle Bidco PLC | | | |
| 5,500 %, 2025-02-15 | 100 000 | 146 146 | 150 865 |
| TechnipFMC PLC | | | |
| 6,500 %, 2026-02-01 | 235 000 | 300 884 | 314 288 |
| Tullow Oil PLC | | | |
| 10,250 %, 2026-05-15 | 340 000 | 414 477 | 442 913 |
| Vmed 02 UK Financing I PLC | | | |
| 3,250 %, 2031-01-31 | 135 000 | 210 948 | 199 349 |
| 4,250 %, 2031-01-31 | 205 000 | 273 393 | 249 732 |
| | | 3 885 193 | 3 861 198 |
| Singapour (0,49 %) | | | |
| Medco Bell Pte Ltd. | | | |
| 6,375 %, 2027-01-30 | 115 000 | 147 916 | 147 081 |
| République de Singapour | | | |
| 1,750 %, 2022-04-01 | 70 000 | 65 013 | 65 222 |
| 2,375 %, 2025-06-01 | 660 000 | 689 664 | 646 612 |
| | | 902 593 | 858 915 |
| Suède (0,31 %) | | | |
| Royaume de Suède | | | |
| 0,125 %, 2023-04-24 | 175 000 | 265 334 | 260 235 |
| Verisure Holding AB | | | |
| 3,250 %, 2027-02-15 | 200 000 | 308 577 | 294 298 |
| | | 573 911 | 554 533 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|-----------------------------|---------------------|-----------------------|
| Suisse (0,16 %) | | | |
| Crédit Suisse Group AG 6,375 %, 2026-08-21 | 200 000 | 290 719 | 276 256 |
| Supranationale (0,48 %) | | | |
| Association internationale de développement 0,750 %, 2024-12-12 | 80 000 | 136 347 | 138 442 |
| Banque asiatique de développement 5,000 %, 2022-03-09 | 40 000 | 42 920 | 38 447 |
| Banque européenne d'investissement 1,500 %, 2022-05-12 | 1 300 000 | 202 195 | 188 739 |
| 1,750 %, 2025-03-13 | 180 000 | 26 710 | 26 409 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0,750 %, 2021-12-07 | 25 000 | 44 602 | 42 881 |
| 0,750 %, 2025-07-02 | 112 000 | 111 763 | 110 750 |
| 1,900 %, 2025-01-16 | 130 000 | 129 865 | 134 231 |
| 3,375 %, 2022-01-25 | 50 000 | 45 237 | 43 993 |
| 6,750 %, 2024-02-04 | 265 000 | 66 513 | 65 128 |
| Banque nordique d'investissement 5,000 %, 2022-04-19 | 55 000 | 62 012 | 53 128 |
| | | 868 164 | 842 148 |
| Turquie (0,44 %) | | | |
| Akbank TAS 6,800 %, 2026-02-06 | 175 000 | 238 326 | 229 209 |
| Pegasus Hava Tasimaciligi Anonim Sirketi 9,250 %, 2026-04-30 | 415 000 | 514 891 | 542 451 |
| | | 753 217 | 771 660 |
| Total des obligations | | 148 046 405 | 145 522 878 |
| | Nombre d'actions | | |
| Actions (14,87 %) | | | |
| Canada (0,10 %) | | | |
| Algonquin Power & Utilities Corp. 7,750 %, privilégiées | 2 950 | 183 645 | 181 399 |
| États-Unis (14,77 %) | | | |
| American Electric Power Company, Inc. 6,125 %, privilégiées | 1 950 | 136 551 | 123 729 |
| Becton, Dickinson and Company, série B 6,000 %, privilégiées | 1 850 | 128 982 | 122 584 |
| Broadcom Inc., série A 8,000 %, privilégiées | 155 | 211 400 | 291 719 |
| Dominion Energy, Inc., série A 7,25 %, parts de société | 2 200 | 293 593 | 264 607 |
| DTE Energy Company 6,250 %, privilégiées | 2 650 | 175 784 | 162 204 |
| First Horizon Corporation, série F 4,700 %, privilégiées | 925 | 28 611 | 29 151 |
| FTS International, Inc., cat. A | 6 488 | 127 159 | 227 284 |
| iShares Broad USD High Yield Corporate Bond ETF | 97 500 | 4 997 285 | 5 037 033 |
| iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond Fund | 40 500 | 4 509 203 | 4 415 307 |
| iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF | 85 000 | 13 883 108 | 14 142 129 |

| | Nombre d'action \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| NextEra Energy, Inc. 4,872 %, privilégiées | 1 050 | 75 590 | 73 007 |
| 5,279 %, privilégiées | 2 950 | 190 357 | 178 850 |
| 6,219 %, privilégiées | 2 150 | 137 650 | 131 520 |
| Sabre Corporation 6,500 %, privilégiées | 400 | 96 632 | 79 841 |
| Stanley Black & Decker, Inc. 5,250 %, privilégiées | 1 025 | 155 881 | 153 238 |
| The Southern Company, série 2019 6,750 %, privilégiées | 3 250 | 216 429 | 203 759 |
| U.S. Bancorp Série A 3,500 %, privilégiées | 130 | 142 773 | 158 725 |
| Série K 5,500 %, privilégiées | 2 150 | 69 991 | 74 998 |
| Washington Federal, Inc., série A 4,875 %, privilégiées | 2 050 | 65 785 | 67 905 |
| Wells Fargo & Company, série Q 5,850 %, privilégiées | 2 395 | 80 856 | 81 706 |
| | | 25 723 620 | 26 019 296 |
| Total des actions | | 25 907 265 | 26 200 695 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (14 195) | — |
| Total des placements (97,47 %) | | 173 939 475 | 171 723 573 |
| Contrats de change à terme (- 1,25 %) | | | (2 202 175) |
| Contrats à terme (- 0,13 %) | | | (222 590) |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (3,91 %) | | | 6 891 032 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 176 189 840 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | Achat | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|---|----------------|----------------|----------------|-------------------|--------------------------------|
| The Bank of New York Mellon | AA- | 409 525 CAD | 338 977 USD | 15 septembre 2021 | 10 241 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 569 917 AUD | 1 469 273 CAD | 15 septembre 2021 | 9 319 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 765 344 EUR | 2 602 965 CAD | 15 septembre 2021 | 6 758 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 7 565 874 EUR | 11 118 870 CAD | 15 juillet 2021 | 5 912 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 155 000 GBP | 218 642 USD | 15 juillet 2021 | 5 587 |
| UBS AG | A+ | 1 838 712 NOK | 269 663 CAD | 15 septembre 2021 | 4 983 |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 90 792 CAD | 75 328 USD | 15 septembre 2021 | 2 490 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 141 704 GBP | 1 955 559 CAD | 15 juillet 2021 | 2 427 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 185 006 EUR | 221 372 USD | 15 juillet 2021 | 2 386 |
| Barclays Bank PLC | A | 462 416 NZD | 402 326 CAD | 15 septembre 2021 | 2 289 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 560 723 BRL | 139 507 CAD | 15 septembre 2021 | 2 268 |
| Citibank NA | A+ | 561 064 BRL | 139 507 CAD | 15 septembre 2021 | 2 184 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 503 957 BRL | 124 465 CAD | 15 septembre 2021 | 1 119 |
| Banque de Montréal | A+ | 500 000 USD | 619 921 CAD | 15 septembre 2021 | 756 |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 103 242 AUD | 96 338 CAD | 15 septembre 2021 | 327 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 177 986 NOK | 25 733 CAD | 15 septembre 2021 | 112 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 469 359 CAD | 319 185 EUR | 15 septembre 2021 | 51 |
| | | | | | 59 209 |
| National Australia Bank Ltd. | AA- | 40 975 NZD | 35 446 CAD | 15 septembre 2021 | (2) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 4 904 USD | 6 044 CAD | 15 septembre 2021 | (29) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 94 244 USD | 116 639 CAD | 15 septembre 2021 | (66) |
| UBS AG | A+ | 188 488 USD | 233 338 CAD | 15 septembre 2021 | (72) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 71 099 SGD | 65 406 CAD | 15 septembre 2021 | (81) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 94 244 USD | 116 619 CAD | 15 septembre 2021 | (87) |
| Barclays Bank PLC | A | 94 244 USD | 116 597 CAD | 15 septembre 2021 | (109) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 45 028 CAD | 30 519 EUR | 15 septembre 2021 | (146) |
| Citibank NA | A+ | 99 882 BRL | 24 293 CAD | 15 septembre 2021 | (153) |
| Citibank NA | A+ | 188 488 USD | 233 233 CAD | 15 septembre 2021 | (178) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 169 639 USD | 209 859 CAD | 15 septembre 2021 | (210) |
| Standard Chartered Bank | A | 188 488 USD | 233 184 CAD | 15 septembre 2021 | (226) |
| Citibank NA | A+ | 376 976 USD | 466 531 CAD | 15 septembre 2021 | (290) |
| Banque de Montréal | A+ | 474 013 CAD | 322 109 EUR | 15 septembre 2021 | (302) |
| UBS AG | A+ | 95 696 BRL | 23 115 CAD | 15 septembre 2021 | (307) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 62 876 USD | 77 510 CAD | 15 septembre 2021 | (352) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 57 972 USD | 71 341 CAD | 15 septembre 2021 | (447) |
| Citibank NA | A+ | 48 665 USD | 59 612 CAD | 15 septembre 2021 | (651) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 125 752 USD | 155 036 CAD | 15 septembre 2021 | (687) |
| Banque de Montréal | A+ | 188 000 USD | 231 982 CAD | 15 septembre 2021 | (824) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 125 752 USD | 154 781 CAD | 15 septembre 2021 | (942) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 125 752 USD | 154 617 CAD | 15 septembre 2021 | (1 105) |
| UBS AG | A+ | 125 752 USD | 154 582 CAD | 15 septembre 2021 | (1 141) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 251 504 USD | 310 221 CAD | 15 septembre 2021 | (1 224) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 238 141 CAD | 161 055 EUR | 15 septembre 2021 | (1 285) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 238 172 CAD | 161 055 EUR | 15 septembre 2021 | (1 316) |
| Barclays Bank PLC | A | 236 044 CAD | 159 592 EUR | 15 septembre 2021 | (1 339) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 236 061 CAD | 159 592 EUR | 15 septembre 2021 | (1 356) |
| U.S. Bancorp | A+ | 13 359 915 JPY | 147 660 CAD | 15 septembre 2021 | (1 487) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 71 041 USD | 86 277 CAD | 15 septembre 2021 | (1 695) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 71 041 USD | 86 262 CAD | 15 septembre 2021 | (1 710) |
| UBS AG | A+ | 71 041 USD | 86 262 CAD | 15 septembre 2021 | (1 711) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 71 041 USD | 86 259 CAD | 15 septembre 2021 | (1 713) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 71 041 USD | 86 258 CAD | 15 septembre 2021 | (1 714) |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 71 041 USD | 86 250 CAD | 15 septembre 2021 | (1 722) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 71 041 USD | 86 236 CAD | 15 septembre 2021 | (1 736) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 71 041 USD | 86 221 CAD | 15 septembre 2021 | (1 751) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 76 513 USD | 92 711 CAD | 15 septembre 2021 | (2 037) |
| Citibank NA | A+ | 251 504 USD | 309 395 CAD | 15 septembre 2021 | (2 050) |
| Citibank NA | A+ | 104 287 USD | 126 298 CAD | 15 septembre 2021 | (2 844) |
| UBS AG | A+ | 284 164 USD | 348 582 CAD | 15 septembre 2021 | (3 307) |
| Citibank NA | A+ | 153 449 USD | 186 608 CAD | 15 septembre 2021 | (3 412) |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | | Achat | | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|--|----------------|------------|-----|------------|-----|-------------------|-----------------------------------|
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 142 082 | USD | 172 451 | CAD | 15 septembre 2021 | (3 494) |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 284 164 | USD | 348 183 | CAD | 15 septembre 2021 | (3 706) |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 395 653 | USD | 484 950 | CAD | 15 septembre 2021 | (4 998) |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 442 348 | USD | 542 769 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 004) |
| Citibank NA | A+ | 716 822 | SGD | 654 944 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 303) |
| UBS AG | A+ | 442 348 | USD | 542 392 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 381) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 395 653 | USD | 484 450 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 499) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 395 653 | USD | 484 446 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 502) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 395 653 | USD | 484 425 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 523) |
| Banque de Montréal | A+ | 395 653 | USD | 484 253 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 696) |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 229 538 | USD | 278 026 | CAD | 15 septembre 2021 | (6 217) |
| Banque de Montréal | A+ | 284 164 | USD | 345 461 | CAD | 15 septembre 2021 | (6 428) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 284 164 | USD | 345 319 | CAD | 15 septembre 2021 | (6 570) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 568 328 | USD | 695 597 | CAD | 15 septembre 2021 | (8 181) |
| Citibank NA | A+ | 1 178 045 | BRL | 279 025 | CAD | 15 septembre 2021 | (9 306) |
| Citibank NA | A+ | 2 405 303 | BRL | 570 450 | CAD | 15 septembre 2021 | (18 258) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 1 495 896 | USD | 1 807 042 | CAD | 15 septembre 2021 | (45 371) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 495 896 | USD | 1 804 873 | CAD | 15 septembre 2021 | (47 540) |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | AA- | 1 495 896 | USD | 1 804 571 | CAD | 15 septembre 2021 | (47 842) |
| UBS AG | A+ | 3 145 550 | USD | 3 801 932 | CAD | 15 septembre 2021 | (93 297) |
| Banque de Montréal | A+ | 2 991 791 | USD | 3 611 226 | CAD | 15 septembre 2021 | (93 598) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 2 991 791 | USD | 3 611 197 | CAD | 15 septembre 2021 | (93 628) |
| Bank of America NA | A+ | 2 991 791 | USD | 3 603 403 | CAD | 15 septembre 2021 | (101 422) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 2 991 791 | USD | 3 603 313 | CAD | 15 septembre 2021 | (101 511) |
| The Bank of New York Mellon | AA- | 4 487 687 | USD | 5 413 734 | CAD | 15 septembre 2021 | (143 503) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 4 487 687 | USD | 5 412 294 | CAD | 15 septembre 2021 | (144 943) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 57 093 708 | USD | 69 500 000 | CAD | 15 juillet 2021 | (1 199 847) |
| | | | | | | | (2 261 384) |
| | | | | | | | (2 202 175) |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Tableau des contrats à terme

Au 30 juin 2021

| Description | Nombre de contrats | Date de règlement | Valeur nominale \$ | | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|-----------------------|-----------------------|----------------------|--------------------------|-----|--------------------------------------|
| Euro Bund Futures | (1) | 8 septembre 2021 | (172 610) | EUR | (1 542) |
| US 10YR ULTRA Futures | (1) | 21 septembre 2021 | (147 203) | USD | (3 192) |
| US 10YR NOTE Futures | (19) | 21 septembre 2021 | (2 517 500) | USD | (16 730) |
| US LONG BOND Futures | (35) | 21 septembre 2021 | (5 626 250) | USD | (201 126) |
| | | | | | (222 590) |
| | | | | | (222 590) |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 3 716 035 \$ (1 991 121 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|-------------------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Couronne norvégienne | 823 506 | 0,47 | 491 133 | 0,23 |
| Dollar américain | 24 988 994 | 14,18 | 9 796 699 | 4,53 |
| Dollar australien | 38 154 | 0,02 | 404 529 | 0,19 |
| Dollar de la Nouvelle-Zélande | 1 778 | 0,00 | 17 973 | 0,01 |
| Dollar de Singapour | 1 115 | — | (1 802) | — |
| Euro | 5 560 213 | 3,16 | 887 512 | 0,41 |
| Livre sterling | 1 057 640 | 0,60 | 1 963 300 | 0,91 |
| Peso colombien | 419 092 | 0,24 | 289 285 | 0,13 |
| Peso mexicain | 796 274 | 0,45 | 206 730 | 0,10 |
| Peso philippin | 131 379 | 0,07 | 245 008 | 0,11 |
| Réal brésilien | 70 414 | 0,04 | 730 176 | 0,34 |
| Ringgit malaisien | 742 741 | 0,42 | 1 277 133 | 0,59 |
| Roupie indonésienne | 1 886 373 | 1,07 | 2 977 432 | 1,38 |
| Yen japonais | 449 879 | 0,26 | 626 100 | 0,29 |
| Total | 36 967 552 | 20,98 | 19 911 208 | 9,22 |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| AAA/Aaa/A-1/F-1 | 7,35 | 9,98 |
| AA/Aa/A-2/F-2 | 2,18 | 3,06 |
| A/A-3/F-3 | 2,89 | 4,84 |
| BBB/Baa/Ba/B | 72,23 | 70,31 |
| Caa | 15,35 | 11,81 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché liquide et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 145 522 878 | 26 200 695 | 195 779 193 | 9 839 464 |
| Encaisse | — | 7 460 871 | — | 5 197 657 |
| Autres actifs | — | 4 172 903 | — | 7 272 158 |
| Passifs | — | 7 167 507 | — | 1 620 910 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 10 779 723 \$ (16 329 251 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 26 200 695 | 2 620 070 | 9 839 464 | 983 946 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 2 620 070 \$ (983 946 \$ au 31 décembre 2020).

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Amérique du Nord – États-Unis | 60,80 | 61,40 |
| Europe | 16,00 | 14,80 |
| Amérique du Nord – Canada | 7,50 | 9,20 |
| Asie | 5,70 | 6,50 |
| Amérique latine | 5,00 | 4,70 |
| Encaisse | 4,50 | 2,60 |
| Supranational | 0,50 | 0,80 |

Portefeuille FDP Revenu fixe mondial

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|----------------------------|-------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Obligations | – | 145 522 878 | – | 145 522 878 |
| Actions | 26 200 695 | – | – | 26 200 695 |
| Contrats de change à terme | – | (2 202 175) | – | (2 202 175) |
| Contrats à terme | (222 590) | – | – | (222 590) |
| Total | 25 978 105 | 143 320 703 | – | 169 298 808 |

| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|----------------------------|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Obligations | – | 195 779 193 | – | 195 779 193 |
| Actions | 9 839 464 | – | – | 9 839 464 |
| Contrats de change à terme | – | 3 269 190 | – | 3 269 190 |
| Contrats à terme | 33 258 | – | – | 33 258 |
| Total | 9 872 722 | 199 048 383 | – | 208 921 105 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Actions canadiennes

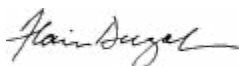
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|---|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 553 955 | 468 683 |
| Encaisse | 7 609 | 15 620 |
| Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 89 | 1 257 |
| Souscriptions à recevoir | 139 | 643 |
| Produit de la vente de placements à recevoir | 3 492 | 840 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 1 123 | 853 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 108 | 109 |
| | 566 515 | 488 005 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Montants à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 352 | 102 |
| Frais de gestion à payer | 349 | 302 |
| Acquisitions de titres à payer | 3 305 | 738 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 182 | 176 |
| | 4 188 | 1 318 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 562 327 | 486 687 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 26 608 | 26 139 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 21,134 | 18,619 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 303 801 | 264 173 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 258 526 | 222 514 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 9 023 | 8 924 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 17 584 | 17 215 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 33,668 | 29,604 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 14,702 | 12,925 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

Portefeuille FDP Actions canadiennes

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 264 173 | 238 407 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 38 139 | (12 616) |
| | 302 312 | 225 791 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (1 608) | (1 097) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (1 608) | (1 097) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 5 218 | 9 349 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 1 608 | 1 097 |
| Rachats de parts rachetables | (3 729) | (2 034) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 3 097 | 8 412 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 303 801 | 233 106 |
| SÉRIE I | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 222 514 | 188 021 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 33 328 | (8 976) |
| | 255 842 | 179 045 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (2 614) | (1 932) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (2 614) | (1 932) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 24 176 | 24 507 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | — | 1 697 |
| Rachats de parts rachetables | (18 878) | (11 740) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 5 298 | 14 464 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 258 526 | 191 577 |

