COMPTE-RENDU TRIMESTRIEL :

FNB environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) de BMO – Septembre 2024

Investir, mobiliser, améliorer

BMO | Gestion mondiale d'actifs

Avant-propos

Exclusions de l'indice MSCI ESG LEADERS et règles de construction du portefeuille

Critères	Échelle/Élément	Facteur décisif
Univers de la sélection	MSCI Global IMI	
Cote ESG supérieure à BB	AAA à CCC	Les sociétés notées B ou CCC ne peuvent être incluses (on ne sait pas ce qui se passerait si on l'exigeait pour la capitalisation boursière)
Cote de controverse supérieure à 3	De 0 à 10	Vert / jaune / orange / rouge (rouge = moins de 3)
Critères de classement	Cote ESG	
	Tendance ESG (12 mois)	Si deux sociétés ont une cote identique, l'indice favorisera la société présentant une meilleure tendance ESG
	Participants existants à l'indice privilégiés	Si deux sociétés ont la même cote ESG et la même tendance ESG, le participant à l'indice choisi est privilégié
		Si la cote ESG et la tendance ESG sont identiques pour les participants de l'indice choisi, la société ayant la capitalisation boursière la plus élevée sera privilégiée
		Des sociétés marginales seront incluses s'il est nécessaire de satisfaire à l'exigence de capitalisation de 50 %
Exclusions	Alcool	Producteur gagnant 50 % des revenus ou plus de 1 G$ de revenus (LVMH)
	Jeux de hasard	Producteur gagnant 50 % des revenus ou plus de 1 G$ de revenus
	Tabac	Producteur gagnant 50 % des revenus ou plus de 1 G$ de revenus
	Énergie nucléaire	Sociétés ayant une capacité de plus de 6 000 mégawatts ou plus de 50 % de sources nucléaires/sociétés participant à l'enrichissement du combustible nucléaire/sociétés participant à l'extraction d'uranium/ sociétés participant à la conception ou à la construction d'une centrale nucléaire
	Armement conventionnel	Sociétés gagnant 50 % des revenus ou plus de 3 G$ de revenus
	Armement nucléaire	Toutes les entreprises fabriquant des systèmes ou des composants
	Armement controversé	Toutes les sociétés participant à la fabrication de mines terrestres, de bombes à dispersion, d'armes à l'uranium, d'armes à laser aveuglantes et d'armes biologiques ou chimiques
	Armes à feu destinées aux civils	Sociétés gagnant 50 % des revenus ou plus de 100 M$ de revenus
	Énergie non traditionnelle	Charbon thermique, pétrole de schiste, gaz de schiste, sables bitumineux, méthane de houille et gaz de charbon
	Énergie conventionnelle	Arctique (terrestre ou en mer), en eau profonde, en eau peu profonde ou terrestre/en mer

Table des matières

Indice MSCI World ESG Leaders 4

Indice MSCI Canada ESG Leaders 5

Indice MSCI USA ESG Leaders Index 6

Indice MSCI EAFE ESG Leaders 7

Indice MSCI China ESG Leaders 8

Indice MSCI India ESG Leaders 9

Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris 10

Indice S&P Global Clean Energy[3] 11

Indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI 12

Indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI 13

Indice Bloomberg MSCI US High Yield Liquid Corporate Sustainability SRI 14

FINB BMO MSCI Global ESG Leaders (ESGG*) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 15

FINB BMO MSCI USA ESG Leaders (ESGY) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 16

FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 16

FINB BMO MSCI China ESG Leaders (ZCH) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 16

FINB BMO MSCI India ESG Leaders (ZID) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 16

FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris (ZGRN) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 17

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines (ESGF) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 17

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement (ESGH) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024 17

Rapport sur la participation active – BMO Gestion mondiale d'actifs – Troisième trimestre 2024 18