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| TOTAL DES SÉRIES | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 486 687 | 426 428 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 71 467 | (21 592) |
| | 558 154 | 404 836 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (4 222) | (3 029) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (4 222) | (3 029) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 29 394 | 33 856 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 1 608 | 2 794 |
| Rachats de parts rachetables | (22 607) | (13 774) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 8 395 | 22 876 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 562 327 | 424 683 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Intérêts | 86 | 50 |
| Dividendes | 6 407 | 4 442 |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 15 | 15 |
| Autres revenus | 105 | 3 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 40 473 | (11 382) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 2 138 | (1 286) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (17) | (33) |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 338 | 601 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 26 067 | (11 686) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats de change à terme | (1 418) | (121) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | — | 10 |
| | 74 194 | (19 387) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 1 966 | 1 548 |
| Honoraires d'audit | 6 | 7 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 1 | 4 |
| Frais de garde | 107 | 89 |
| Frais juridiques | 1 | 17 |
| Droits et dépôts | 24 | 3 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 77 | 73 |
| Autres | 14 | 41 |
| Coût d'opération (note 9) | 521 | 412 |
| | 2 717 | 2 194 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 71 477 | (21 581) |
| Retenues fiscales étrangères | (10) | (11) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 71 467 | (21 592) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 38 139 | (12 616) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 33 328 | (8 976) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 8 980 | 8 802 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 17 329 | 16 418 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 4,247 | (1,433) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 1,923 | (0,547) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|-----------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 71 467 | (21 592) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (40 473) | 11 382 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur contrats de change à terme | (2 138) | 1 286 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 17 | 33 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (26 067) | 11 686 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme | 1 418 | 121 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | — | (10) |
| Achats de placements | (580 343) | (493 907) |
| Produit de la vente de placements | 561 611 | 475 432 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Produit de la vente de placements à recevoir | (2 652) | (360) |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | (270) | 64 |
| Autres éléments d'actifs à recevoir | 1 | 84 |
| Frais de gestion à payer | 47 | (18) |
| Acquisitions de titres à payer | 2 567 | 3 016 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 6 | (126) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | (14 809) | (12 909) |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 29 898 | 33 909 |
| Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties | (2 614) | (235) |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (22 607) | (13 639) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | 4 677 | 20 035 |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | (10 132) | 7 126 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 2 138 | (1 286) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (17) | (33) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | — | 10 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 15 620 | 7 093 |
| Encaisse à la clôture de la période | 7 609 | 12 910 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 87 | 50 |
| Dividendes reçus inclus dans les activités opérationnelles | 6 628 | 4 436 |
| Retenues d'impôts | 11 | 13 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Marché monétaire (0,53 %) | | | |
| Sociétés (0,53 %) | | | |
| Merit Trust SNR | | | |
| 0,110 %, 2021-07-02 | 3 000 000 | 2 999 982 | 2 999 982 |
| Total du marché monétaire | | 2 999 982 | 2 999 982 |
| Obligations (0,43 %) | | | |
| Sociétés (0,43 %) | | | |
| Bill.com Holdings, Inc., coupon zéro | | | |
| 0,000 %, 2025-12-01 | 242 000 | 354 899 | 401 556 |
| Shopify Inc., Convertible | | | |
| 0,125 %, 2025-11-01 | 1 235 000 | 1 800 348 | 1 998 795 |
| Total des obligations | | 2 155 247 | 2 400 351 |
| | Nombre d'actions | | |
| Actions américaines (3,60 %) | | | |
| Biens de consommation (0,01 %) | | | |
| Hayward Holdings, Inc. | 1 289 | 27 381 | 41 532 |
| Vroom Inc. | 148 | 4 371 | 7 672 |
| | | 31 752 | 49 204 |
| Consommation de base (0,05 %) | | | |
| The Hershey Company | 362 | 75 392 | 78 079 |
| Utz Brands Inc. | 6 706 | 172 177 | 180 945 |
| | | 247 569 | 259 024 |
| Immobilier (0,21 %) | | | |
| American Tower Corporation | 3 454 | 1 037 638 | 1 155 413 |
| Produits industriels (1,24 %) | | | |
| ACV Auctions Inc., cat. A | 800 | 25 001 | 25 390 |
| Cintas Corporation | 6 585 | 2 854 423 | 3 114 907 |
| Dun & Bradstreet Holdings, Inc. | 1 220 | 36 540 | 32 284 |
| Old Dominion Freight Line, Inc. | 737 | 223 281 | 231 625 |
| Roper Technologies, Inc. | 5 353 | 2 520 860 | 3 116 777 |
| Shoals Technologies Group, Inc., cat. A | 414 | 13 222 | 18 199 |
| The AZEK Company Inc. | 7 454 | 398 667 | 391 918 |
| Vertiv Holdings Co. | 1 220 | 23 817 | 41 243 |
| | | 6 095 811 | 6 972 343 |
| Santé (0,69 %) | | | |
| Simulations Plus, Inc. | 1 999 | 148 193 | 135 922 |
| Thermo Fisher Scientific Inc. | 4 982 | 2 419 626 | 3 112 182 |
| Veeva Systems, Inc., cat. A | 211 | 73 053 | 81 245 |
| West Pharmaceutical Services, Inc. | 1 217 | 397 000 | 541 168 |
| | | 3 037 872 | 3 870 517 |
| Services de communication (0,06 %) | | | |
| ZoomInfo Technologies Inc. | 5 347 | 315 081 | 345 427 |
| Services financiers (0,70 %) | | | |
| 2020 Mandatory Exchangeable Trust | | | |
| 6,500 %, privilégiées | 87 | 204 400 | 193 441 |
| BRP Group, Inc., cat. A | 1 062 | 35 920 | 35 047 |
| Far Point Acquisition Corporation | 8 084 | 106 753 | 100 104 |
| Goosehead Insurance, Inc., cat. A | 299 | 42 537 | 47 133 |
| MarketAxess Holdings Inc. | 671 | 382 917 | 385 197 |
| Northern Star Investment Corp. II, cat. A | 1 746 | 22 302 | 21 534 |
| Rocket Companies, Inc., cat. A | 136 | 3 256 | 3 259 |
| S&P Global Inc. | 6 134 | 2 610 994 | 3 117 668 |
| Starboard Value Acquisition Corp., cat. A | 2 317 | 30 500 | 28 691 |
| | | 3 439 579 | 3 932 074 |

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Technologies de l'information (0,64 %) | | | |
| Affirm Holdings, Inc. | 97 | 6 045 | 8 090 |
| C3.ai, Inc., cat. A | 44 | 2 366 | 3 407 |
| Cadence Design Systems Inc. | 11 427 | 1 750 333 | 1 936 010 |
| DigitalOcean Holdings, Inc. | 661 | 32 101 | 45 501 |
| E2open Parent Holdings, Inc. | 2 834 | 37 072 | 40 077 |
| Indie Semiconductor, Inc., cat. A | 2 776 | 36 805 | 33 963 |
| Jamf Holding Corp. | 124 | 4 330 | 5 155 |
| NVIDIA Corporation | 634 | 436 868 | 628 144 |
| Olo Inc., cat. A | 199 | 6 440 | 9 214 |
| Paya Holdings, Inc., cat. A | 1 132 | 16 155 | 15 447 |
| Qualtrics International Inc., cat. A | 748 | 30 160 | 35 429 |
| Shift4 Payments Inc., cat. A | 6 347 | 647 020 | 736 591 |
| Telos Corporation | 810 | 33 928 | 34 113 |
| Unity Software Inc. | 560 | 75 229 | 76 161 |
| | | 3 114 852 | 3 607 302 |
| Total des actions américaines | | 17 320 154 | 20 191 304 |
| Actions canadiennes (93,09 %) | | | |
| Biens de consommation (4,88 %) | | | |
| Aritzia Inc., droit de vote sub. | 74 245 | 1 490 392 | 2 753 005 |
| AutoCanada Inc. | 39 496 | 785 880 | 1 972 430 |
| Dollarama inc. | 60 982 | 2 812 611 | 3 460 119 |
| Gildan Activewear Inc., cat. A | 77 462 | 2 809 834 | 3 543 112 |
| Magna International Inc. | 65 686 | 6 599 400 | 7 538 782 |
| MTY Food Group Inc. | 25 595 | 960 156 | 1 396 719 |
| Park Lawn Corporation | 11 410 | 380 964 | 380 409 |
| Pet Valu Holdings Ltd. | 28 239 | 679 146 | 755 111 |
| Société Canadian Tire Limitée, cat. A | 28 874 | 4 305 120 | 5 663 924 |
| | | 20 823 503 | 27 463 611 |
| Consommation de base (2,19 %) | | | |
| Alimentation Couche-Tard inc., cat. B | 75 147 | 3 030 926 | 3 422 946 |
| Compagnies Loblaw Limitée | 35 847 | 2 725 721 | 2 734 768 |
| Empire Company Limited, cat. A | 15 599 | 511 534 | 609 921 |
| Jamieson Wellness, Inc. | 46 914 | 1 389 005 | 1 585 693 |
| Metro inc. | 13 256 | 801 087 | 787 804 |
| Neighbourly Pharmacy Inc. | 38 769 | 843 211 | 1 085 532 |
| Premium Brands Holdings Corp. | 6 523 | 629 594 | 821 441 |
| Saputo inc. | 34 500 | 1 362 260 | 1 275 465 |
| | | 11 293 338 | 12 323 570 |
| Énergie (10,71 %) | | | |
| Birchcliff Energy, Ltd. | 429 010 | 854 741 | 2 230 852 |
| Cameco Corporation | 79 900 | 1 918 386 | 1 898 424 |
| Canadian Natural Resources, Ltd. | 325 335 | 10 869 839 | 14 640 075 |
| Cenovus Energy Inc. | 238 521 | 2 880 422 | 2 828 859 |
| Corporation TC Énergie | 264 097 | 15 295 538 | 16 199 710 |
| Enbridge Inc. | 99 700 | 4 435 895 | 4 948 111 |
| Gibson Energy Inc. | 5 189 | 120 459 | 123 239 |
| Headwater Exploration Inc. | 172 489 | 786 942 | 752 052 |
| Keyera Corp. | 96 339 | 3 297 646 | 3 209 052 |
| MEG Energy Corp. | 111 405 | 680 660 | 999 303 |
| Secure Energy Services Inc. | 189 050 | 814 571 | 795 900 |
| Suncor Énergie inc. | 105 500 | 2 522 727 | 3 132 295 |
| Tourmaline Oil Corp. | 191 510 | 3 431 331 | 6 785 199 |
| Trican Well Service Ltd. | 638 250 | 1 064 945 | 1 704 128 |
| | | 48 974 102 | 60 247 199 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Fonds indiciels (4,24 %) | | | |
| iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF | 83 500 | 2 250 164 | 2 677 010 |
| iShares S&P/TSX 60 Index ETF | 287 | 7 163 | 8 762 |
| iShares S&P/TSX Capped Financials Index ETF | 455 000 | 18 001 569 | 21 184 800 |
| | | 20 258 896 | 23 870 572 |
| Immobilier (3,88 %) | | | |
| Allied Properties Real Estate Investment Trust | 10 971 | 464 070 | 494 244 |
| Altus Group, Ltd. | 39 251 | 2 228 366 | 2 254 970 |
| Canadian Apartment Properties REIT | 6 678 | 362 767 | 388 125 |
| Colliers International Group Inc. | 20 865 | 2 315 132 | 2 896 175 |
| First Capital Real Estate Investment Trust | 131 055 | 1 987 727 | 2 306 568 |
| FirstService Corporation | 32 532 | 5 315 901 | 6 910 828 |
| Granite Real Estate Investment Trust | 7 358 | 562 736 | 606 888 |
| Information Services Corporation | 22 374 | 399 855 | 682 407 |
| InterRent Real Estate Investment Trust | 35 141 | 536 734 | 592 477 |
| Minto Apartment Real Estate Investment Trust | 16 644 | 339 568 | 398 457 |
| RioCan Real Estate Investment Trust | 95 900 | 1 984 650 | 2 117 472 |
| Summit Industrial Income REIT | 12 937 | 175 582 | 229 891 |
| Tricon Residential Inc. | 136 607 | 1 576 089 | 1 948 016 |
| | | 18 249 177 | 21 826 518 |
| Matériaux de base (9,38 %) | | | |
| Aya Gold & Silver Inc. | 53 807 | 454 522 | 493 948 |
| Capstone Mining Corp. | 173 200 | 650 865 | 931 816 |
| CCL Industries Inc., cat. B | 30 500 | 1 849 298 | 2 082 235 |
| ERO Copper Corp. | 49 047 | 1 129 716 | 1 275 712 |
| First Majestic Silver Corp. | 71 200 | 1 332 699 | 1 394 096 |
| First Quantum Minerals Ltd. | 175 355 | 3 204 999 | 5 009 892 |
| Franco-Nevada Corporation | 53 367 | 7 689 151 | 9 600 190 |
| Interfor Corporation | 60 600 | 1 212 635 | 1 881 024 |
| Ivanhoe Mines, Ltd., cat. A | 196 509 | 681 333 | 1 758 755 |
| K92 Mining Inc. | 256 623 | 2 065 701 | 2 299 342 |
| Mines Agnico Eagle Limitée | 66 209 | 5 983 720 | 4 963 027 |
| Neo Performance Materials Inc. | 5 612 | 93 891 | 92 542 |
| Nutrien Ltd. | 123 173 | 7 977 846 | 9 251 524 |
| Ressources Teck, Ltée, cat. B, droit de vote sub. | 65 100 | 1 743 971 | 1 858 605 |
| Société aurifère Barrick | 27 920 | 710 259 | 715 869 |
| Stelco Holdings Inc. | 41 890 | 1 165 182 | 1 524 796 |
| Stella-Jones Inc. | 7 279 | 320 732 | 324 862 |
| Triple Flag Precious Metals Corp. | 12 924 | 204 393 | 201 168 |
| Wheaton Precious Metals Corp. | 129 835 | 6 634 963 | 7 094 184 |
| | | 45 105 876 | 52 753 587 |
| Produits industriels (12,92 %) | | | |
| Aecon Group Inc. | 33 000 | 652 536 | 594 000 |
| Air Canada | 69 470 | 1 748 290 | 1 771 485 |
| ATS Automation Tooling Systems Inc. | 42 853 | 1 452 338 | 1 524 710 |
| Boyd Group Services Inc. | 5 950 | 1 363 839 | 1 342 201 |
| CAE Inc. | 3 102 | 109 997 | 118 309 |
| Calian Group, Ltd. | 23 131 | 1 379 725 | 1 390 404 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 19 174 | 2 592 744 | 2 507 767 |
| Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique | 229 895 | 14 158 680 | 21 913 591 |
| Cargojet Inc. | 7 163 | 1 157 286 | 1 318 207 |
| Doman Building Materials Group Ltd. | 81 100 | 611 635 | 677 996 |
| Finning International Inc. | 40 830 | 1 067 287 | 1 324 934 |
| GFL Environmental Inc. | | | |
| 6,000 %, privilégiées | 14 927 | 1 057 055 | 1 381 687 |
| GFL Environmental Inc., droit de vote sub. | 18 707 | 770 953 | 739 423 |
| LifeWorks, Inc. | 11 068 | 363 047 | 369 893 |

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Produits industriels (suite) | | | |
| Quincaillerie Richelieu Itée | 5 879 | 206 336 | 235 865 |
| Savaria Corporation | 54 051 | 839 408 | 1 083 182 |
| TFI International Inc. | 63 158 | 5 011 068 | 7 147 591 |
| Thomson Reuters Corporation | 73 830 | 7 143 585 | 9 087 077 |
| Industries Toromont Ltée | 36 208 | 2 725 358 | 3 910 464 |
| Transcontinental Inc., cat. A | 91 300 | 1 654 445 | 2 125 464 |
| Waste Connections, Inc. | 59 597 | 8 120 243 | 8 821 914 |
| WSP Global Inc. | 22 403 | 2 099 771 | 3 241 714 |
| | | 56 285 626 | 72 627 878 |
| Santé (0,02 %) | | | |
| Dialogue Health Technologies Inc. | 2 169 | 26 028 | 24 727 |
| DRI Healthcare Trust | 12 759 | 161 835 | 119 169 |
| MindBeacon Holdings Inc. | 2 218 | 17 744 | 10 336 |
| | | 205 607 | 154 232 |
| Services aux collectivités (2,28 %) | | | |
| Algonquin Power & Utilities Corp. | 29 661 | 558 345 | 546 531 |
| AltaGas, Ltd. | 66 600 | 1 722 938 | 1 732 932 |
| Brookfield Infrastructure Corporation, cat. A | 1 672 | 104 098 | 156 215 |
| Brookfield Renewable Corporation, cat. A | 30 298 | 1 704 417 | 1 573 505 |
| Capital Power Corporation | 35 700 | 1 405 294 | 1 461 915 |
| Fortis Inc. | 99 491 | 5 454 457 | 5 459 071 |
| Hydro One Limited | 38 100 | 1 179 328 | 1 141 476 |
| Northland Power Inc. | 17 300 | 545 257 | 731 617 |
| | | 12 674 134 | 12 803 262 |
| Services de communication (3,70 %) | | | |
| BCE Inc. | 23 000 | 1 400 930 | 1 405 990 |
| Québecor inc., cat. B | 215 162 | 6 156 380 | 7 113 256 |
| Rogers Communications Inc., cat. B | 143 420 | 9 074 072 | 9 451 378 |
| TELUS Corporation | 101 300 | 2 739 266 | 2 816 140 |
| | | 19 370 648 | 20 786 764 |
| Services financiers (27,95 %) | | | |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | 111 160 | 13 528 447 | 15 685 788 |
| Banque de Montréal | 46 300 | 4 421 155 | 5 882 878 |
| Banque Nationale du Canada | 91 877 | 6 491 958 | 8 523 429 |
| Banque Royale du Canada | 283 674 | 26 144 115 | 35 626 618 |
| Banque Scotia | 178 010 | 12 799 354 | 14 351 166 |
| Banque Toronto-Dominion | 302 976 | 21 275 707 | 26 319 525 |
| Brookfield Asset Management Inc., cat. A | 250 828 | 12 836 605 | 15 856 956 |
| Canaccord Genuity Group Inc. | 140 970 | 1 237 485 | 1 914 373 |
| Corporation financière Intact | 27 989 | 3 932 733 | 4 713 627 |
| ECN Capital Corp. | 79 800 | 645 411 | 742 140 |
| Equitable Group Inc. | 23 900 | 2 983 072 | 3 179 417 |
| Financière Sun Life | 97 480 | 5 190 283 | 6 230 922 |
| goeasy Ltd. | 17 805 | 1 331 084 | 2 824 407 |
| Groupe TMX Limitée | 4 365 | 586 630 | 571 553 |
| iA Financial Corporation Inc. | 29 738 | 2 090 045 | 2 007 018 |
| Onex Corporation | 28 155 | 2 301 500 | 2 534 231 |
| Power Corporation du Canada | 142 398 | 5 507 868 | 5 579 154 |
| Société financière Manuvie | 82 500 | 2 059 761 | 2 013 000 |
| Trisura Group, Ltd. | 15 675 | 1 282 095 | 2 598 758 |
| | | 126 645 308 | 157 154 960 |
| Technologies de l'information (10,94 %) | | | |
| Absolute Software Corporation | 44 422 | 652 789 | 796 487 |
| CGI inc. | 33 580 | 3 294 779 | 3 774 056 |
| Constellation Software Inc. | 4 385 | 5 671 331 | 8 232 443 |
| Converge Technology Solution Corp. | 384 883 | 2 397 463 | 3 933 504 |
| Dye & Durham Limited | 31 804 | 834 855 | 1 514 825 |
| Enghouse Systems Limited | 11 064 | 567 474 | 610 622 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Technologies de l'information (suite) | | | |
| Farmers Edge Inc. | 529 | 8 993 | 6 337 |
| LifeSpeak Inc. | 2 531 | 25 309 | 25 310 |
| Magnet Forensics Inc. | 428 | 7 276 | 10 927 |
| Nuvei Corp., droit de vote sub. | 73 916 | 5 479 624 | 7 508 090 |
| Pivotree Inc. | 750 | 6 375 | 4 425 |
| Quisitive Technology Solutions Inc. | 57 499 | 86 249 | 91 998 |
| Sangoma Technologies Corporation | 205 725 | 670 735 | 656 263 |
| Shopify Inc., cat. A | 16 712 | 15 880 906 | 30 291 449 |
| Softchoice Corporation | 9 982 | 199 978 | 219 504 |
| Tecsys Inc. | 15 450 | 614 950 | 645 965 |
| TELUS International (Cda) Inc. | 52 849 | 1 811 600 | 2 035 054 |
| Topicus.com, Inc., droit de vote sub. | 13 160 | 890 268 | 1 185 058 |
| | | 39 100 954 | 61 542 317 |
| Total des actions canadiennes | | 418 987 169 | 523 554 470 |
| Actions internationales (0,86 %) | | | |
| Produits industriels (0,01 %) | | | |
| Trane Technologies PLC | 171 | 34 622 | 38 991 |
| Services aux collectivités (0,80 %) | | | |
| Brookfield Infrastructure Partners LP | 14 316 | 944 081 | 984 763 |
| Brookfield Renewable Partners LP | 73 117 | 2 913 913 | 3 502 304 |
| | | 3 857 994 | 4 487 067 |
| Services financiers (0,04 %) | | | |
| Austerlitz Acquisition Corporation I | 1 201 | 15 205 | 15 363 |
| Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd. | 1 663 | 113 537 | 108 563 |
| Cohn Robbins Holdings Corp., cat. A | 3 609 | 47 545 | 44 020 |
| LDH Growth Corp. I | 2 970 | 37 161 | 36 778 |
| | | 213 448 | 204 724 |
| Technologies de l'information (0,01 %) | | | |
| Alphawave IP Group PLC | 12 763 | 88 215 | 78 599 |
| Total des actions internationales | | 4 194 279 | 4 809 381 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (332 366) | — |
| Total des placements (98,51 %) | | 445 324 465 | 553 955 488 |
| Contrats de change à terme (- 0,05 %) | | | (263 468) |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (1,54 %) | | | 8 635 286 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 562 327 306 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | | Achat | | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|---|----------------|-----------|-----|-----------|-----|-------------------|-----------------------------------|
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 4 996 709 | CAD | 4 052 152 | USD | 21 juillet 2021 | 21 131 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 4 146 114 | CAD | 3 363 168 | USD | 21 juillet 2021 | 18 547 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 2 711 103 | CAD | 2 200 035 | USD | 21 juillet 2021 | 13 233 |
| Citibank NA | A+ | 2 072 721 | CAD | 1 681 584 | USD | 21 juillet 2021 | 9 610 |
| Citibank NA | A+ | 2 072 721 | CAD | 1 681 584 | USD | 21 juillet 2021 | 9 610 |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 4 654 008 | CAD | 3 762 943 | USD | 21 juillet 2021 | 5 700 |
| Citibank NA | A+ | 1 036 528 | CAD | 840 792 | USD | 21 juillet 2021 | 4 637 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 2 080 120 | CAD | 1 681 584 | USD | 21 juillet 2021 | 2 211 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 2 060 156 | CAD | 1 664 773 | USD | 21 juillet 2021 | 1 356 |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 192 824 | CAD | 156 303 | USD | 15 septembre 2021 | 731 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 211 206 | CAD | 171 090 | USD | 15 septembre 2021 | 660 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 192 923 | CAD | 156 303 | USD | 15 septembre 2021 | 632 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 192 978 | CAD | 156 303 | USD | 15 septembre 2021 | 577 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 15 980 | USD | 19 818 | CAD | 2 juillet 2021 | 31 |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 2 082 306 | CAD | 1 681 584 | USD | 21 juillet 2021 | 25 |
| | | | | | | | 88 691 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 312 | CAD | 252 | USD | 2 juillet 2021 | – |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 444 | CAD | 358 | USD | 2 juillet 2021 | (1) |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 1 681 584 | USD | 2 082 339 | CAD | 15 septembre 2021 | (17) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 664 773 | USD | 2 060 190 | CAD | 15 septembre 2021 | (1 349) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 681 584 | USD | 2 080 160 | CAD | 15 septembre 2021 | (2 196) |
| Citibank NA | A+ | 840 792 | USD | 1 036 545 | CAD | 15 septembre 2021 | (4 633) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 3 762 943 | USD | 4 654 049 | CAD | 15 septembre 2021 | (5 716) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 850 928 | USD | 1 044 816 | CAD | 21 juillet 2021 | (8 901) |
| Citibank NA | A+ | 1 681 584 | USD | 2 072 754 | CAD | 15 septembre 2021 | (9 602) |
| Citibank NA | A+ | 1 681 584 | USD | 2 072 754 | CAD | 15 septembre 2021 | (9 602) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 915 061 | USD | 1 122 648 | CAD | 21 juillet 2021 | (10 486) |
| Citibank NA | A+ | 1 073 672 | USD | 1 318 314 | CAD | 21 juillet 2021 | (11 230) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 1 220 082 | USD | 1 497 650 | CAD | 21 juillet 2021 | (13 195) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 2 200 035 | USD | 2 711 139 | CAD | 15 septembre 2021 | (13 231) |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 1 317 688 | USD | 1 617 278 | CAD | 21 juillet 2021 | (14 435) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 3 363 168 | USD | 4 146 178 | CAD | 15 septembre 2021 | (18 534) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 1 717 265 | USD | 2 107 539 | CAD | 21 juillet 2021 | (18 975) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 744 717 | USD | 2 141 387 | CAD | 21 juillet 2021 | (19 122) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 4 052 152 | USD | 4 996 774 | CAD | 15 septembre 2021 | (21 128) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 2 440 164 | USD | 2 996 521 | CAD | 21 juillet 2021 | (25 170) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 917 533 | USD | 2 347 371 | CAD | 21 juillet 2021 | (27 138) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 2 574 373 | USD | 3 152 448 | CAD | 21 juillet 2021 | (35 436) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 2 574 373 | USD | 3 151 684 | CAD | 21 juillet 2021 | (36 200) |
| Banque de Montréal | A+ | 4 264 345 | USD | 5 234 739 | CAD | 21 juillet 2021 | (45 862) |
| | | | | | | | (352 159) |
| | | | | | | | (263 468) |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 1 768 611 \$ (591 924 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 17 607 515 | 3,13 | 5 458 396 | 1,12 |
| Livre sterling | 78 599 | 0,01 | — | — |
| Euro | — | — | 460 839 | 0,09 |
| Total | 17 686 114 | 3,14 | 5 919 235 | 1,21 |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| RI Bas | 100,00 | 100,00 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé indirectement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créance. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalent de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 5 400 333 | 548 555 155 | 3 266 359 | 465 416 781 |
| Encaisse | — | 7 609 402 | — | 15 619 573 |
| Autres actifs | — | 4 950 677 | — | 3 701 664 |
| Passifs | — | 4 188 261 | — | 1 317 850 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 78 326 \$ (61 892 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à détenir tout au plus 10 % de son actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables en actifs portant intérêt.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 548 555 155 | 54 855 516 | 465 416 781 | 46 541 678 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 54 855 516 \$ (46 541 678 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Une proportion se situant entre 90 % et 100 % de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables doit être investie en titres de capitaux propres. Le portefeuille de chaque sous-conseiller doit être investi dans au moins 30 titres répartis dans au moins 7 secteurs du S&P/TSX.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Services financiers | 28,70 | 26,10 |
| Produits industriels | 14,20 | 16,40 |
| Technologies de l'information | 12,00 | 13,50 |
| Énergie | 10,70 | 4,40 |
| Matériaux de base | 9,40 | 11,80 |
| Biens de consommation | 4,90 | 8,70 |
| Fonds indiciels | 4,30 | 5,50 |
| Immobilier | 4,10 | — |
| Services de communication | 3,80 | 1,70 |
| Services aux collectivités | 3,10 | 5,20 |
| Consommation de base | 2,20 | 2,60 |
| Autres | 1,90 | 3,60 |
| Santé | 0,70 | 0,50 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|------------------------------------|--------------------|------------------|----------------|--------------------|
| Actions | 548 555 155 | — | — | 548 555 155 |
| Obligations | — | 2 400 351 | — | 2 400 351 |
| Instruments de marché monétaire | — | 2 999 982 | — | 2 999 982 |
| Contrats de change à terme | — | (263 468) | — | (263 468) |
| Total | 548 555 155 | 5 136 865 | — | 553 692 020 |

| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|------------------------------------|--------------------|------------------|----------------|--------------------|
| Actions | 465 416 781 | — | — | 465 416 781 |
| Obligations | — | 1 366 400 | — | 1 366 400 |
| Instruments de marché monétaire | — | 1 899 959 | — | 1 899 959 |
| Contrats de change à terme | — | 1 155 364 | — | 1 155 364 |
| Total | 465 416 781 | 4 421 723 | — | 469 838 504 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Prêt de titres

Le Portefeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portefeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portefeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| Juste valeur des titres prêtés | 11 995 353 | 28 633 468 |
| Juste valeur de la garantie | 12 608 036 | 30 107 742 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portefeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portefeuille.

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|--|--------------------|--------------------|
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 24 677 | 27 269 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (10 081) | (11 875) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 14 596 | 15 394 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

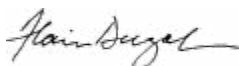
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ (non audité) | 31 décembre 2020 \$ (audité) |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | | |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 266 937 | 242 106 |
| Encaisse | 14 229 | 11 061 |
| Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 69 | 2 102 |
| Souscriptions à recevoir | 76 | 132 |
| Produit de la vente de placements à recevoir | 239 | 116 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 598 | 675 |
| | 282 148 | 256 192 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Montants à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 275 | 693 |
| Rachats à payer | — | 13 |
| Frais de gestion à payer | 108 | 93 |
| Acquisitions de titres à payer | 9 932 | 49 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 165 | 139 |
| | 10 480 | 987 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 271 668 | 255 205 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 23 795 | 25 495 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 11,417 | 10,010 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 77 071 | 69 065 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 194 597 | 186 140 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 7 193 | 7 362 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 16 602 | 18 132 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 10,715 | 9,381 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 11,721 | 10,266 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

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

Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin

2021

2020

\$

\$

(en milliers de dollars canadiens)

(non audité)

(non audité)

SÉRIE A

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

69 065

74 893

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

10 284

(9 166)

79 349

65 727

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(604)

(694)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(604)

(694)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

2 290

1 783

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

604

692

Rachats de parts rachetables

(4 568)

(4 485)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

(1 674)

(2 010)

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

77 071

63 023

SÉRIE I

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

186 140

244 500

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

27 919

(24 980)

214 059

219 520

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(2 687)

(3 383)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(2 687)

(3 383)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

21 525

17 105

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

—

2 983

Rachats de parts rachetables

(38 300)

(62 630)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

(16 775)

(42 542)

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

194 597

173 595

Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin

2021

2020

\$

\$

(en milliers de dollars canadiens)

(non audité)

(non audité)

TOTAL DES SÉRIES

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

255 205

319 393

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

38 203

(34 146)

293 408

285 247

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(3 291)

(4 077)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(3 291)

(4 077)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

23 815

18 888

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

604

3 675

Rachats de parts rachetables

(42 868)

(67 115)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

(18 449)

(44 552)