Engagements et objectifs de développement durable (ODD) 19

Annexe 20

Harmonisation avec les objectifs de développement durable des Nations Unies 21

Indice MSCI World ESG Leaders

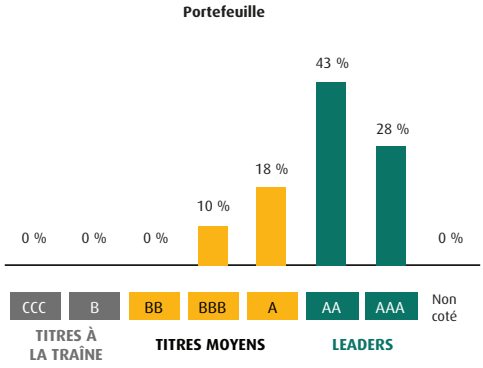
Portefeuille
MSCI World ESG Leaders **AA**

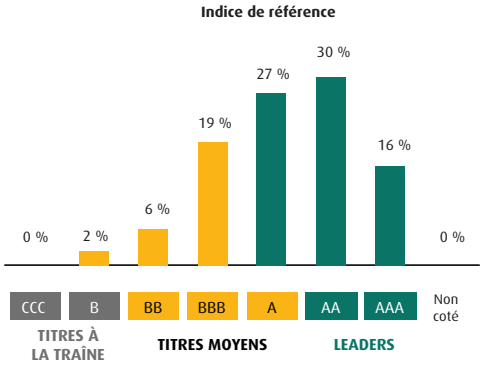
Indice de référence
MSCI Monde **A**

FICHE DE QUALITÉ ESG

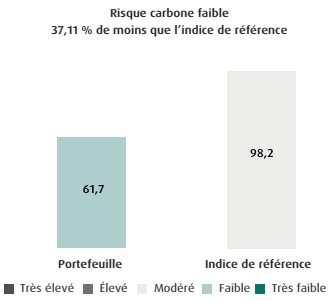
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,9**	**6,9**	**13,9 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	6,5	6,1	**6,5 %**
NOTE SOCIALE	5,6	5,1	**10,4 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	5,9	5,7	**3,2 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG

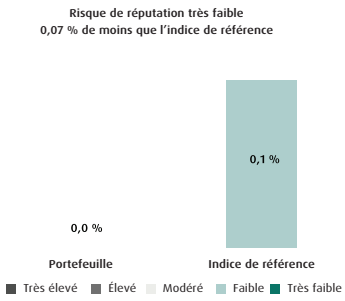




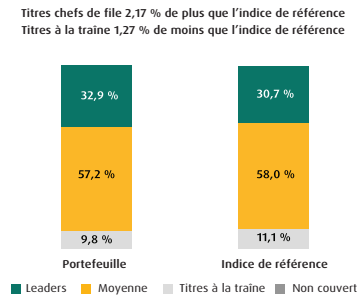
Risque carbone
(t de CO_2e/M$ de ventes)



Risque de réputation
(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance
(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI World ESG Leaders ($ CA)	1,00	1,30	8,39	11,93
Indice MSCI Monde ($ CA)	1,00	0,00	2,31	11,96

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI World ESG Leaders ($ CA)	34,15	10,17	13,50	12,20
Indice MSCI Monde ($ CA)	34,23	10,63	13,35	12,14

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

FINB BMO MSCI Global ESG Leaders
ESGG
Frais de gestion : 0,25 %
Cote de risque* **:** Moyenne

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI Global ESG Leaders (symbole : ESGG), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI World ESG Leaders. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,25 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

Indice MSCI Canada ESG Leaders

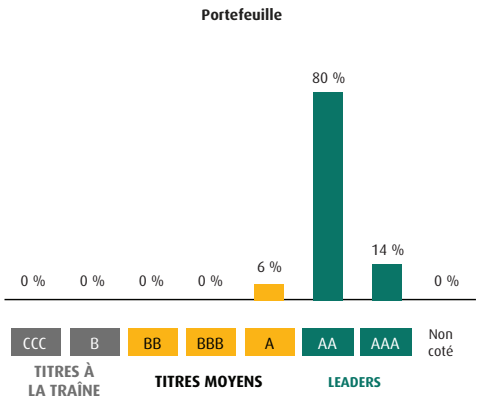
Portefeuille
MSCI Canada ESG Leaders **AA**