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

271 668

236 618

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Intérêts | 2 | 84 |
| Dividendes | 4 187 | 4 615 |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 26 | 10 |
| Autres revenus | 2 | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 13 246 | (3 512) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 2 214 | (2 849) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (21) | (130) |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 96 | 176 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 21 056 | (31 216) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats de change à terme | (1 615) | (124) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | (1) | (2) |
| | 39 192 | (32 948) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 613 | 526 |
| Honoraires d'audit | 5 | 7 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 4 | 4 |
| Frais de garde | 79 | 74 |
| Frais juridiques | 9 | 11 |
| Droits et dépôts | 15 | 8 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 42 | 50 |
| Autres | 10 | 19 |
| Coût d'opération (note 9) | 164 | 342 |
| | 941 | 1 041 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 38 251 | (33 989) |
| Retenues fiscales étrangères | (48) | (157) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 38 203 | (34 146) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 10 284 | (9 166) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 27 919 | (24 980) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 7 251 | 7 505 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 17 285 | 20 649 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 1,418 | (1,221) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 1,615 | (1,210) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|-----------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 38 203 | (34 146) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (13 246) | 3 512 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur contrats de change à terme | (2 214) | 2 849 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 21 | 130 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (21 056) | 31 216 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme | 1 615 | 124 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 1 | 2 |
| Achats de placements | (286 401) | (577 234) |
| Produit de la vente de placements | 295 872 | 625 327 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Produit de la vente de placements à recevoir | (123) | 128 |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 77 | 210 |
| Frais de gestion à payer | 15 | (21) |
| Acquisitions de titres à payer | 9 883 | 1 270 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 26 | (124) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 22 673 | 53 243 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 23 871 | 18 836 |
| Distributions versées aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties | (2 687) | (402) |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (42 881) | (67 101) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | (21 697) | (48 667) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 976 | 4 576 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 2 214 | (2 849) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (21) | (130) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (1) | (2) |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 11 061 | 829 |
| Encaisse à la clôture de la période | 14 229 | 2 424 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 2 | 84 |
| Dividendes reçus inclus dans les activités opérationnelles | 4 261 | 4 787 |
| Retenues d'impôts | 62 | 144 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Valeur nominale \$ | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|--------------------------|---------------------|-----------------------|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Marché monétaire (1,18 %) | | | | Services de communication (1,48 %) | | | |
| Émises et garanties par le gouvernement du Canada (0,31 %) | | | | Omnicom Group Inc. | | | |
| Bons du Trésor du gouvernement du Canada | | | | 19 918 | 1 807 808 | 1 972 910 | |
| 0,099 %, 2021-08-05 | 125 000 | 124 988 | 124 988 | Verizon Communications Inc. | 25 798 | 1 624 229 | 1 789 915 |
| 0,108 %, 2021-09-02 | 500 000 | 499 905 | 499 905 | ZoomInfo Technologies Inc. | 4 153 | 244 716 | 268 293 |
| 0,108 %, 2021-09-16 | 100 000 | 99 977 | 99 977 | | | 3 676 753 | 4 031 118 |
| 0,135 %, 2021-09-30 | 125 000 | 124 957 | 124 957 | | | | |
| | | 849 827 | 849 827 | Services financiers (1,18 %) | | | |
| Sociétés (0,87 %) | | | | 2020 Mandatory Exchangeable Trust | | | |
| Merit Trust SNR | | | | 6,500 %, privilégiées | 68 | 159 208 | 151 195 |
| 0,110 %, 2021-07-02 | 2 350 000 | 2 349 986 | 2 349 986 | BRP Group, Inc., cat. A | 824 | 27 871 | 27 193 |
| Total du marché monétaire | | | | Far Point Acquisition Corporation | 18 010 | 237 831 | 223 018 |
| | | 3 199 813 | 3 199 813 | Goosehead Insurance, Inc., cat. A | 232 | 33 012 | 36 571 |
| Obligations (0,69 %) | | | | MarketAxess Holdings Inc. | 521 | 297 317 | 299 087 |
| Sociétés (0,69 %) | | | | Northern Star Investment Corp. II, cat. A | 1 355 | 17 308 | 16 712 |
| Bill.com Holdings, Inc., coupon zéro | | | | Rocket Companies, Inc., cat. A | 106 | 2 538 | 2 540 |
| 0,000 %, 2025-12-01 | 188 000 | 275 684 | 311 953 | S&P Global Inc. | 4 762 | 2 019 872 | 2 420 335 |
| Shopify Inc., Convertible | | | | Starboard Value Acquisition Corp., cat. A | 1 799 | 23 681 | 22 277 |
| 0,125 %, 2025-11-01 | 959 000 | 1 394 372 | 1 552 101 | | | 2 818 638 | 3 198 928 |
| Total des obligations | | | | | | | |
| | | 1 670 056 | 1 864 054 | Technologies de l'information (1,55 %) | | | |
| | | | | Affirm Holdings, Inc. | 75 | 4 674 | 6 255 |
| Actions américaines (9,02 %) | | | | C3.ai, Inc., cat. A | 34 | 1 828 | 2 633 |
| Biens de consommation (0,01 %) | | | | Cadence Design Systems Inc. | 8 873 | 1 362 821 | 1 503 301 |
| Hayward Holdings, Inc. | 1 001 | 21 263 | 32 253 | DigitalOcean Holdings, Inc. | 513 | 24 908 | 35 313 |
| Vroom Inc. | 104 | 3 071 | 5 391 | E2open Parent Holdings, Inc. | 2 200 | 28 600 | 31 111 |
| | | 24 334 | 37 644 | Indie Semiconductor, Inc., cat. A | 2 155 | 28 534 | 26 365 |
| Consommation de base (0,77 %) | | | | Jamf Holding Corp. | 87 | 3 038 | 3 617 |
| Kellogg Company | 23 588 | 1 840 676 | 1 879 016 | NVIDIA Corporation | 492 | 339 729 | 487 456 |
| The Hershey Company | 281 | 58 523 | 60 608 | Olo Inc., cat. A | 154 | 4 983 | 7 130 |
| Utz Brands Inc. | 5 208 | 133 652 | 140 525 | Oracle Corporation | 14 730 | 1 053 892 | 1 419 814 |
| | | 2 032 851 | 2 080 149 | Paya Holdings, Inc., cat. A | 793 | 11 316 | 10 821 |
| Immobilier (0,33 %) | | | | Qualtrics International Inc., cat. A | 581 | 23 425 | 27 519 |
| American Tower Corporation | 2 683 | 806 047 | 897 502 | Shift4 Payments Inc., cat. A | 4 929 | 498 191 | 572 028 |
| Produits industriels (1,99 %) | | | | Telos Corporation | 629 | 26 350 | 26 490 |
| ACV Auctions Inc., cat. A | 621 | 19 407 | 19 709 | Unity Software Inc. | 435 | 58 438 | 59 161 |
| Cintas Corporation | 5 113 | 2 218 057 | 2 418 605 | | | 3 470 727 | 4 219 014 |
| Dun & Bradstreet Holdings, Inc. | 947 | 28 363 | 25 060 | Total des actions américaines | | | |
| Old Dominion Freight Line, Inc. | 572 | 173 283 | 179 768 | | | 21 393 139 | 24 516 607 |
| Roper Technologies, Inc. | 4 157 | 1 958 252 | 2 420 408 | Actions canadiennes (82,69 %) | | | |
| Shoals Technologies Group, Inc., cat. A | 322 | 10 284 | 14 155 | Biens de consommation (3,55 %) | | | |
| The AZEK Company Inc. | 5 788 | 309 564 | 304 323 | Dollarama inc. | 24 188 | 1 313 489 | 1 372 427 |
| Vertiv Holdings Co. | 947 | 17 959 | 32 014 | Magna International Inc. | 26 437 | 2 138 713 | 3 034 175 |
| | | 4 735 169 | 5 414 042 | Park Lawn Corporation | 8 860 | 295 824 | 295 392 |
| Santé (1,71 %) | | | | Pet Valu Holdings Ltd. | 6 556 | 160 275 | 175 308 |
| Amgen Inc. | 5 410 | 1 451 280 | 1 632 931 | Restaurant Brands International Inc. | 32 570 | 2 514 609 | 2 601 366 |
| Simulations Plus, Inc. | 1 550 | 114 907 | 105 392 | Société Canadian Tire Limitée, cat. A | 11 058 | 1 666 569 | 2 169 137 |
| Thermo Fisher Scientific Inc. | 3 869 | 1 897 122 | 2 416 907 | | | 8 089 479 | 9 647 805 |
| Veeva Systems, Inc., cat. A | 163 | 56 423 | 62 763 | Consommation de base (3,73 %) | | | |
| West Pharmaceutical Services, Inc. | 945 | 308 888 | 420 217 | Alimentation Couche-Tard inc., cat. B | 45 676 | 2 018 795 | 2 080 542 |
| | | 3 828 620 | 4 638 210 | Compagnies Loblaw Limitée | 10 850 | 758 297 | 827 746 |
| | | | | Empire Company Limited, cat. A | 27 916 | 951 885 | 1 091 516 |
| | | | | Jamieson Wellness, Inc. | 32 911 | 950 203 | 1 112 392 |
| | | | | Metro inc. | 52 005 | 2 409 361 | 3 090 657 |
| | | | | Neighbourly Pharmacy Inc. | 4 939 | 114 931 | 138 292 |
| | | | | Premium Brands Holdings Corp. | 5 074 | 493 728 | 638 969 |
| | | | | Saputo inc. | 30 970 | 1 229 652 | 1 144 961 |
| | | | | | | 8 926 852 | 10 125 075 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|---------------------|---------------------|-----------------------|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Énergie (9,69 %) | | | | | | | |
| ARC Resources, Ltd. | 82 854 | 654 827 | 874 110 | Thomson Reuters Corporation | 25 407 | 2 568 057 | 3 125 559 |
| Canadian Natural Resources, Ltd. | 88 516 | 2 648 461 | 3 983 220 | Waste Connections, Inc. | 32 427 | 4 054 364 | 4 799 021 |
| Cenovus Energy Inc. | 37 119 | 396 276 | 440 231 | WSP Global Inc. | 8 731 | 1 046 296 | 1 263 376 |
| Corporation TC Énergie | 124 560 | 7 084 116 | 7 640 510 | | | 30 028 779 | 33 054 446 |
| Enbridge Inc. | 165 193 | 7 294 587 | 8 198 529 | Santé (0,36 %) | | | |
| Gibson Energy Inc. | 4 029 | 93 527 | 95 689 | Chartwell résidence pour retraités | 65 900 | 779 589 | 873 175 |
| Suncor Énergie inc. | 171 863 | 4 789 941 | 5 102 612 | Dialogue Health Technologies Inc. | 1 684 | 20 208 | 19 198 |
| | | 22 961 735 | 26 334 901 | DRI Healthcare Trust | 9 907 | 125 660 | 92 531 |
| Fonds indiciels (3,31 %) | | | | MindBeacon Holdings Inc. | 1 723 | 13 784 | 8 029 |
| iShares Core S&P/TSX Capped Composite Index ETF | 280 000 | 8 985 088 | 8 979 600 | | | 939 241 | 992 933 |
| iShares S&P/TSX 60 Index ETF | 192 | 4 943 | 5 862 | Services aux collectivités (2,22 %) | | | |
| | | 8 990 031 | 8 985 462 | Algonquin Power & Utilities Corp. | 23 033 | 433 577 | 424 404 |
| Immobilier (3,06 %) | | | | AltaGas, Ltd. | 46 199 | 935 462 | 1 202 098 |
| Allied Properties Real Estate Investment Trust | 8 519 | 360 356 | 383 781 | Brookfield Infrastructure Corporation, cat. A | 1 299 | 80 874 | 121 366 |
| Altus Group, Ltd. | 8 037 | 450 611 | 461 726 | Brookfield Renewable Corporation, cat. A | 23 526 | 1 335 786 | 1 221 806 |
| Canadian Apartment Properties REIT | 21 412 | 1 112 383 | 1 244 465 | Fortis Inc. | 15 520 | 844 793 | 851 583 |
| Colliers International Group Inc. | 1 522 | 195 478 | 211 048 | Hydro One Limited | 38 220 | 934 385 | 1 145 071 |
| FirstService Corporation | 8 448 | 1 181 011 | 1 791 578 | Northland Power Inc. | 25 294 | 1 123 012 | 1 069 683 |
| Granite Real Estate Investment Trust | 18 813 | 1 474 384 | 1 551 696 | | | 5 687 889 | 6 036 011 |
| Information Services Corporation | 17 377 | 310 507 | 529 998 | Services de communication (4,48 %) | | | |
| InterRent Real Estate Investment Trust | 27 287 | 416 788 | 460 059 | BCE Inc. | 30 000 | 1 720 243 | 1 833 514 |
| Minto Apartment Real Estate Investment Trust | 12 925 | 263 699 | 309 424 | Cogeco Communications Inc. | 5 900 | 585 287 | 715 139 |
| RioCan Real Estate Investment Trust | 46 794 | 1 109 145 | 1 033 212 | Québecor inc., cat. B | 43 468 | 1 498 781 | 1 437 052 |
| Summit Industrial Income REIT | 10 048 | 136 146 | 178 553 | Rogers Communications Inc., cat. B | 85 923 | 5 466 930 | 5 662 322 |
| Tricon Residential Inc. | 10 481 | 136 019 | 149 459 | TELUS Corporation | 90 249 | 2 113 627 | 2 508 926 |
| | | 7 146 527 | 8 304 999 | | | 11 384 868 | 12 156 953 |
| Matériaux de base (4,99 %) | | | | Services financiers (30,28 %) | | | |
| CCL Industries Inc., cat. B | 13 430 | 585 459 | 916 866 | Banque Canadienne Impériale de Commerce | 14 900 | 1 653 036 | 2 102 539 |
| First Quantum Minerals Ltd. | 26 820 | 634 420 | 766 247 | Banque de Montréal | 72 453 | 7 192 223 | 9 205 878 |
| Franco-Nevada Corporation | 6 405 | 985 599 | 1 152 195 | Banque Royale du Canada | 138 016 | 13 607 700 | 17 333 429 |
| Mines Agnico Eagle Limitée | 12 052 | 1 108 965 | 903 418 | Banque Scotia | 98 036 | 7 097 502 | 7 903 662 |
| Neo Performance Materials Inc. | 4 358 | 72 909 | 71 863 | Banque Toronto-Dominion | 209 549 | 14 158 944 | 18 203 521 |
| Nutrien Ltd. | 65 037 | 4 073 924 | 4 884 929 | Brookfield Asset Management Inc., cat. A | 137 183 | 7 260 941 | 8 671 254 |
| Société aurifère Barrick | 112 226 | 3 230 395 | 2 877 475 | Corporation financière Intact | 9 370 | 928 159 | 1 578 002 |
| Stella-Jones Inc. | 5 650 | 250 617 | 252 160 | Element Fleet Management, Corp. | 40 734 | 519 892 | 589 014 |
| Triple Flag Precious Metals Corp. | 10 034 | 158 688 | 156 184 | Financière Sun Life | 102 466 | 5 133 470 | 6 549 627 |
| West Fraser Timber Co., Ltd. | 6 598 | 576 623 | 587 156 | Groupe TMX Limitée | 3 389 | 455 463 | 443 756 |
| Wheaton Precious Metals Corp. | 17 955 | 947 918 | 981 061 | Onex Corporation | 3 382 | 274 904 | 304 414 |
| | | 12 625 517 | 13 549 554 | Power Corporation du Canada | 75 026 | 2 562 370 | 2 939 519 |
| Produits industriels (12,17 %) | | | | Société financière Manuvie | 232 245 | 5 679 111 | 5 666 778 |
| CAE Inc. | 2 409 | 85 423 | 91 878 | Trisura Group, Ltd. | 4 561 | 346 052 | 756 168 |
| Calian Group, Ltd. | 17 955 | 1 065 958 | 1 079 275 | | | 66 869 767 | 82 247 561 |
| Cargojet Inc. | 5 562 | 922 208 | 1 023 575 | Technologies de l'information (4,85 %) | | | |
| Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique | 49 391 | 4 170 878 | 4 707 950 | Absolute Software Corporation | 34 501 | 508 530 | 618 603 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 90 814 | 11 896 269 | 11 877 563 | Constellation Software Inc. | 2 800 | 4 388 462 | 5 256 748 |
| Finning International Inc. | 16 815 | 544 514 | 545 647 | Converge Technology Solution Corp. | 87 785 | 584 442 | 897 163 |
| GFL Environmental Inc. | | | | Dye & Durham Limited | 24 695 | 642 965 | 1 176 223 |
| 6,000 %, privilégiées | 11 586 | 812 364 | 1 072 434 | Enghouse Systems Limited | 7 762 | 375 626 | 428 385 |
| GFL Environmental Inc., droit de vote sub. | 14 529 | 598 748 | 574 281 | Farmers Edge Inc. | 411 | 6 987 | 4 924 |
| Industries Toromont Ltée | 6 425 | 527 400 | 693 900 | LifeSpeak Inc. | 1 965 | 19 650 | 19 650 |
| LifeWorks, Inc. | 8 594 | 281 897 | 287 212 | Lightspeed POS Inc., droit de vote sub. | 6 079 | 512 954 | 630 696 |
| Quincaillerie Richelieu Ltée | 4 565 | 161 527 | 183 148 | Magnet Forensics Inc. | 332 | 5 644 | 8 476 |
| Savaria Corporation | 42 024 | 650 752 | 842 161 | Nuvei Corp., droit de vote sub. | 9 511 | 573 835 | 971 641 |
| SNC-Lavalin Group Inc., cat. A | 20 900 | 467 448 | 674 025 | Open Text Corporation | 24 970 | 1 504 099 | 1 571 862 |
| Stantec Inc. | 3 859 | 174 676 | 213 441 | Pivotree Inc. | 526 | 4 471 | 3 103 |
| | | | | Qusitive Technology Solutions Inc. | 44 633 | 66 949 | 71 413 |
| | | | | Sangoma Technologies Corporation | 159 717 | 534 284 | 509 497 |
| | | | | Softchoice Corporation | 7 749 | 155 244 | 170 401 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Technologies de l'information (suite) | | | |
| Tecsys Inc. | 11 993 | 483 841 | 501 427 |
| TELUS International (Cda) Inc. | 3 101 | 99 379 | 119 461 |
| Topicus.com, Inc., droit de vote sub. | 2 665 | 176 546 | 239 983 |
| | | 10 643 908 | 13 199 656 |
| Total des actions canadiennes et fonds indiciels | | | |
| | | 194 294 593 | 224 635 356 |
| Actions internationales (4,68 %) | | | |
| Consommation de base (1,41 %) | | | |
| Carlsberg AS, cat. B | 7 670 | 1 466 056 | 1 770 640 |
| Henkel AG & Co. KGaA | 18 030 | 2 235 437 | 2 055 944 |
| | | 3 701 493 | 3 826 584 |
| Produits industriels (0,42 %) | | | |
| dormakaba Holding AG | 1 310 | 951 625 | 1 106 485 |
| Trane Technologies PLC | 133 | 26 926 | 30 327 |
| | | 978 551 | 1 136 812 |
| Santé (1,20 %) | | | |
| GlaxoSmithKline PLC | 52 494 | 1 302 070 | 1 274 605 |
| Roche Holding AG | 4 236 | 1 400 594 | 1 977 928 |
| | | 2 702 664 | 3 252 533 |
| Services aux collectivités (0,80 %) | | | |
| Brookfield Infrastructure Partners LP | 31 619 | 2 066 368 | 2 175 659 |
| | | 2 066 368 | 2 175 659 |
| Services de communication (0,32 %) | | | |
| Koninklijke (Royal) KPN NV | 227 170 | 901 361 | 878 701 |
| Services financiers (0,05 %) | | | |
| Austerlitz Acquisition Corporation I | 933 | 11 812 | 11 935 |
| Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd. | 1 014 | 69 027 | 66 135 |
| Cohn Robbins Holdings Corp., cat. A | 2 803 | 36 927 | 34 189 |
| LDH Growth Corp. I | 2 306 | 28 852 | 28 555 |
| Sagcor Financial Co. Ltd. bons de souscription (éch. 25/05/25) | 14 751 | 2 950 | 3 688 |
| | | 149 568 | 144 502 |
| Technologies de l'information (0,48 %) | | | |
| Alphawave IP Group PLC | 9 909 | 68 488 | 61 023 |
| Amdocs Limited | 13 000 | 1 202 646 | 1 245 333 |
| | | 1 271 134 | 1 306 356 |
| Total des actions internationales | | | |
| | | 11 771 139 | 12 721 147 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | | |
| | | (105 837) | — |
| Total des placements (98,26 %) | | | |
| | | 232 222 903 | 266 936 977 |
| Contrats de change à terme (- 0,08 %) | | | |
| | | | (205 532) |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (1,82 %) | | | |
| | | | 4 936 669 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | |
| | | | 271 668 114 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | Achat | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|---|----------------|---------------|---------------|-------------------|--------------------------------|
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 3 898 747 CAD | 3 161 744 USD | 21 juillet 2021 | 16 488 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 3 235 059 CAD | 2 624 155 USD | 21 juillet 2021 | 14 472 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 2 115 373 CAD | 1 716 606 USD | 21 juillet 2021 | 10 325 |
| Citibank NA | A+ | 1 617 267 CAD | 1 312 078 USD | 21 juillet 2021 | 7 498 |
| Citibank NA | A+ | 1 617 267 CAD | 1 312 078 USD | 21 juillet 2021 | 7 498 |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 3 631 350 CAD | 2 936 085 USD | 21 juillet 2021 | 4 448 |
| Citibank NA | A+ | 808 765 CAD | 656 039 USD | 21 juillet 2021 | 3 618 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 623 040 CAD | 1 312 078 USD | 21 juillet 2021 | 1 725 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 607 464 CAD | 1 298 960 USD | 21 juillet 2021 | 1 058 |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 153 657 CAD | 124 554 USD | 15 septembre 2021 | 583 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 168 305 CAD | 136 337 USD | 15 septembre 2021 | 526 |
| Banque Royale du Canada | AA- | 153 735 CAD | 124 554 USD | 15 septembre 2021 | 504 |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 153 779 CAD | 124 554 USD | 15 septembre 2021 | 460 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 12 220 USD | 15 155 CAD | 2 juillet 2021 | 23 |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 1 624 746 CAD | 1 312 078 USD | 21 juillet 2021 | 19 |
| | | | | | 69 245 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 234 CAD | 189 USD | 2 juillet 2021 | — |
| Brown Brothers Harriman & Co. | A+ | 444 CAD | 358 USD | 2 juillet 2021 | — |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 1 312 078 USD | 1 624 772 CAD | 15 septembre 2021 | (13) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 298 960 USD | 1 607 490 CAD | 15 septembre 2021 | (1 052) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 312 078 USD | 1 623 072 CAD | 15 septembre 2021 | (1 714) |
| Citibank NA | A+ | 656 039 USD | 808 778 CAD | 15 septembre 2021 | (3 615) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 2 936 085 USD | 3 631 382 CAD | 15 septembre 2021 | (4 460) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 663 947 USD | 815 231 CAD | 21 juillet 2021 | (6 945) |
| Citibank NA | A+ | 1 312 078 USD | 1 617 293 CAD | 15 septembre 2021 | (7 492) |
| Citibank NA | A+ | 1 312 078 USD | 1 617 293 CAD | 15 septembre 2021 | (7 492) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 713 988 USD | 875 960 CAD | 21 juillet 2021 | (8 182) |
| Citibank NA | A+ | 837 746 USD | 1 028 631 CAD | 21 juillet 2021 | (8 763) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 951 985 USD | 1 168 561 CAD | 21 juillet 2021 | (10 295) |
| Banque Royale du Canada | AA- | 1 716 606 USD | 2 115 401 CAD | 15 septembre 2021 | (10 324) |
| Goldman Sachs Bank USA | A+ | 1 028 143 USD | 1 261 902 CAD | 21 juillet 2021 | (11 263) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 2 624 155 USD | 3 235 109 CAD | 15 septembre 2021 | (14 462) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 1 339 918 USD | 1 644 435 CAD | 21 juillet 2021 | (14 806) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 361 338 USD | 1 670 845 CAD | 21 juillet 2021 | (14 920) |
| Banque Toronto-Dominion | AA- | 3 161 744 USD | 3 898 797 CAD | 15 septembre 2021 | (16 485) |
| Banque Canadienne Impériale de Commerce | A+ | 1 903 969 USD | 2 338 074 CAD | 21 juillet 2021 | (19 639) |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 1 496 180 USD | 1 831 566 CAD | 21 juillet 2021 | (21 175) |
| JPMorgan Chase & Co. | A+ | 2 008 687 USD | 2 459 738 CAD | 21 juillet 2021 | (27 649) |
| Morgan Stanley Capital Services Inc. | A+ | 2 008 687 USD | 2 459 142 CAD | 21 juillet 2021 | (28 246) |
| Banque de Montréal | A+ | 3 327 310 USD | 4 084 473 CAD | 21 juillet 2021 | (35 785) |
| | | | | | (274 777) |
| | | | | | (205 532) |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 3 060 975 \$ (2 359 071 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Couronne danoise | 1 773 799 | 0,65 | 912 887 | 0,36 |
| Dollar américain | 21 419 320 | 7,88 | 15 850 582 | 6,21 |
| Euro | 2 946 426 | 1,08 | 2 752 661 | 1,08 |
| Franc suisse | 3 117 519 | 1,15 | 2 843 716 | 1,11 |
| Livre sterling | 1 352 690 | 0,50 | 1 230 859 | 0,48 |
| Total | 30 609 754 | 11,26 | 23 590 705 | 9,24 |

Risque de crédit (voir note 6)

| Titres de créance par cote de crédit | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|---------------|------------------|
| | % | % |
| R1 Élevé | 16,78 | 39,18 |
| R1 Bas | 83,22 | 60,82 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créances. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | 5 063 867 | 261 873 110 | 2 933 779 | 239 171 882 |
| Encaisse | — | 14 228 561 | — | 11 061 464 |
| Autres actifs | — | 982 270 | — | 3 024 506 |
| Passifs | — | 10 479 694 | — | 986 732 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 81 591 \$ (56 172 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| 261 873 110 | 26 187 311 | 239 171 882 | 23 917 188 |

Si les prix des actions transigées avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 26 187 311 \$ (23 917 188 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Une proportion se situant entre 70 % et 100 % de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables doit être investie en titres de capitaux propres. Le portefeuille de chaque sous-conseiller doit être investi dans au moins 30 titres répartis dans au moins 7 secteurs de l'indice de dividendes composé S&P/TSX.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Services financiers | 30,40 | 31,10 |
| Produits industriels | 14,10 | 15,50 |
| Énergie | 9,40 | 7,30 |
| Technologies de l'information | 7,30 | 8,10 |
| Autres | 6,20 | 5,10 |
| Services de communication | 6,10 | 5,10 |
| Consommation de base | 5,70 | 6,10 |
| Matériaux de base | 4,80 | 6,20 |
| Biens de consommation | 3,40 | 4,00 |
| Immobilier | 3,30 | — |
| Santé | 3,20 | 2,30 |
| Fonds indiciels | 3,20 | 5,20 |
| Services aux collectivités | 2,90 | 4,00 |

Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|------------------------------------|--------------------|------------------|----------------|--------------------|
| Actions et fonds de placements | 261 873 110 | — | — | 261 873 110 |
| Obligations | — | 1 864 054 | — | 1 864 054 |
| Instruments de marché monétaire | — | 3 199 813 | — | 3 199 813 |
| Contrats de change à terme | — | (205 532) | — | (205 532) |
| Total | 261 873 110 | 4 858 335 | — | 266 731 445 |

| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|------------------------------------|--------------------|------------------|----------------|--------------------|
| Actions et fonds de placements | 239 171 882 | — | — | 239 171 882 |
| Obligations | — | 1 104 268 | — | 1 104 268 |
| Instruments de marché monétaire | — | 1 829 511 | — | 1 829 511 |
| Contrats de change à terme | — | 1 409 026 | — | 1 409 026 |
| Total | 239 171 882 | 4 342 805 | — | 243 514 687 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Prêt de titres

Le Portefeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portefeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portefeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| Juste valeur des titres prêtés | 9 844 324 | 6 577 622 |
| Juste valeur de la garantie | 10 348 551 | 6 911 398 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portefeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portefeuille.

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|--|--------------------|--------------------|
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 43 167 | 17 322 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (16 982) | (7 639) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 26 185 | 9 683 |

Portefeuille FDP Actions globales

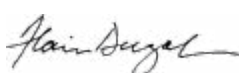
États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ (non audité) | 31 décembre 2020 \$ (audité) |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | | |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 1 058 892 | 935 324 |
| Encaisse | 30 400 | 13 414 |
| Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 2 | — |
| Souscriptions à recevoir | 2 015 | 2 981 |
| Produit de la vente de placements à recevoir | 3 603 | — |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 1 445 | 1 283 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 425 | 425 |
| | 1 096 782 | 953 427 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Montant à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme | 6 | — |
| Rachats à payer | — | 530 |
| Frais de gestion à payer | 411 | 379 |
| Acquisitions de titres à payer | 2 899 | — |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 40 | 118 |
| | 3 356 | 1 027 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 1 093 426 | 952 400 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 52 315 | 49 068 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 20,901 | 19,410 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 213 652 | 197 998 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 879 774 | 754 402 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 8 610 | 8 611 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 43 705 | 40 457 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 24,813 | 22,994 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 20,130 | 18,647 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

Portefeuille FDP Actions globales

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

Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin

2021

2020

\$

\$

(en milliers de dollars canadiens)

(non audité)

(non audité)

SÉRIE A

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

197 998

176 300

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

15 802

(3 907)

213 800

172 393

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(106)

(188)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(106)

(188)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

11 575

5 464

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

106

188

Rachats de parts rachetables

(11 723)

(4 517)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

(42)

1 135

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

213 652

173 340

SÉRIE I

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

754 402

368 952

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

66 962

(10 086)

821 364

358 866

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(5 127)

(2 731)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(5 127)

(2 731)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

134 464

198 481

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

5 127

2 731

Rachats de parts rachetables

(76 054)

(32 005)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

63 537

169 207

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

879 774

525 342

Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin

2021

2020

\$

\$

(en milliers de dollars canadiens)

(non audité)

(non audité)

TOTAL DES SÉRIES

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période

952 400

545 252

Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables

82 764

(13 993)

1 035 164

531 259

Distributions aux porteurs de parts rachetables

Revenu net de placement distribué

(5 233)

(2 919)

Distributions totales aux porteurs de parts rachetables

(5 233)

(2 919)

Transactions sur parts rachetables

Produit de l'émission de parts rachetables

146 039

203 945

Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables

5 233

2 919

Rachats de parts rachetables

(87 777)

(36 522)

Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables

63 495

170 342

Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période

1 093 426

698 682

Portefeuille FDP Actions globales

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|-----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Intérêts | 16 | 81 |
| Dividendes | 8 168 | 5 267 |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 46 | 11 |
| Autres revenus | 311 | 12 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 32 551 | 14 743 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 80 | (112) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (755) | 213 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 1 419 | 824 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 44 774 | (32 013) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur contrats de change à terme | (4) | (1) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 303 | 77 |
| | 86 909 | (10 898) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 2 380 | 1 714 |
| Honoraires d'audit | 5 | 5 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 5 | 3 |
| Frais de garde | 187 | 123 |
| Frais juridiques | 25 | 28 |
| Droits et dépôts | 38 | 21 |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 142 | 86 |
| Autres | 6 | 40 |
| Coût d'opération (note 9) | 240 | 369 |
| | 3 028 | 2 389 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 83 881 | (13 287) |
| Retenues fiscales étrangères | (1 117) | (706) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 82 764 | (13 993) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 15 802 | (3 907) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 66 962 | (10 086) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 8 641 | 8 283 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 41 702 | 27 439 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 1,829 | (0,472) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 1,606 | (0,368) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|-----------------|------------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 82 764 | (13 993) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (32 551) | (14 743) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur contrats de change à terme | (80) | 112 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 755 | (213) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (44 774) | 32 013 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme | 4 | 1 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (303) | (77) |
| Distribution des revenus des fonds sous-jacents | (28) | (19) |
| Achats de placements | (267 347) | (411 875) |
| Produit de la vente de placements | 221 132 | 245 575 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Produit de la vente de placements à recevoir | (3 603) | (1 246) |
| Intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | (162) | 316 |
| Frais de gestion à payer | 32 | 16 |
| Acquisitions de titres à payer | 2 899 | 690 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | (78) | (195) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | (41 340) | (163 638) |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 147 005 | 203 906 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (88 307) | (36 270) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | 58 698 | 167 636 |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 17 358 | 3 998 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme | 80 | (112) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (755) | 213 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 303 | 77 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 13 414 | 6 232 |
| Encaisse à la clôture de la période | 30 400 | 10 408 |
| Intérêts reçus inclus dans les activités opérationnelles | 16 | 81 |
| Dividendes reçus inclus dans les activités opérationnelles | 7 831 | 4 991 |
| Retenues d'impôts | 1 144 | 676 |

Portefeuille FDP Actions globales

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ | | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Actions internationales (80,11 %) | | | | | | | |
| Allemagne (2,33 %) | | | | | | | |
| adidas AG | 26 789 | 8 995 386 | 12 348 721 | Fiserv, Inc. | 87 361 | 10 404 054 | 11 563 267 |
| Bayer AG, actions nominatives | 79 611 | 8 921 484 | 5 986 900 | Fortive Corporation | 49 338 | 4 700 385 | 4 260 782 |
| E.ON SE | 205 489 | 2 990 089 | 2 943 374 | Hess Corporation | 18 950 | 1 620 970 | 2 049 032 |
| Henkel AG & Co. KGaA, privilégiées | 32 098 | 4 067 343 | 4 196 984 | Honeywell International Inc. | 26 358 | 4 092 079 | 7 159 389 |
| | | 24 974 302 | 25 475 979 | Ingersoll Rand Inc. | 79 998 | 4 015 743 | 4 835 193 |
| Belgique (0,29 %) | | | | Intel Corporation | 44 127 | 3 333 678 | 3 067 628 |
| KBC Group NV | 33 719 | 3 234 350 | 3 183 903 | Johnson & Johnson | 53 120 | 8 353 201 | 10 836 349 |
| Bermudes (0,25 %) | | | | JPMorgan Chase & Co. | 54 743 | 5 518 894 | 10 543 786 |
| Axalta Coating Systems, Ltd. | 37 653 | 1 472 293 | 1 421 618 | L3Harris Technologies, Inc. | 12 131 | 2 790 479 | 3 246 966 |
| Credicorp Ltd. | 8 570 | 1 744 978 | 1 285 247 | Lear Corporation | 13 453 | 2 341 023 | 2 919 963 |
| | | 3 217 271 | 2 706 865 | LKQ Corporation | 58 516 | 3 177 886 | 3 566 499 |
| Canada (3,16 %) | | | | Lockheed Martin Corporation | 10 740 | 3 440 713 | 5 031 806 |
| Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada | 23 098 | 2 916 814 | 3 018 110 | Marsh & McLennan Companies, Inc. | 48 339 | 6 528 988 | 8 420 849 |
| Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique | 126 920 | 9 106 629 | 12 092 127 | Masco Corporation | 53 439 | 3 567 012 | 3 898 282 |
| CGI inc. | 75 607 | 7 034 427 | 8 497 471 | MasterCard Incorporated, cat. A | 6 707 | 2 564 530 | 3 032 174 |
| Dollarama inc. | 169 210 | 7 581 062 | 9 600 975 | Microsoft Corporation | 60 348 | 10 031 356 | 20 244 067 |
| Québecor inc., cat. B | 39 584 | 1 258 887 | 1 308 647 | Moody's Corporation | 9 340 | 2 441 940 | 4 191 071 |
| | | 27 897 819 | 34 517 330 | Nasdaq, Inc. | 15 706 | 2 335 156 | 3 419 088 |
| Corée du Sud (1,38 %) | | | | Nike Inc., cat. B | 36 994 | 4 208 838 | 7 077 136 |
| NAVER Corp. | 17 148 | 3 436 560 | 7 872 263 | Northrop Grumman Corporation | 6 767 | 2 654 434 | 3 045 389 |
| Samsung Electronics Co., Ltd. | 81 116 | 4 730 405 | 7 197 964 | Otis Worldwide Corp. | 44 864 | 3 192 752 | 4 542 740 |
| | | 8 166 965 | 15 070 227 | PepsiCo, Inc. | 11 219 | 1 778 162 | 2 058 450 |
| Danemark (0,42 %) | | | | PPG Industries, Inc. | 34 577 | 4 731 052 | 7 268 991 |
| Novo Nordisk A/S, cat. B | 44 601 | 3 389 304 | 4 627 590 | PRA Health Sciences, Inc. | 12 813 | 1 833 038 | 2 621 278 |
| Espagne (0,37 %) | | | | Quest Diagnostics Incorporated | 19 934 | 3 182 716 | 3 257 583 |
| Amadeus IT Group, SA | 45 959 | 2 953 432 | 4 003 556 | Ross Stores Inc. | 26 707 | 3 635 034 | 4 100 839 |
| Étas-Unis (41,55 %) | | | | Stanley Black & Decker, Inc. | 13 887 | 2 534 540 | 3 525 064 |
| 3M Company | 19 140 | 3 718 958 | 4 707 742 | Starbucks Corporation | 30 653 | 2 762 521 | 4 244 040 |
| Abbott Laboratories | 16 518 | 1 433 916 | 2 371 260 | Stryker Corporation | 18 081 | 4 312 794 | 5 815 277 |
| Agilent Technologies, Inc. | 25 063 | 2 815 043 | 4 587 359 | Texas Instruments Incorporated | 51 725 | 6 171 024 | 12 317 020 |
| Alphabet Inc., cat. A | 8 556 | 14 197 688 | 25 870 508 | The Blackstone Group, Inc. | 29 032 | 1 539 952 | 3 492 215 |
| American Tower Corporation | 25 012 | 7 254 268 | 8 366 873 | The Charles Schwab Corporation | 157 082 | 8 662 782 | 14 162 611 |
| Amphenol Corp., cat. A | 80 524 | 4 139 302 | 6 821 357 | The Estée Lauder Companies Inc., cat. A | 9 075 | 1 679 541 | 3 574 447 |
| Analog Devices, Inc. | 30 201 | 3 827 634 | 6 438 422 | The Goldman Sachs Group, Inc. | 17 025 | 4 431 875 | 8 001 273 |
| Apple Inc. | 62 115 | 4 295 600 | 10 534 553 | The Home Depot, Inc. | 11 153 | 3 353 879 | 4 404 113 |
| Bank of America Corporation | 160 322 | 5 919 237 | 8 185 257 | The Sherwin-Williams Company | 13 636 | 2 574 394 | 4 600 443 |
| Becton, Dickinson and Company | 37 946 | 12 066 818 | 11 427 141 | The TJX Companies, Inc. | 45 807 | 3 107 892 | 3 824 252 |
| BlackRock, Inc. | 3 406 | 1 879 012 | 3 690 317 | The Travelers Companies, Inc. | 23 969 | 3 130 746 | 4 443 515 |
| Boston Scientific Corporation | 241 299 | 11 803 208 | 12 776 712 | Thermo Fisher Scientific Inc. | 11 891 | 3 810 608 | 7 428 132 |
| Choe Global Markets, Inc. | 22 730 | 2 724 058 | 3 350 848 | T-Mobile US, Inc. | 26 827 | 4 181 490 | 4 811 234 |
| Charter Communications, Inc., cat. A | 6 124 | 5 059 720 | 5 471 007 | Truist Financial Corporation | 99 160 | 6 435 455 | 6 814 835 |
| Church & Dwight Co., Inc. | 36 560 | 3 648 249 | 3 858 101 | Union Pacific Corporation | 16 550 | 3 480 836 | 4 507 216 |
| Cigna Corporation | 32 283 | 7 307 394 | 9 477 120 | Verisk Analytics, Inc., cat. A | 18 164 | 3 575 267 | 3 929 886 |
| Cognizant Technology Solutions Corp., cat. A | 36 432 | 2 895 634 | 3 124 578 | Visa Inc., cat. A | 26 158 | 4 165 314 | 7 573 769 |
| Colgate-Palmolive Company | 88 840 | 8 298 123 | 8 949 360 | Vulcan Materials Co. | 14 961 | 2 360 813 | 3 224 857 |
| Comcast Corporation, cat. A | 145 772 | 6 739 833 | 10 292 650 | Xcel Energy Inc. | 34 152 | 3 022 496 | 2 786 093 |
| ConocoPhillips | 48 906 | 2 946 343 | 3 688 122 | Yum China Holding, Inc. | 26 841 | 1 830 255 | 2 201 965 |
| Danaher Corporation | 30 306 | 5 809 087 | 10 070 993 | | | 324 041 944 | 454 320 159 |
| Duke Energy Corporation | 34 003 | 3 786 569 | 4 156 696 | France (3,75 %) | | | |
| Electronic Arts Inc. | 41 902 | 6 075 935 | 7 462 943 | BNP Paribas SA | 54 784 | 4 133 209 | 4 253 409 |
| Equifax Inc. | 28 453 | 5 349 097 | 8 438 740 | Danone SA | 81 768 | 7 315 432 | 7 128 934 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | 47 088 | 6 452 631 | 8 260 646 | Legrand SA | 24 597 | 1 877 026 | 3 224 135 |
| | | | | L'Oréal SA | 4 332 | 1 318 300 | 2 390 669 |
| | | | | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 6 704 | 2 674 340 | 6 510 385 |
| | | | | Pernod Ricard SA | 34 268 | 6 309 175 | 9 420 387 |
| | | | | Schneider Electric SE | 41 386 | 5 035 128 | 8 063 676 |
| | | | | | | 28 662 610 | 40 991 595 |

Portefeuille FDP Actions globales

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Guernesey (0,14 %) | | | |
| Amdocs Limited | 15 410 | 1 494 581 | 1 476 199 |
| Îles Caïmans (2,11 %) | | | |
| Alibaba Group Holding Limited | 416 900 | 14 313 104 | 14 624 851 |
| Tencent Holdings Limited | 90 200 | 7 247 315 | 8 399 555 |
| | | 21 560 419 | 23 024 406 |
| Inde (0,62 %) | | | |
| HDFC Bank Limited CAAE | 75 297 | 4 096 386 | 6 817 729 |
| Irlande (6,56 %) | | | |
| Accenture PLC, cat. A | 46 590 | 9 029 815 | 17 007 142 |
| Aon PLC, cat. A | 61 757 | 15 351 162 | 18 258 859 |
| Eaton Corporation PLC | 26 274 | 3 120 151 | 4 821 050 |
| Flutter Entertainment PLC | 15 720 | 2 334 314 | 3 534 876 |
| Icon Public Limited Company | 22 174 | 5 286 026 | 5 675 856 |
| Johnson Controls International PLC | 69 436 | 3 788 844 | 5 900 986 |
| Medtronic Public Limited Company | 72 666 | 8 773 035 | 11 169 504 |
| STERIS Public Limited Company | 16 428 | 3 847 272 | 4 196 718 |
| Willis Towers Watson PLC | 4 032 | 1 066 351 | 1 148 450 |
| | | 52 596 970 | 71 713 441 |
| Italie (0,16 %) | | | |
| Eni SPA | 119 127 | 1 915 680 | 1 796 614 |
| Japon (3,72 %) | | | |
| Daikin Industries, Ltd. | 10 900 | 1 864 996 | 2 516 106 |
| Fujitsu Limited | 22 200 | 3 721 624 | 5 151 792 |
| KDDI Corporation | 193 800 | 5 840 989 | 7 492 022 |
| KOSE Corporation | 33 400 | 5 901 671 | 6 513 733 |
| Kubota Corporation | 156 000 | 3 291 844 | 3 910 837 |
| Kyocera Corporation | 34 100 | 2 725 020 | 2 612 923 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 610 700 | 4 169 016 | 4 088 778 |
| Nomura Research Institute, Ltd. | 55 200 | 1 270 252 | 2 263 281 |
| Santen Pharmaceutical Co., Ltd. | 54 200 | 1 014 212 | 925 194 |
| Secom Co., Ltd. | 37 100 | 4 100 094 | 3 495 137 |
| Yokogawa Electric Corporation | 89 700 | 2 097 177 | 1 661 279 |
| | | 35 996 895 | 40 631 082 |
| Jersey (0,48 %) | | | |
| Aptiv PLC | 16 047 | 1 722 237 | 3 126 305 |
| Experian PLC | 45 361 | 1 635 049 | 2 161 846 |
| | | 3 357 286 | 5 288 151 |
| Pays-Bas (2,05 %) | | | |
| Akzo Nobel NV | 18 303 | 2 341 640 | 2 800 684 |
| Heineken NV | 37 664 | 3 883 533 | 5 652 642 |
| NXP Semiconductors NV | 17 049 | 2 774 680 | 4 343 115 |
| Wolters Kluwer NV | 77 120 | 8 063 749 | 9 594 606 |
| | | 17 063 602 | 22 391 047 |
| Royaume-Uni (3,86 %) | | | |
| Burberry Group PLC | 149 407 | 4 049 142 | 5 280 346 |
| Croda International Public Limited Company | 7 442 | 540 089 | 937 994 |
| Diageo PLC | 229 626 | 10 965 501 | 13 595 142 |
| Natwest Group PLC | 1 598 486 | 4 971 820 | 5 556 402 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 94 202 | 10 399 427 | 10 308 550 |
| RELX PLC | 88 973 | 2 463 697 | 2 937 167 |
| Tesco PLC | 948 113 | 4 707 605 | 3 616 002 |
| | | 38 097 281 | 42 231 603 |

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|--|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Suisse (5,92 %) | | | |
| Chubb Limited | 31 809 | 5 228 150 | 6 260 501 |
| Compagnie Financière Richemont SA, série A actions nominatives | 34 248 | 3 152 038 | 5 136 281 |
| Compagnie Financière Richemont SA bons de souscription (éch. 11/22/23) | 61 782 | 19 442 | 51 315 |
| Julius Baer Group, Ltd. | 31 182 | 1 775 900 | 2 522 241 |
| Nestlé SA, actions nominatives | 124 786 | 14 596 368 | 19 261 192 |
| Roche Holding AG | 30 814 | 11 933 311 | 14 388 072 |
| Schindler Holding AG, certificat de participation | 9 706 | 2 967 997 | 3 679 732 |
| Sika AG, actions nominatives | 6 756 | 1 252 568 | 2 737 817 |
| TE Connectivity Limited | 26 890 | 3 248 509 | 4 502 207 |
| UBS Group AG, actions nominatives | 329 423 | 6 241 119 | 6 248 943 |
| | | 50 415 402 | 64 788 301 |
| Taiwan (0,99 %) | | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Company, Ltd., CAAE | 73 047 | 4 089 083 | 10 868 965 |
| Total des actions internationales | | 657 221 582 | 875 924 742 |
| Fonds de placements (16,73 %) | | | |
| Fonds d'action (0,49 %) | | | |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 157 722 | 4 027 448 | 5 310 180 |
| Fonds indiciciels (16,24 %) | | | |
| Invesco QQQ Trust, série 1 | 60 900 | 17 705 216 | 26 728 442 |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF | 190 000 | 33 829 279 | 35 463 302 |
| iShares Core MSCI EAFE ETF | 666 000 | 57 845 570 | 61 737 626 |
| iShares Russell 2000 Index ETF | 91 000 | 24 446 985 | 25 846 627 |
| SPDR S&P 500 ETF Trust | 52 600 | 25 056 274 | 27 881 508 |
| | | 158 883 324 | 177 657 505 |
| Total des fonds de placements | | 162 910 772 | 182 967 685 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (475 139) | — |
| Total des placements (96,84 %) | | 819 657 215 | 1 058 892 427 |
| Contrats de change à terme (- 0,00 %) | | | (4 318) |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (3,16 %) | | | 34 538 156 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 1 093 426 265 |

Portefeuille FDP Actions globales

Tableau des contrats de change à terme

Au 30 juin 2021

| Contrepartie | Cote de crédit | Vente | | Achat | | Date de règlement | Gain (perte) non réalisé(e) \$ |
|---------------------------------|----------------|-----------|-----|-------------|-----|-------------------|-----------------------------------|
| HSBC Bank USA NA | A+ | 498 130 | GBP | 689 332 | USD | 1 juillet 2021 | 1 474 |
| | | | | | | | 1 474 |
| State Street Bank and Trust Co. | AA- | 2 470 100 | JPY | 22 234 | USD | 1 juillet 2021 | (26) |
| HSBC Bank USA NA | A+ | 86 505 | GBP | 119 412 | USD | 2 juillet 2021 | (111) |
| BNP Paribas SA | A+ | 232 888 | GBP | 321 414 | USD | 2 juillet 2021 | (382) |
| Merrill Lynch | A+ | 1 068 559 | USD | 118 126 687 | JPY | 1 juillet 2021 | (5 273) |
| | | | | | | | (5 792) |
| | | | | | | | (4 318) |

Portefeuille FDP Actions globales

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 104 467 940 \$ (91 534 756 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------------|----------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Couronne danoise | 4 647 867 | 0,43 | 3 611 018 | 0,38 |
| Dollar américain | 764 695 778 | 69,94 | 665 409 184 | 69,87 |
| Dollar australien | 2 223 | 0,00 | 1 019 064 | 0,11 |
| Dollar de Hong Kong | 23 024 406 | 2,11 | 10 226 882 | 1,07 |
| Euro | 96 730 504 | 8,85 | 91 508 567 | 9,61 |
| Franc suisse | 54 715 594 | 5,00 | 47 962 432 | 5,04 |
| Livre sterling | 45 134 487 | 4,13 | 38 731 185 | 4,07 |
| Won sud-coréen | 15 070 227 | 1,38 | 16 271 893 | 1,71 |
| Yen japonais | 40 658 313 | 3,72 | 40 607 336 | 4,26 |
| Total | 1 044 679 399 | 95,56 | 915 347 561 | 96,12 |

Risque de crédit (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------------|--------------|------------------|
| Titres de créance par cote de crédit | % | % |
| R1 Élevé | — | 47,00 |
| R1 Modéré | — | 53,00 |
| Total | — | 100,00 |

Le Portefeuille est exposé directement au risque de crédit en majeure partie par ses placements en titres de créances. Au 30 juin 2021, le Portefeuille ne détient aucun titres de créances. La politique du Portefeuille en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres de créance de grande qualité et offrant un degré de liquidité très élevé.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|---------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ | Instruments portant intérêt \$ | Instruments ne portant pas intérêt \$ |
| Placements | — | 1 058 892 427 | 3 821 712 | 931 502 441 |
| Encaisse | — | 30 399 515 | — | 13 413 877 |
| Autres actifs | — | 7 490 109 | — | 4 689 791 |
| Passifs | — | 3 355 786 | — | 1 027 451 |

Si les taux d'intérêt en vigueur sur le marché avaient augmenté ou diminué de 1 % (100 points de base (pb)), toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 0 \$ (3 260 \$ au

31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

Risque de prix (voir note 6)

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 1 058 892 427 | 105 889 243 | 931 502 441 | 93 150 244 |

Si les prix des titres transigés avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 105 889 243 \$ (93 150 244 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Une proportion se situant entre 85 % et 100 % de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables doit être investie en titres de capitaux propres. Le portefeuille de chaque sous-conseiller doit être investi dans au moins 70 titres répartis dans au moins 7 secteurs de l'indice MSCI Monde.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------|-------------------|-----------------------|
| Amérique du Nord | 56,00 | 55,60 |
| Europe | 26,40 | 26,40 |
| Asie | 12,40 | 13,00 |
| Encaisse | 2,80 | 1,80 |
| Amérique latine | 2,40 | 3,20 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|------------------------------------|----------------------|------------------|----------------|----------------------|
| Actions et fonds de placements | 1 058 892 427 | — | — | 1 058 892 427 |
| Total | 1 058 892 427 | — | — | 1 058 892 427 |
| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
| Actions et fonds de placements | 931 502 441 | — | — | 931 502 441 |
| Instruments de marché monétaire | — | 3 821 712 | — | 3 821 712 |
| Total | 931 502 441 | 3 821 712 | — | 935 324 153 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Portefeuille FDP Actions globales

Prêt de titres

Le Portefeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portefeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portefeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 | 31 décembre 2020 |
|--------------------------------|--------------|------------------|
| | \$ | \$ |
| Juste valeur des titres prêtés | 86 209 805 | 31 750 126 |
| Juste valeur de la garantie | 90 561 240 | 33 352 044 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portefeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portefeuille.

| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
|---|--------------|--------------|
| | \$ | \$ |
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 79 162 | 21 428 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (32 966) | (10 562) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 46 196 | 10 866 |

Portefeuille FDP Actions américaines

États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--|-----------------------|---------------------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | (non audité) | (audité) |
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 44 577 | 39 943 |
| Encaisse | 949 | 549 |
| Souscriptions à recevoir | 33 | 66 |
| Dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 88 | 168 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 10 | 10 |
| | 45 657 | 40 736 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Frais de gestion à payer | 34 | 31 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 46 | 26 |
| | 80 | 57 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 45 577 | 40 679 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 2 316 | 2 296 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 19,680 | 17,715 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.



Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration



Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|---|---------------|---------------|
| (en milliers de dollars canadiens) | (non audité) | (non audité) |
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 40 679 | 34 935 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 549 | 104 |
| | 45 228 | 35 039 |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 3 956 | 2 604 |
| Rachats de parts rachetables | (3 607) | (2 084) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 349 | 520 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 45 577 | 35 559 |

Portefeuille FDP Actions américaines

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 7 | 6 |
| Autres revenus | 10 | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 665 | 48 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (5) | (5) |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 249 | 295 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 3 902 | (28) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 1 | 3 |
| | 4 829 | 319 |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 196 | 155 |
| Honoraires d'audit | 3 | 1 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 4 | 1 |
| Frais de garde | 24 | 16 |
| Frais juridiques | 9 | — |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 8 | 6 |
| Autres | 3 | 1 |
| Coût d'opération (note 9) | 3 | — |
| | 250 | 180 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 4 579 | 139 |
| Retenues fiscales étrangères | (30) | (35) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 549 | 104 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 4 549 | 104 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 2 307 | 2 262 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 1,971 | 0,046 |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|------------|------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 4 549 | 104 |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (665) | (48) |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 5 | 5 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (3 902) | 28 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (1) | (3) |
| Achats de placements | (3 365) | (351) |
| Produit de la vente de placements | 3 298 | 337 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 80 | 91 |
| Frais de gestion à payer | 3 | (1) |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 20 | (55) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | 22 | 107 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 3 989 | 2 589 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (3 607) | (2 084) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | 382 | 505 |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 404 | 612 |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (5) | (5) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 1 | 3 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 549 | 119 |
| Encaisse à la clôture de la période | 949 | 729 |
| Retenues d'impôts | 32 | 36 |

Portefeuille FDP Actions américaines

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Fonds de placements (97,80 %) | | | |
| Fonds indiciels (97,80 %) | | | |
| Industrial Select Sector SPDR Fund | 10 100 | 1 161 722 | 1 280 699 |
| Invesco QQQ Trust, série 1 | 7 250 | 1 633 915 | 3 181 957 |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF | 7 600 | 1 298 374 | 1 418 532 |
| iShares Core S&P 500 Index ETF (couvert en CAD) | 243 950 | 8 118 558 | 11 265 611 |
| iShares S&P 500 Value ETF | 9 000 | 1 300 771 | 1 645 404 |
| SPDR S&P 500 ETF Trust | 46 330 | 17 512 909 | 24 557 990 |
| SPDR S&P Metals & Mining ETF | 23 000 | 1 258 439 | 1 226 388 |
| Total des fonds de placements | | 32 284 688 | 44 576 581 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (15 382) | — |
| Total des placements (97,80 %) | | 32 269 306 | 44 576 581 |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (2,20 %) | | | 1 000 842 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 45 577 423 |

Portefeuille FDP Actions américaines

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portefeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 3 350 237 \$ (3 021 719 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 33 502 369 | 73,51 | 30 217 185 | 74,28 |

Risque de crédit (voir note 6)

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille n'était pas exposé au risque de crédit, le portefeuille se composant essentiellement de fonds indiciels.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portefeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portefeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portefeuille n'était pas exposé au risque de taux d'intérêt, le portefeuille se composant essentiellement de fonds indiciels.

Risque de prix (voir note 6)

| 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| 44 576 581 | 4 457 658 | 39 943 102 | 3 994 310 |

Si les prix des actions transigées avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portefeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 4 457 658 \$ (3 994 310 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portefeuille est exposé.

La politique du Portefeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement. Une proportion se situant entre 60 % et 100 % de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables doit être investie en titres de capitaux propres.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portefeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portefeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Consommation de base | 32,00 | 32,00 |
| Sensible aux taux d'intérêt | 28,20 | 28,20 |
| Technologies de l'information | 24,60 | 24,60 |
| Produits industriels | 15,20 | 15,20 |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Fonds de placements | 44 576 581 | — | — | 44 576 581 |
| Total | 44 576 581 | — | — | 44 576 581 |

| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Fonds de placements | 39 943 102 | — | — | 39 943 102 |
| Total | 39 943 102 | — | — | 39 943 102 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Prêt de titres

Le Portefeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portefeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portefeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| Juste valeur des titres prêtés | 19 488 025 | 14 184 671 |
| Juste valeur de la garantie | 20 469 052 | 14 900 064 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portefeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portefeuille.

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|---|--------------------|--------------------|
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 11 742 | 10 429 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (5 017) | (4 526) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 6 725 | 5 903 |

Portefeuille FDP Actions pays émergents

États de la situation financière

| Aux | 30 juin 2021 \$ (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) | 31 décembre 2020 \$ (audité) |
|---|---|---------------------------------------|
| Actifs | | |
| Actifs courants | | |
| Placements (note 6) | 150 084 | 117 571 |
| Encaisse | 3 483 | 1 675 |
| Souscriptions à recevoir | 319 | 414 |
| Dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | 1 | 1 |
| Autres éléments d'actif à recevoir | 3 | 3 |
| | 153 890 | 119 664 |
| Passifs | | |
| Passifs courants | | |
| Rachats à payer | — | 78 |
| Frais de gestion à payer | 29 | 25 |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 64 | 51 |
| | 93 | 154 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 153 797 | 119 510 |
| Parts en circulation à la fin de la période (note 10) | 11 618 | 9 428 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part | 13,237 | 12,677 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 13 782 | 12 401 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 140 015 | 107 109 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série A | 795 | 747 |
| Parts en circulation à la fin de la période — série I | 10 824 | 8 680 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 17,341 | 16,595 |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 12,936 | 12,339 |

Pour le gestionnaire du Portefeuille :
Financière des Professionnels – Fonds d'Investissement inc.


Michèle Jémus
Membre du conseil d'administration


Alain Dugal
Membre du conseil d'administration

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

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ (non audité) | 2020 \$ (non audité) |
|---|----------------------------|----------------------------|
| SÉRIE A | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 12 401 | 11 444 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 570 | (744) |
| | 12 971 | 10 700 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | — | (9) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | — | (9) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 1 274 | 257 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | — | 9 |
| Rachats de parts rachetables | (463) | (656) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 811 | (390) |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 13 782 | 10 301 |
| SÉRIE I | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 107 109 | 97 604 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 5 509 | (5 346) |
| | 112 618 | 92 258 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (464) | (768) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (464) | (768) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 36 974 | 7 011 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 464 | 768 |
| Rachats de parts rachetables | (9 577) | (13 902) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 27 861 | (6 123) |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 140 015 | 85 367 |
| TOTAL DES SÉRIES | | |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période | 119 510 | 109 048 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 6 079 | (6 090) |
| | 125 589 | 102 958 |
| Distributions aux porteurs de parts rachetables | | |
| Revenu net de placement distribué | (464) | (777) |
| Distributions totales aux porteurs de parts rachetables | (464) | (777) |
| Transactions sur parts rachetables | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 38 248 | 7 268 |
| Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables | 464 | 777 |
| Rachats de parts rachetables | (10 040) | (14 558) |
| Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables | 28 672 | (6 513) |
| Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période | 153 797 | 95 668 |

Portefeuille FDP Actions pays émergents

États du résultat global

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|---------------|----------------|
| (en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part) (non audité) (non audité) | | |
| Revenus | | |
| Revenus nets provenant des prêts de titres | 17 | 1 |
| Autres revenus | 3 | — |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements | 693 | (230) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (24) | 8 |
| Distributions des revenus des fonds sous-jacents | 991 | 809 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur placements | 4 819 | (6 344) |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur devises étrangères | 2 | 11 |
| | 6 501 | (5 745) |
| Charges | | |
| Frais de gestion du gestionnaire (note 8) | 168 | 122 |
| Honoraires d'audit | 5 | 5 |
| Frais du comité d'examen indépendant | 1 | 2 |
| Frais de garde | 28 | 20 |
| Frais juridiques | 12 | 5 |
| Droits et dépôts | 4 | — |
| Frais de communication aux porteurs de parts | 18 | 19 |
| Autres | 3 | 7 |
| Coût d'opération (note 9) | 35 | 43 |
| | 274 | 223 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables avant impôt | 6 227 | (5 968) |
| Retenues fiscales étrangères | (148) | (122) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 6 079 | (6 090) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série A | 570 | (744) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables — série I | 5 509 | (5 346) |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série A | 774 | 760 |
| Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période — série I | 10 103 | 8 528 |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série A | 0,737 | (0,979) |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables par part — série I | 0,545 | (0,627) |

Tableaux des flux de trésorerie

| Pour les périodes de 6 mois terminées les 30 juin | 2021 \$ | 2020 \$ |
|--|--------------|--------------|
| (en milliers de dollars canadiens) (non audité) (non audité) | | |
| Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles | | |
| Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables | 6 079 | (6 090) |
| Ajustements au titre des éléments suivants : | | |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur la vente de placements | (693) | 230 |
| (Gains nets) pertes nettes réalisé(e)s sur devises étrangères | 24 | (8) |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les placements | (4 819) | 6 344 |
| (Augmentation) diminution de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | (2) | (11) |
| Achats de placements | (34 145) | (20 962) |
| Produit de la vente de placements | 7 144 | 27 556 |
| Variation des éléments hors caisse du fonds de roulement | | |
| Dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir | — | 18 |
| Frais de gestion à payer | 4 | (3) |
| Frais d'exploitation et d'exécution à payer | 13 | (52) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités opérationnelles | (26 395) | 7 022 |
| Flux de trésorerie liés aux activités de financement | | |
| Produit de l'émission de parts rachetables | 38 343 | 7 273 |
| Sommes versées au rachat de parts rachetables | (10 118) | (14 530) |
| Entrées (sorties) de trésorerie nettes liées aux activités de financement | 28 225 | (7 257) |
| Augmentation (diminution) nette de la trésorerie | 1 830 | (235) |
| Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères | (24) | 8 |
| Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les devises étrangères | 2 | 11 |
| Encaisse à l'ouverture de la période | 1 675 | 1 401 |
| Encaisse à la clôture de la période | 3 483 | 1 185 |
| Retenues d'impôts | 148 | 125 |

Portefeuille FDP Actions pays émergents

Relevé des placements

Au 30 juin 2021

| | Nombre d'actions | Coût moyen \$ | Juste valeur \$ |
|---|---------------------|---------------------|-----------------------|
| Fonds de placements (97,59 %) | | | |
| Fonds indiciels (97,59 %) | | | |
| iShares Core MSCI Emerging Markets ETF | 1 381 648 | 98 637 576 | 114 612 837 |
| iShares MSCI Brazil ETF | 72 000 | 3 120 199 | 3 614 449 |
| iShares MSCI Chile ETF | 100 000 | 3 606 137 | 3 588 593 |
| iShares MSCI Emerging Markets ETF | 248 500 | 14 103 067 | 16 970 623 |
| iShares MSCI India ETF | 60 000 | 3 240 761 | 3 287 687 |
| iShares MSCI Malaysia ETF | 26 500 | 998 623 | 838 094 |
| iShares MSCI South Korea ETF | 45 000 | 5 194 567 | 5 192 316 |
| iShares MSCI Taiwan ETF | 25 000 | 1 892 378 | 1 979 732 |
| Total des fonds de placements | | 130 793 308 | 150 084 331 |
| Ajustement pour les coûts d'opérations | | (66 017) | — |
| Total des placements (97,59 %) | | 130 727 291 | 150 084 331 |
| Encaisse et autres éléments d'actif net (2,41 %) | | | 3 712 358 |
| Total de l'actif net (100 %) | | | 153 796 689 |

Portfeuille FDP Actions pays émergents

Risque de change (voir note 6)

Le tableau qui suit présente, en dollars canadiens, l'exposition directe du Portfeuille au risque de change par devise. Si le dollar canadien s'était apprécié ou déprécié de 10 % par rapport à toutes autres devises, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portfeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 15 112 661 \$ (11 820 933 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portfeuille est exposé.

| Devise | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
| | Juste valeur \$ | % de l'actif net | Juste valeur \$ | % de l'actif net |
| Dollar américain | 151 126 608 | 98,26 | 118 209 334 | 98,91 |

Risque de crédit (voir note 6)

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portfeuille n'était pas exposé au risque de crédit, le portefeuille se composant essentiellement d'actions ordinaires.

Risque de liquidité (voir note 6)

Le Portfeuille est exposé quotidiennement à des rachats en trésorerie. Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portfeuille a investi la majorité de ses actifs dans des placements négociés sur un marché actif et dont il peut facilement se départir. Le Portfeuille essaie également de conserver suffisamment d'encaisse et d'équivalents de trésorerie pour répondre aux besoins de liquidités courants.

Risque de taux d'intérêt (voir note 6)

Au 30 juin 2021 et au 31 décembre 2020, le Portfeuille n'était pas exposé au risque de taux d'intérêt, le portefeuille se composant essentiellement d'actions ordinaires.

Risque de prix (voir note 6)

La politique du Portfeuille consiste à gérer le risque de prix par la diversification et la sélection de placements qui s'inscrivent dans les limites établies dans les directives de placement énoncées dans la politique de placement.

| | 30 juin 2021 | | 31 décembre 2020 | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| | Juste valeur \$ | Variation \$ | Juste valeur \$ | Variation \$ |
| | 150 084 331 | 15 008 433 | 117 570 863 | 11 757 086 |

Si les prix des actions transigées avaient augmenté ou diminué de 10 %, toutes choses étant égales par ailleurs, l'actif net et le résultat global du Portfeuille auraient diminué ou augmenté, respectivement, d'environ 15 008 433 \$ (11 757 086 \$ au 31 décembre 2020). Cette analyse de sensibilité est appliquée sur les risques directs auxquels le Portfeuille est exposé.

Risque de concentration (voir note 6)

Le tableau qui suit résume le risque de concentration du Portfeuille. Les pourcentages ont été calculés par rapport au total des placements, et ce, en considérant l'exposition du Portfeuille aux positions détenues directement ainsi qu'aux positions sous-jacentes détenues par les fonds de placement, le cas échéant.

| Segment de marché | 30 juin 2021 % | 31 décembre 2020 % |
|---------------------------------|-------------------|-----------------------|
| Asie | 75,00 | 79,50 |
| Amérique | 11,40 | 9,50 |
| Europe, Afrique et Moyen-Orient | 11,10 | 11,00 |
| Encaisse | 2,50 | — |

Information sur les instruments financiers (voir note 7)

Le tableau suivant présente les instruments financiers comptabilisés dans les états de la situation financière, classés selon la hiérarchie des justes valeurs.

| 30 juin 2021 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|--------------------|----------------|----------------|--------------------|
| Fonds de placements | 150 084 331 | — | — | 150 084 331 |
| Total | 150 084 331 | — | — | 150 084 331 |

| 31 décembre 2020 | Niveau 1 \$ | Niveau 2 \$ | Niveau 3 \$ | Total \$ |
|---------------------|--------------------|----------------|----------------|--------------------|
| Fonds de placements | 117 570 863 | — | — | 117 570 863 |
| Total | 117 570 863 | — | — | 117 570 863 |

Au cours de la période terminée le 30 juin 2021 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2020, il n'y a eu aucun transfert de titres entre les niveaux 1 et 2.

Prêt de titres

Le Portfeuille a réalisé des opérations de prêt de titres en 2021 et 2020. Ces opérations permettent au Portfeuille de recevoir des honoraires en échange de son engagement de prêter à un tiers des titres pouvant être retournés au Portfeuille sur demande en échange de la garantie prescrite. La valeur des titres hors trésorerie détenus en garantie doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Les revenus tirés de ces opérations prennent la forme de frais versés par la contrepartie.

| | 30 juin 2021 \$ | 31 décembre 2020 \$ |
|--------------------------------|--------------------|------------------------|
| Juste valeur des titres prêtés | 2 339 939 | 21 649 624 |
| Juste valeur de la garantie | 2 461 607 | 22 835 388 |

Le tableau ci-dessous présente un rapprochement du montant brut tiré des opérations de prêt de titres du Portfeuille et du revenu provenant des prêts de titres à la rubrique « Revenus nets provenant des prêts de titres » dans les états du résultat global du Portfeuille.

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|---|--------------------|--------------------|
| Montant brut tiré des opérations de prêt de titres | 27 348 | 2 684 |
| Montants payés à State Street Bank & Trust Company, Canada | (9 998) | (1 391) |
| Revenus nets provenant des prêts de titres, tel qu'il est inscrit dans les états du résultat global | 17 350 | 1 293 |

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

1. Renseignements généraux

- a) Les Portefeuilles FDP suivants sont des fiducies de fonds d'investissement à capital variable constituées selon les lois de la province de Québec par des actes de fiducie aux dates suivantes :

| Nom | Date de constitution |
|--|---|
| Portefeuille FDP Équilibré | 31 mars 1978 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | 30 avril 2001 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | 3 septembre 2010 (opérationnel le 1 ^{er} novembre 2010) |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 31 mars 1978 |
| Portefeuille FDP Gestion des liquidités | 31 décembre 1987 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 18 décembre 2012 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 31 décembre 1987 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 1 ^{er} février 2008 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 31 mars 2005 |
| Portefeuille FDP Actions américaines | 24 juillet 2000 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 22 juillet 2008 (opérationnel le 8 avril 2009) |

Collectivement, les onze fonds sont appelés les « Portefeuilles FDP ». Le siège social des Portefeuilles FDP, qui est également l'établissement d'affaires principal des Portefeuilles FDP, est situé au 2, Complexe Desjardins, Tour de l'Est, 31^e étage, C.P. 1116, Montréal (Québec) Canada H5B 1C2.