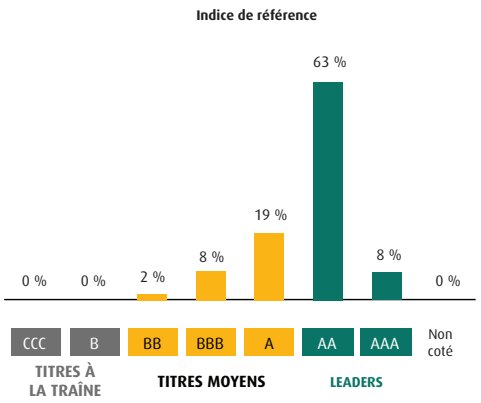
Indice de référence
MSCI Canada **AA**

FICHE DE QUALITÉ ESG

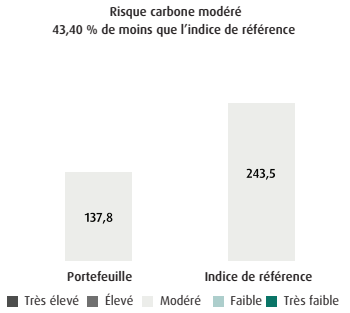
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**8,2**	**7,5**	**9,6 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	5,8	5,5	**6,3 %**
NOTE SOCIALE	5,3	5,0	**4,7 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	7,1	6,8	**4,7 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG

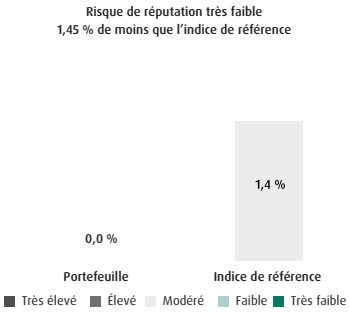




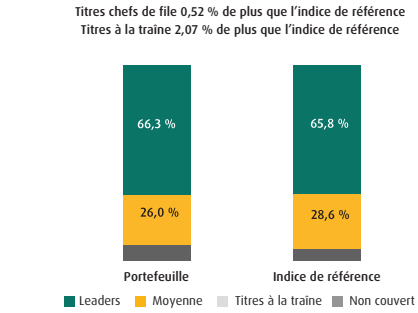
Risque carbone
(t de CO_2e/M$ de ventes)



Risque de réputation
(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance
(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI Canada ESG Leaders ($ CA)	1,01	3,07	8,71	13,46
Indice MSCI Canada ($ CA)	1,00	0,00	1,83	12,68

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI Canada ESG Leaders ($ CA)	30,53	3,31	8,64	7,54
Indice MSCI Canada ($ CA)	31,73	7,83	10,61	7,62

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders (symbole : ESGA), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI Canada ESG Leaders. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,15 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders
ESGA
Frais de gestion : 0,15 %
Cote de risque* : Moyenne

Réservé aux investisseurs institutionnels

Indice MSCI USA ESG Leaders Index

Portefeuille
MSCI USA ESG Leaders

AA

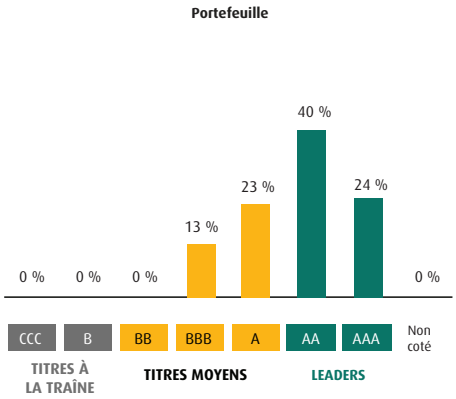
Indice de référence
MSCI États-Unis

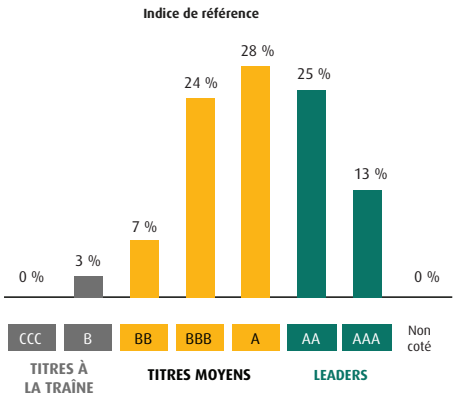
A

FICHE DE QUALITÉ ESG

	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,7**	**6,7**	**15,1 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	6,6	6,1	**6,7 %**
NOTE SOCIALE	5,6	5,0	**11,0 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	5,6	5,5	**2,4 %**