Chaque portefeuille FDP peut émettre un nombre illimité de parts, et ces parts peuvent être émises selon un nombre illimité de séries. En date du 30 juin 2021, les parts de chaque portefeuille sont divisées en deux séries de parts, soit la série A et la série I. La principale différence entre les séries de parts a trait au type d'investisseur, aux honoraires de gestion qui sont payables au gestionnaire de fonds et aux autres frais payés par les séries d'un portefeuille. Les différences entre les frais des séries de parts font en sorte que chaque série a une valeur liquidative par part qui diffère.

- b) L'information fournie dans ces états financiers et dans les notes afférentes couvre les périodes de six mois terminées les 30 juin 2021 et 2020 et est présentée en dollars canadiens. La publication de ces états financiers a été autorisée par Financière des professionnels – Fonds d'investissement inc. le 24 août 2021.
- c) Les conventions désignent Fiducie State Street comme fiduciaire et Financière des professionnels – Fonds d'investissement inc. comme gestionnaire.

2. Mode de présentation

Les présents états financiers semestriels non audités ont été établis conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS), à la norme comptable internationale IAS 34 – *Information financière intermédiaire* ainsi qu'aux normes prescrites par le *Règlement 81-106 sur l'information continue des Fonds d'investissement* en vigueur au 30 juin 2021.

3. Sommaire des principales méthodes comptables

a) Instruments financiers

Classification

Les Portefeuilles FDP classifient leurs instruments financiers dans les catégories suivantes conformément à IFRS 9 – *Instruments financiers* :

Actifs et passifs financiers à la JVRN

Étant donné que les placements des Portefeuilles FDP sont gérés sur une base de juste valeur selon la stratégie d'investissement des Portefeuilles FDP définie dans leur Prospectus simplifié, ces placements ainsi que les instruments financiers dérivés sont classés dans la présente catégorie au moment de la comptabilisation initiale.

Les instruments financiers dérivés sont des contrats financiers dont la valeur découle des variations sous-jacentes des taux d'intérêt, des cours du change ou d'autres prix ou indices financiers ou de marchandises, ils ne requièrent aucun investissement initial et ils sont réglés à une date future. Les Portefeuilles FDP ne désignent aucun dérivé comme élément de couverture dans le cadre d'une relation de couverture.

À l'état de la situation financière, les actifs et passifs à la JVRN incluent les postes qui suivent : « Placements », « Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats à terme », « Montants à recevoir à l'égard des opérations de contrats de change à terme ». À l'état du résultat global, les gains/pertes et revenus tirés de ces instruments financiers sont inclus dans les postes qui suivent : « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats à terme et sur contrats de change à terme », « Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisé(e)s sur contrats à terme et sur contrats de change à terme », « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s à la vente de placements », « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de fonds de placement », « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères », « Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisée sur les placements » et « Augmentation (diminution) de la plus-value non réalisées sur devises étrangères ».

Actifs financiers au coût amorti

Les Portefeuilles FDP incluent dans cette catégorie l'encaisse, les garanties à recevoir en trésorerie, les souscriptions à recevoir, les produits de la vente de placements à recevoir, les intérêts, dividendes et distributions des revenus des fonds sous-jacents à recevoir et les autres éléments d'actifs à recevoir.

Les actifs financiers au coût amorti doivent être dépréciés du montant des pertes de crédits attendues. Étant donnée l'échéance très courte de ces actifs financiers, la solidité financière des contreparties impliquées et l'historique des pertes encourues, le Gestionnaire estime que le risque de perte est très faible. Pour cette raison, aucune dépréciation n'a été comptabilisée pour les actifs au coût amorti.

Passifs financiers au coût amorti

Cette catégorie inclut tous les passifs financiers, sauf ceux classés à la juste valeur par le biais du résultat net. Les Portefeuilles FDP incluent dans cette catégorie les rachats à payer, les frais de gestion à payer, les frais d'exploitation et d'exécution à payer, les acquisitions de titres à payer, les autres éléments de passifs à payer, les montants à payer à l'égard des opérations de contrats à terme et les montants à payer à l'égard des opérations de contrats de change à terme.

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Comptabilisation

Les Portefeuilles FDP comptabilisent les instruments financiers à la juste valeur lors de leur comptabilisation initiale, majorée des coûts de transactions dans les cas des instruments financiers évalués au coût amorti. Les achats ou ventes d'actifs financiers sont comptabilisés à la date de transaction soit la date à laquelle les Portefeuilles FDP s'engagent à vendre ou à acheter l'instrument financier.

Les actifs et passifs financiers à la JVRN sont subséquemment évalués à la juste valeur. Les méthodes comptables utilisées pour l'évaluation de la juste valeur des placements et des dérivés sont les mêmes que pour évaluer la valeur liquidative aux fins de transactions portant sur les porteurs de parts.

Tous les instruments financiers classés comme Actifs financiers au coût amorti et comme Passifs financiers au coût amorti sont évalués subséquemment au coût amorti. Selon cette méthode, les actifs et les passifs financiers reflètent le montant à recevoir ou à payer, actualisés, s'il y a lieu, selon le taux d'intérêt effectif du contrat. Compte tenu de leur nature à court terme leur valeur comptable se rapproche de leur juste valeur.

Les distributions reçues des fonds sous-jacents sont constatées à la date de distribution et sont regroupées au poste : Distributions des revenus des fonds sous-jacents.

Les revenus d'intérêts sont comptabilisés en fonction des intérêts distribuables aux porteurs de parts rachetables, lesquels sont basés sur les taux d'intérêt déclarés des instruments de créance.

Les intérêts à recevoir sont présentés dans les états de la situation financière, en fonction des taux d'intérêt déclarés des instruments de créance.

Les dividendes sont comptabilisés à titre de revenus à la date ex-dividende.

Le coût des placements est déterminé selon la méthode du coût moyen.

Les coûts de transaction des instruments financiers à la JVRN sont passés en charges et inscrits au poste « Coûts de transaction » dans les états du résultat global.

Les gains ou les pertes relatifs aux actifs et aux passifs financiers à la JVRN sont présentés séparément dans les états du résultat global.

Les gains réalisés et les pertes subies sur les opérations de placement ainsi que la plus-value ou la moins-value non réalisée des titres sont calculés à partir du coût établi selon la méthode du coût moyen.

Les garanties reçues sous forme de trésorerie dans le cadre des opérations sur contrats à terme sont comptabilisées comme actif financier aux états de la situation financière, au poste « Garanties à recevoir en trésorerie ».

b) Évaluation de la juste valeur

La juste valeur s'entend du prix qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation.

La juste valeur des actifs et des passifs financiers négociés sur des marchés actifs (comme les titres négociables cotés) est fondée sur le cours de clôture des marchés à la date de présentation de l'information financière. Les Portefeuilles FDP utilisent le dernier cours pour les actifs et passifs financiers lorsque ce cours s'inscrit dans l'écart acheteur-vendeur du jour. Lorsque le dernier cours ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine

le point d'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 passifs financiers qui ne sont pas négociés sur un marché actif, y compris les dérivés hors cote, est déterminée au moyen de techniques d'évaluation. Les Portefeuilles FDP 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'un autre instrument identique en substance, l'analyse des flux de trésorerie actualisés, les modèles de valorisation des options et d'autres techniques couramment utilisées par les intervenants du marché et fondées au maximum sur des données de marché observables. Voir la note 7 pour plus de renseignements sur les évaluations de la juste valeur des Portefeuilles FDP.

c) Instruments dérivés

Contrats à terme

Afin de s'exposer à différents marchés financiers, les Portefeuilles FDP peuvent conclure des contrats à terme en vertu desquels ces Portefeuilles FDP reçoivent ou versent une somme déterminée en fonction de l'augmentation ou de la diminution du cours de l'instrument financier sous-jacent. Ces sommes sont reçues ou versées quotidiennement par l'entremise de courtiers agissant à titre d'intermédiaires. Les contrats à terme sont garantis par la trésorerie et les équivalents de trésorerie, tels que des instruments de marché monétaire. Les Portefeuilles FDP détiennent suffisamment de trésorerie et d'équivalents de trésorerie pour couvrir entièrement leurs obligations liées à ces contrats. Ces contrats à terme sont présentés au poste « Montant à payer ou à recevoir à l'égard des opérations de contrats à terme » dans les états de la situation financière. Les paiements quotidiens, de même que tout paiement reçu ou versé à l'égard de ces contrats lorsque les Portefeuilles FDP y mettent fin, sont inscrits au poste « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur les contrats à terme » dans les états du résultat global. Les contrats à terme cotés en bourse sont évalués à la juste valeur, qui correspond au cours de clôture.

Contrats de change à terme

Les Portefeuilles FDP peuvent également conclure des contrats de change à terme afin de s'exposer aux marchés de change internationaux ou de réduire leur risque de change au sein de leur portefeuille. Les gains ou les pertes sur ces contrats sont inscrits au poste « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur contrats de change à terme » dans les états du résultat global. La juste valeur des contrats de change à terme correspond aux gains (pertes) qui seraient réalisé(e)s si, à la date d'évaluation, ces contrats étaient liquidés.

d) Conversion de devises

Les souscriptions et rachats des Portefeuilles FDP sont libellés en dollars canadiens, le dollar canadien constituant la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation des Portefeuilles FDP.

Les transactions en devises sont converties dans la monnaie fonctionnelle au cours de change en vigueur.

Les actifs et passifs libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle au cours de change en vigueur à la date d'évaluation.

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Les écarts de conversion se rapportant à la trésorerie sont présentés à titre de « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur devises étrangères » et les écarts de conversion se rapportant à d'autres actifs et passifs financiers sont présentés sous les postes « Gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements » et « Plus-value (moins-value) non réalisée sur placements » dans l'état du résultat global.

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

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

f) Décomptabilisation

Les actifs financiers sont décomptabilisés quand les droits contractuels aux flux de trésorerie des investissements ont expiré ou que les Portefeuilles FDP ont transféré d'une manière substantielle le risque ainsi que l'avantage financier de leur participation (propriété). Les passifs financiers sont décomptabilisés quand une entente contractuelle spécifie que l'obligation face à ce passif est acquittée, annulée ou expirée.

g) Classement et évaluation des parts rachetables

La valeur liquidative d'une part est calculée chaque jour ouvrable où la Bourse de Toronto est ouverte, en divisant la valeur liquidative par le nombre de parts en circulation.

L'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables est classé à titre de passif financier puisque celui-ci respecte les critères afférents à une telle classification.

La valeur liquidative d'un fonds correspond à la différence entre le total de son actif et le total de son passif.

h) Distributions aux porteurs de parts

Conformément aux dispositions de la convention de fiducie, les Portefeuilles FDP peuvent distribuer le revenu net mensuellement aux porteurs de parts, par l'émission de parts additionnelles ou en espèces sur demande du porteur pour les comptes non enregistrés. Les gains en capital nets réalisés sont distribués annuellement par l'émission de parts additionnelles ou en espèces sur demande du porteur pour les comptes non enregistrés.

i) Impôts

Les Portefeuilles FDP répondent à la définition de fiducie de fonds commun de placement en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du résultat net des Portefeuilles FDP aux fins fiscales et une part suffisante des gains en capital nets réalisés au cours de tout exercice doivent être distribués aux porteurs de parts de manière à ce que les Portefeuilles FDP n'aient aucun impôt à payer.

Les Portefeuilles FDP ne comptabilisent donc pas d'impôt sur le résultat, donc 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. Voir la note 11 pour les pertes en capital inutilisées des Portefeuilles FDP, sans date d'expiration.

Les Portefeuilles FDP sont actuellement assujettis à des retenues d'impôt sur les revenus de placement et les gains en capital dans certains pays étrangers. Ces revenus et ces gains sont comptabilisés

au montant brut, et les retenues d'impôt s'y rattachant sont présentées à titre de charge d'impôt dans les états du résultat global.

j) Prêts de titres

Certains portefeuilles FDP participent, contre rémunération supplémentaire, à des programmes de prêts de titres par lesquels ils prêtent des titres qu'ils détiennent à des tiers selon les modalités d'une convention comprenant des restrictions prescrites par les lois canadiennes sur les valeurs mobilières. Ces prêts de titres, le cas échéant, exigent des garanties en trésorerie, en titres de créance ou en titres de capitaux propres de grande qualité qui correspondent au moins à 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Le cas échéant, se référer aux notes propres aux Fonds pour de l'information sur la juste valeur des titres prêtés et la juste valeur de la garantie reçue pour chaque Portefeuille FDP participant à un programme de prêt de titres. Les revenus de prêt de titres sont inscrits au poste « Revenus nets provenant des prêts de titres » à l'état du résultat global. La contrepartie des titres prêtés n'est pas décomptabilisée à l'état de la situation financière, car les Portefeuilles conservent la quasi-totalité des risques et des avantages liés à la propriété du titre.

4. Normes comptables publiées mais non encore adoptées

À la date d'autorisation de ces états financiers, aucune nouvelle norme ou modification ou interprétation des normes existantes, ayant des incidences significatives sur les présents états financiers, n'ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (ci-après l'IASB).

5. Estimations comptables et jugements critiques

Lorsqu'il prépare les états financiers, le gestionnaire des Portefeuilles FDP pose un certain nombre de jugements, d'estimations et d'hypothèses quant à la comptabilisation et à l'évaluation des actifs, des passifs, des produits et des charges.

Jugements importants

Les paragraphes qui suivent traitent des jugements importants que doit poser la direction dans le cadre de l'application des méthodes comptables des Portefeuilles FDP, qui ont l'incidence la plus significative sur les états financiers.

Monnaie fonctionnelle

Le gestionnaire considère que la monnaie fonctionnelle dans laquelle les Portefeuilles FDP exercent leurs activités est le dollar canadien, car c'est la monnaie qui, à leur avis, représente le plus fidèlement les effets économiques des opérations, des événements et des conditions des Portefeuilles FDP. En outre, le dollar canadien est la monnaie dans laquelle les Portefeuilles FDP évaluent leur rendement. Les Portefeuilles FDP émettent et rachètent leurs parts en dollar canadien.

Classement des parts

Selon IAS 32 – *Instruments financiers : présentation*, les parts doivent être classées en tant que passif dans l'état de la situation financière des Portefeuilles FDP, à moins que toutes les conditions du classement à titre de capitaux propres ne soient réunies. Les parts de tous les Portefeuilles FDP sont présentées dans les passifs puisque les conditions décrites dans IAS 32 pour être classé en capitaux propres ne sont pas respectées. En effet, en plus de l'obligation contractuelle pour l'émetteur de racheter ou de rembourser les parts contre de la trésorerie ou un autre actif financier, les caractéristiques liées aux parts incluent une obligation contractuelle de remettre de la trésorerie ou un autre actif financier.

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Entité d'investissement

Il a été déterminé que les Portefeuilles FDP répondent à la définition d'une entité d'investissement conformément à l'IFRS 10 – *États financiers consolidés* et, par conséquent, les placements dans les entités structurées sont évalués à la JVRN. Une entité d'investissement est une entité qui : obtient des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs, à charge pour elle de leur fournir des services de gestion d'investissement ; déclare à ses investisseurs qu'elle a pour objet d'investir dans des fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-values en capital et/ou de Revenus d'investissement ; évalue et apprécie la performance de la quasi-totalité de ses investissements sur la base de la juste valeur. Le jugement le plus important ayant permis de déterminer que les Portefeuilles FDP répondent à la définition présentée ci-dessus est celui selon lequel la juste valeur est utilisée comme principal critère d'évaluation pour apprécier la performance de la quasi-totalité des investissements des Portefeuilles FDP.

Incertitude relative aux estimations

L'information sur les estimations et les hypothèses qui ont la plus grande incidence sur la comptabilisation et l'évaluation des actifs, des passifs, des produits et des charges est présentée ci-après.

Évaluation de la juste valeur des dérivés et des titres non cotés sur un marché actif

Les Portefeuilles FDP détiennent des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, notamment des dérivés. La juste valeur de ces instruments est déterminée au moyen de techniques d'évaluation et peut être établie en ayant recours à des sources réputées en matière d'évaluation des prix ou des indications de prix fournies par des teneurs de marché. Les cours obtenus par l'intermédiaire de ces sources peuvent constituer des indications, et ne pas être contraignants et exécutoires. En l'absence de données de marché, les Portefeuilles FDP évaluent leurs positions au moyen de leurs propres modèles, qui reposent généralement sur des méthodes et techniques d'évaluation généralement reconnues comme la norme dans le secteur d'activité. Les modèles utilisés pour déterminer la juste valeur sont validés et sont examinés périodiquement par du personnel expérimenté du gestionnaire, indépendant de la partie qui les a créés.

Dans la mesure du possible, les modèles font appel à des données observables. Néanmoins, le gestionnaire doit établir des estimations à l'égard de facteurs comme le risque de crédit (incluant le risque de crédit de la contrepartie), les volatilités et les corrélations. Les changements d'hypothèses touchant ces facteurs pourraient avoir une incidence sur les justes valeurs présentées pour les instruments financiers. Les Portefeuilles FDP considèrent comme des données observables les données de marché qui sont faciles à obtenir, diffusées et mises à jour périodiquement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes qui sont des intervenants actifs sur le marché en question. Voir la note 7 pour de plus amples renseignements sur l'évaluation de la juste valeur des instruments financiers des Portefeuilles FDP.

6. Risques associés aux instruments financiers

Facteurs de risques

En raison de leurs activités, les Portefeuilles FDP sont exposés à divers risques associés aux instruments financiers tels que définis dans le prospectus, à savoir le risque de crédit, le risque de liquidité, le risque de marché (y compris le risque de prix, le risque de change et le risque de taux d'intérêt) et le risque de concentration. La gestion globale des risques des Portefeuilles FDP vise à maximiser les rendements obtenus pour le niveau de risque auquel les Portefeuilles FDP sont exposés et à réduire au minimum les effets défavorables potentiels sur la performance financière. Tous les placements comportent un risque de perte en capital.

Risque de crédit

Le risque de crédit s'entend du risque qu'une perte puisse survenir si l'émetteur d'un titre ou une contrepartie à un instrument financier ne réussit pas à s'acquitter de ses obligations financières. Le risque de crédit des Portefeuilles FDP se concentre principalement dans les titres de créance et des contrats à terme. La juste valeur d'un instrument financier tient compte de la solvabilité et de la cote de crédit de son émetteur. Les Portefeuilles FDP investissent dans des actifs financiers dont la cote a été établie par des agences de notation reconnues. L'exposition au risque de crédit des autres actifs est limitée à leur valeur comptable. Un tableau contenant la répartition des titres selon leur cote de crédit figure au relevé des placements pour chaque Portefeuille FDP dont l'exposition au risque de crédit est significative. Conformément à la politique de placement de chacun des Portefeuilles FDP, le risque lié au crédit est surveillé régulièrement par les gestionnaires.

Toutes les transactions sont réglées ou payées à la livraison par l'entremise de courtiers approuvés. Le risque de défaillance est jugé minime, puisque la livraison des titres vendus est effectuée seulement lorsque le courtier a reçu le paiement. Le paiement sur achat est effectué une fois les titres reçus par le courtier. La transaction échouera si une des parties ne respecte pas ses obligations.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité s'entend du risque que les Portefeuilles FDP éprouvent des difficultés à honorer leurs engagements liés à des passifs financiers.

Les Portefeuilles FDP sont exposés aux rachats quotidiens de titres en espèces. Ils investissent donc la majorité de leurs actifs dans des placements liquides qui sont négociés sur un marché actif et dont ils peuvent se départir rapidement. Conformément aux règlements sur les valeurs mobilières, au moins 90 % des actifs des Portefeuilles FDP doivent être composés de placements liquides.

Les Portefeuilles FDP peuvent investir dans des dérivés, des titres de créance et des titres de capitaux propres non cotés qui ne sont pas négociés sur un marché actif. En conséquence, ils pourraient ne pas être en mesure de liquider rapidement leurs placements à des montants se rapprochant de la juste valeur, ou de réagir à des événements spécifiques, comme une détérioration de la solvabilité d'un émetteur en particulier. Conformément à la politique des Portefeuilles FDP, le gestionnaire surveille la position de liquidité quotidiennement.

Les porteurs de parts peuvent procéder au rachat de leurs parts par les Portefeuilles FDP chaque jour d'évaluation et les Portefeuilles FDP sont évalués quotidiennement. Puisque les Portefeuilles FDP investissent principalement dans des marchés liquides, ils peuvent disposer de leurs éléments d'actif dans des courts délais. Les parts rachetables sont rachetables à vue, au gré du porteur. Les échéances pour les autres passifs financiers demeurent en deçà de trois mois pour l'ensemble des Portefeuilles FDP.

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Risque de marché

Le risque de marché s'entend du risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctue en raison des variations des prix du marché. Un tableau quantifiant le risque de marché figure dans le relevé des placements pour chaque Portefeuille FDP dont l'exposition au risque de marché est significative. De plus, vous trouverez dans le relevé des placements pour chaque Portefeuille FDP une analyse de sensibilité qui montre l'effet qu'auraient eu sur l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables des changements raisonnablement possibles de la variable de risque pertinente à chaque date de clôture. Les résultats réels pourraient être différents, et les écarts pourraient être importants.

a) Risque de change

Le risque de change s'entend du risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctue en raison des variations des cours de monnaies étrangères par rapport au dollar canadien, soit la monnaie fonctionnelle des Portefeuilles FDP. Les Portefeuilles FDP sont principalement exposés au risque de change en raison des placements qu'ils détiennent. Les Portefeuilles FDP sont exposés indirectement au risque de change via la détention d'unités de fonds communs.

b) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt s'entend du risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des taux d'intérêt du marché. Les Portefeuilles FDP sont principalement exposés au risque de taux d'intérêt par leurs placements dans des titres de créance tels que les obligations, les instruments de marché monétaire et les débentures. Les Portefeuilles FDP détiennent des titres assortis de taux d'intérêt fixes qui les exposent au risque de taux d'intérêt sur la juste valeur. Selon les politiques des Portefeuilles FDP, le gestionnaire est tenu de gérer ce risque en calculant et en surveillant la duration effective moyenne du portefeuille contenant ces titres. Les Portefeuilles FDP détiennent également un montant limité de trésorerie exposé à des taux d'intérêt variables qui les exposent au risque de taux d'intérêt sur les flux de trésorerie. La sensibilité des Portefeuilles FDP aux taux d'intérêt a été évaluée selon la duration pondérée du portefeuille. Les Portefeuilles FDP sont exposés indirectement au risque de taux d'intérêt en raison des unités de fonds communs qu'ils détiennent.

c) Risque de prix

Le risque de prix s'entend du risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des prix du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change). Les placements des Portefeuilles FDP sont exposés au risque de fluctuation des prix des titres de capitaux propres et des parts de fonds de placements.

d) Risque de concentration

Le risque de concentration résulte des titres ayant des caractéristiques similaires, par exemple l'emplacement géographique ou le secteur d'activité, qui peuvent être affectés de façon similaire par des changements dans la situation économique ou d'autres conditions de marché.

Gestion du risque lié aux capitaux

Le capital des Portefeuilles FDP est représenté par les actifs nets attribuables aux porteurs de parts rachetables. Le montant d'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables peut changer de manière significative sur une base quotidienne, puisque les Portefeuilles FDP font l'objet de souscriptions et de rachats quotidiens à la discrétion des porteurs de parts rachetables. L'objectif des Portefeuilles FDP pour la gestion du capital est de préserver la capacité des Portefeuilles FDP à poursuivre leur exploitation afin de fournir un rendement aux porteurs de parts rachetables, offrir des bénéfices aux autres parties prenantes et de maintenir une base de capital solide pour soutenir le développement des activités de placement des Portefeuilles FDP.

Afin de maintenir la structure du capital, la politique des Portefeuilles FDP consiste à effectuer les opérations suivantes :

- Surveiller le niveau des souscriptions et des rachats hebdomadaires relativement aux actifs qu'elle s'attend à être en mesure de liquider dans les sept jours et ajuster le montant des distributions des Portefeuilles FDP versés aux porteurs de parts rachetables.
- Racheter et émettre de nouvelles parts rachetables, conformément aux documents constitutifs des Portefeuilles FDP, qui comprennent la possibilité de restreindre les rachats et exiger des niveaux minimaux de participations et d'achats. Le gestionnaire utilise une méthode fondamentale rigoureuse pour choisir et gérer les Placements, qui consiste en un processus de recherche intensif et continu d'occasions de placement dans une large gamme d'instruments de divers types d'émetteurs (Gouvernements, sociétés et établissements financiers). Le Gestionnaire détermine également le moment où les titres en portefeuille des Portefeuilles FDP doivent être échangés contre ceux d'autres émetteurs ou contre ceux avant d'autres échéances en vue d'améliorer le rendement du portefeuille des Portefeuilles FDP et/ou de limiter le risque.

Le conseil d'administration et le gestionnaire gèrent le capital sur la base de la valeur de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables.

7. Évaluation de la juste valeur

Les Portefeuilles FDP présentent leurs placements et actifs et passifs dérivés à la juste valeur selon une hiérarchie à trois niveaux qui reflète l'importance des données utilisées pour réaliser les évaluations à la juste valeur. La hiérarchie de ces instruments se compose des trois niveaux suivants :

- Niveau 1 : les données d'entrée de niveau 1 s'entendent des cours (non ajustés) auxquels l'entité peut avoir accès à la date d'évaluation, sur des marchés actifs, pour des actifs ou des passifs identiques.
- Niveau 2 : les données d'entrée de niveau 2 sont des données concernant l'actif ou le passif, autres que les cours du marché inclus dans les données d'entrée de niveau 1, qui sont observables directement ou indirectement.
- Niveau 3 : les données d'entrée de niveau 3 sont des données non observables concernant l'actif ou le passif.

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Si des données d'entrée de niveaux différents sont utilisées pour évaluer la juste valeur d'un actif ou d'un passif, l'évaluation est classée au niveau le plus bas des données significatives pour l'évaluation de la juste valeur. Un changement dans la méthode d'évaluation de la juste valeur peut résulter en un transfert entre les niveaux. L'information sur cette classification est présentée dans le relevé des placements de chacun des Portefeuilles FDP.

a) Titres de capitaux propres et fonds négociés en bourse

Les positions en titres de capitaux propres et en fonds négociés en bourse des Portefeuilles FDP sont classées au niveau 1 lorsque les titres sont négociés activement et qu'un prix fiable est observable. Si certains titres ne sont pas négociés fréquemment et qu'aucun prix observable n'est disponible et que la valeur est déterminée au moyen de données de marché observables, alors ces titres sont classés au niveau 2. Dans les cas où il n'y aurait pas de données de marché observables, ils sont classés au niveau 3.

b) Fonds de placements

Les parts des fonds de placements détenues sont établies au moyen de la valeur liquidative quotidienne déterminée par le fiduciaire et sont classées au niveau 1.

c) Obligations, placements à court terme et instruments dérivés

Les obligations comprennent principalement des obligations du secteur public et de sociétés qui sont évaluées selon des modèles fondés sur des données d'entrée comme la courbe des taux d'intérêt, les écarts de crédit et les volatilités. Comme les données d'entrée significatives aux fins d'évaluation sont généralement observables, les obligations, les placements à court terme et les instruments dérivés des Portefeuilles FDP ont été classés au niveau 2.

8. Opérations avec des parties liées

Les activités de placement et l'administration sont gérées par le gestionnaire.

Les placements de certains Portefeuilles FDP contiennent des parts émises par d'autres Portefeuilles FDP. Les achats et ventes issus de ces transactions sont effectués dans le cours normal des activités, soit à la valeur liquidative du Portefeuille FDP à la date de transaction.

Les Portefeuilles FDP versent des frais de gestion au gestionnaire pour les services de gestion de placements et d'administration. Les frais de gestion sont calculés quotidiennement sur l'actif net, après déduction de la valeur des placements des Portefeuilles FDP, selon les taux annuels suivants :

| | Taux annuel | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
|--|-------------|----------------|----------------|
| | % | En milliers \$ | En milliers \$ |
| Portefeuilles FDP (série A) | | | |
| Portefeuille FDP Équilibré | 0,95 | 456 | 399 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | 1,00 | 689 | 455 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | 0,95 | 31 | 53 |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 0,85 | 1 631 | 1 622 |
| Portefeuille FDP Gestion des liquidités | 0,30 | 189 | 142 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 1,25 | 439 | 404 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 1,10 | 1 773 | 1 441 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 1,10 | 459 | 413 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 1,25 | 1 463 | 1 208 |
| Portefeuille FDP Actions américaines | 0,80 | 196 | 155 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 1,25 | 94 | 73 |
| Portefeuilles FDP (série I) | | | |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 0,05 | 4 | 4 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 0,20 | 163 | 165 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 0,15 | 193 | 107 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 0,15 | 154 | 114 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 0,20 | 917 | 506 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 0,10 | 74 | 49 |

Positions détenues par les filiales de Financière des professionnels inc. au 30 juin 2021 :

| | Nombre de parts détenues | Nombre total des parts des Portefeuilles | % de l'actif net |
|---|--------------------------|--|------------------|
| Portefeuilles FDP | | | |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 42 909 | 26 607 000 | 0,16 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 7 164 | 11 619 000 | 0,06 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 41 538 | 52 315 000 | 0,08 |

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

Positions détenues par les filiales de Financière des professionnels inc. au 31 décembre 2020 :

| Portefeuilles FDP | Nombre de parts détenues | Nombre total des parts des Portefeuilles | % de l'actif net |
|---|--------------------------|--|------------------|
| Portefeuille FDP Actions globales | 83 279 | 49 068 000 | 0,17 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 73 652 | 26 139 000 | 0,28 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 7 141 | 9 427 000 | 0,08 |

L'exposition à des investissements dans des fonds sous-jacents à la juste valeur est présentée dans les tableaux suivants :

Au 30 juin 2021

| Portefeuilles FDP | Nom du fonds commun de placement sous-jacent | Actif net du fonds commun de placement sous-jacent (en milliers \$) | Participation dans le fonds commun de placement sous-jacent (en milliers \$) | Participation dans le fonds commun de placement sous-jacent % |
|---------------------------------------|---|---|--|---|
| Portefeuille FDP Équilibré | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 349 126 | 170 502 | 48,84 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 176 190 | 25 471 | 14,46 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 562 327 | 207 953 | 36,98 |
| | Portefeuille FDP Actions pays émergents | 153 797 | 5 904 | 3,84 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 1 093 426 | 49 915 | 4,57 |
| | Portefeuille FDP Actions américaines | 45 577 | 3 278 | 7,19 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 349 126 | 21 889 | 6,27 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 176 190 | 7 247 | 4,11 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 562 327 | 41 245 | 7,33 |
| | Portefeuille FDP Actions pays émergents | 153 797 | 2 268 | 1,47 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 1 093 426 | 56 414 | 5,16 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 349 126 | 86 732 | 24,84 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 176 190 | 25 862 | 14,68 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes dividendes | 271 668 | 40 880 | 15,05 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 1 093 426 | 37 692 | 3,45 |
| Portefeuille FDP Actions globales | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 562 327 | 5 310 | 0,94 |

Au 31 décembre 2020

| Portefeuilles FDP | Nom du fonds commun de placement sous-jacent | Actif net du fonds commun de placement sous-jacent (en milliers \$) | Participation dans le fonds commun de placement sous-jacent (en milliers \$) | Participation dans le fonds commun de placement sous-jacent % |
|---------------------------------------|---|---|--|---|
| Portefeuille FDP Équilibré | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 365 650 | 176 133 | 48,17 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 216 468 | 25 016 | 11,56 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 486 687 | 181 811 | 37,36 |
| | Portefeuille FDP Actions pays émergents | 119 510 | 5 650 | 4,73 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 952 400 | 46 233 | 4,85 |
| | Portefeuille FDP Actions américaines | 40 679 | 2 951 | 7,25 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 365 650 | 22 612 | 6,18 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 216 468 | 7 118 | 3,29 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 486 687 | 36 060 | 7,41 |
| | Portefeuille FDP Actions pays émergents | 119 510 | 2 170 | 1,82 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 952 400 | 52 253 | 5,49 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 365 650 | 89 596 | 24,50 |
| | Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 216 468 | 25 400 | 11,73 |
| | Portefeuille FDP Actions canadiennes dividendes | 255 205 | 35 495 | 13,91 |
| | Portefeuille FDP Actions globales | 952 400 | 36 756 | 3,86 |
| Portefeuille FDP Actions globales | Portefeuille FDP Actions canadiennes | 486 687 | 4 643 | 0,95 |

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

9. Commissions de courtage et paiements indirects

Le montant total des commissions versées sur les parts de série A à des courtiers, présenté comme coûts de transaction dans les états du résultat global, durant les périodes terminées les 30 juin 2021 et 2020, se lit comme suit :

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Portefeuilles FDP | | |
| Portefeuille FDP Équilibré | 35 387 | 3 150 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | 33 407 | 17 543 |
| Portefeuille FDP Équilibré revenu | — | 360 |
| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | 30 953 | 16 769 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 17 958 | 24 476 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | 520 688 | 412 328 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 163 915 | 341 839 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 239 861 | 368 951 |
| Portefeuille FDP Actions américaines | 3 191 | 335 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 35 018 | 43 040 |

Les montants des paiements indirects affectés à des biens ou services relatifs aux Portefeuilles FDP durant la période sont les suivants :

| | 30 juin 2021 \$ | 30 juin 2020 \$ |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Portefeuilles FDP | | |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 11 160 | — |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes | — | 16 130 |
| Portefeuille FDP Actions canadiennes dividende | 9 000 | 21 000 |
| Portefeuille FDP Actions globales | 21 402 | — |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 930 | 3 000 |

10. Nombre de parts rachetables en circulation

Chaque Portefeuille FDP peut émettre un nombre illimité de parts rachetables sans valeur nominale. Les parts rachetables sont émises et rachetables à la valeur liquidative aux fins des opérations, au gré des participants.

| Portefeuille FDP Équilibré | | série A |
|--|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 28 222 888 | 28 054 505 |
| Parts émises | 2 331 163 | 2 089 807 |
| Parts rachetées | (2 204 241) | (1 982 799) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 28 349 810 | 28 161 513 |
| Portefeuille FDP Équilibré croissance | | série A |
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 11 964 231 | 10 808 704 |
| Parts émises | 2 740 062 | 1 751 395 |
| Parts rachetées | (995 357) | (1 149 282) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 13 708 936 | 11 410 817 |

| Portefeuille FDP Équilibré revenu | | série A |
|--|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 15 397 443 | 15 676 540 |
| Parts émises | 1 811 902 | 1 581 845 |
| Parts rachetées | (1 816 765) | (1 705 393) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 15 392 580 | 15 552 992 |

| Portefeuille FDP Obligations canadiennes | | série A | série I | |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 27 458 559 | 26 785 852 | 1 545 068 | 1 350 167 |
| Parts émises | 576 728 | 619 186 | 20 144 | 86 306 |
| Parts rachetées | (584 861) | (498 952) | (180 523) | (68 475) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 27 450 426 | 26 906 086 | 1 384 689 | 1 367 998 |

| Portefeuille FDP Gestion des liquidités | | série A |
|---|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 12 730 896 | 7 671 528 |
| Parts émises | 6 497 364 | 9 709 609 |
| Parts rachetées | (8 962 674) | (6 787 943) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 10 265 586 | 10 593 194 |

| Portefeuille FDP | | série A | | série I | |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| Revenu fixe mondial | | | | | |
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | |
| Nombre de parts au début de la période | 6 524 086 | 6 357 368 | 15 498 441 | 15 069 727 | |
| Parts émises | 169 957 | 125 172 | 1 621 801 | 1 356 431 | |
| Parts rachetées | (41 824) | (58 264) | (5 782 259) | (1 028 652) | |
| Nombre de parts à la fin de la période | 6 652 219 | 6 424 276 | 11 337 983 | 15 397 506 | |

| Portefeuille FDP | | série A | | série I | |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| Actions canadiennes | | | | | |
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | |
| Nombre de parts au début de la période | 8 923 607 | 8 536 489 | 17 215 294 | 15 419 384 | |
| Parts émises | 216 097 | 379 621 | 1 745 094 | 2 221 282 | |
| Parts rachetées | (116 275) | (77 240) | (1 376 281) | (1 005 572) | |
| Nombre de parts à la fin de la période | 9 023 429 | 8 838 870 | 17 584 107 | 16 635 094 | |

| Portefeuille FDP | | | | | |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| Actions canadiennes dividende | | série A | | série I | |
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | |
| Nombre de parts au début de la période | 7 362 242 | 7 639 906 | 18 132 483 | 22 754 231 | |
| Parts émises | 283 025 | 281 604 | 1 933 678 | 2 105 829 | |
| Parts rachetées | (452 385) | (488 760) | (3 463 907) | (6 165 560) | |
| Nombre de parts à la fin de la période | 7 192 882 | 7 432 750 | 16 602 254 | 18 694 500 | |

Notes afférentes aux états financiers semestriels (non audités) (suite)

Semestres terminés les 30 juin 2021 et 2020

| Portefeuille FDP Actions globales | série A | | série I | |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 8 610 820 | 8 261 710 | 40 457 287 | 21 591 604 |
| Parts émises | 489 426 | 274 769 | 7 202 164 | 11 805 291 |
| Parts rachetées | (489 769) | (217 827) | (3 954 838) | (1 958 131) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 8 610 477 | 8 318 652 | 43 704 613 | 31 438 764 |

| Portefeuille FDP Actions américaines | série A | | série I | |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | | | 2 296 285 | 2 256 624 |
| Parts émises | | | 214 577 | 206 470 |
| Parts rachetées | | | (194 953) | (168 598) |
| Nombre de parts à la fin de la période | | | 2 315 909 | 2 294 496 |

| Portefeuille FDP Actions pays émergents | série A | | série I | |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 | 30 juin 2021 | 30 juin 2020 |
| Nombre de parts au début de la période | 747 275 | 779 224 | 8 680 277 | 8 947 352 |
| Parts émises | 74 479 | 19 321 | 2 892 356 | 768 684 |
| Parts rachetées | (26 966) | (46 853) | (749 085) | (1 322 566) |
| Nombre de parts à la fin de la période | 794 788 | 751 692 | 10 823 548 | 8 393 470 |

11. Imposition des portefeuilles et distributions

Les Portefeuilles FDP sont définis à titre de fiducies de fonds communs de placement aux termes des dispositions contenues dans la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et la *Loi sur les impôts* (Québec), collectivement « l'impôt sur le revenu ». Chaque année, les Portefeuilles FDP versent aux porteurs de parts un revenu imposable net et des gains en capital nets suffisants pour permettre aux Portefeuilles FDP de ne pas être assujettis à l'impôt sur le revenu. Ces distributions sont imposables entre les mains des porteurs. Les pertes peuvent être reportées indéfiniment et portées en diminution des gains en capital futurs. L'année d'imposition des Portefeuilles FDP se termine le 15 décembre.

Comme déterminé aux déclarations fiscales de 2020, les soldes des pertes en capital pouvant être reportées en réduction des gains en capital des exercices futurs sont les suivants :

| Portefeuilles FDP | \$ |
|---|------------|
| Portefeuille FDP Gestion des liquidités | 1 081 747 |
| Portefeuille FDP Revenu fixe mondial | 13 010 957 |
| Portefeuille FDP Actions pays émergents | 194 018 |

12 . Modification à la présentation de l'information comparative - États du résultat global

Au 30 juin 2021, les Portefeuilles FDP ont modifié rétrospectivement la présentation des distributions des revenus des fonds sous-jacents. Les distributions des revenus des fonds sous-jacents sont maintenant présentés sur une ligne distincte au résultat global alors qu'antérieurement, ils étaient présentés soit comme des revenus d'intérêts, des revenus de dividendes ou des gains nets (pertes nettes) réalisé(e)s sur la vente de placements selon la nature des placements détenus par les fonds sous-jacents.

Montréal

Siège social
514 350-5050
1 888 377-7337

Brossard

Général
450 678-9818
1 888 377-7337

Chicoutimi

418 704-8175
1 800 720-4244

Gatineau

T 819 893-8791
1 888 377-7737

Laval

Général
450 910-1702
1 888 377-7337

Montréal - ACDQ

514 282-1425
1 800 361-3794

Québec

Général
418 658-4244
1 800 720-4244

Rimouski

Général
581 562-2007
1 800 720-4244

Sherbrooke

Général
819 564-0909
1 866 564-0909

Trois-Rivières

Général
819 601-2400
1 800 720-4244

Actionnaires**Partenaires**