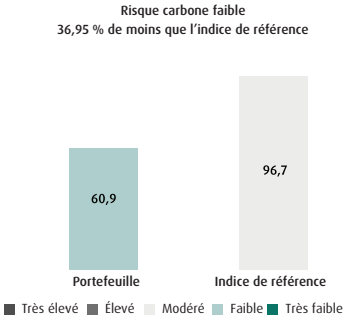
RÉPARTITION DES NOTES ESG





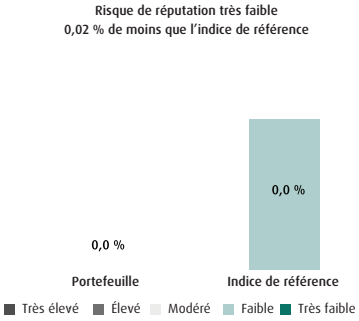
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



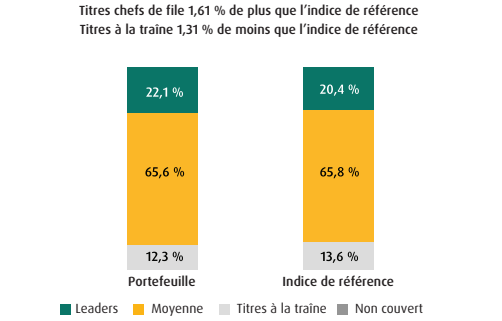
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI USA ESG Leaders ($ CA)	0,98	1,89	7,35	12,59
Indice MSCI États-Unis ($ CA)	1,00	0,00	1,97	12,74

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI USA ESG Leaders ($ CA)	38,51	12,15	16,51	14,68
Indice MSCI États-Unis ($ CA)	38,38	12,17	16,09	14,76

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI USA ESG Leaders (symbole : ESGY), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI USA ESG Leaders. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,20 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO MSCI USA ESG Leaders
ESGY* **ESGY.F**
couvert en $ CA
Frais de gestion : 0,20 %
Cote de risque* : Moyenne

Indice MSCI EAFE ESG Leaders

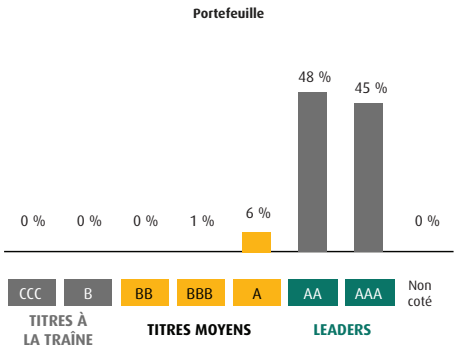
Portefeuille
MSCI EAFE ESG Leaders **AAA**

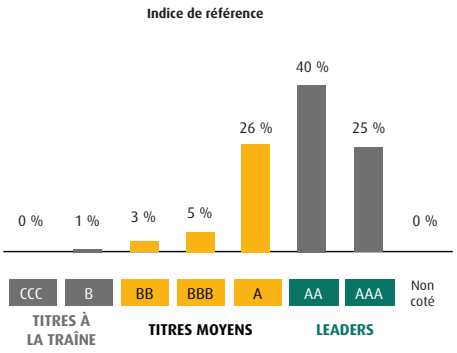
Indice de référence
MSCI EAEO **AA**

FICHE DE QUALITÉ ESG

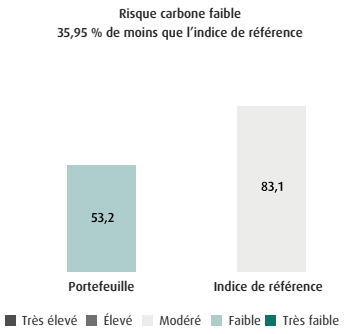
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**8,6**	**7,7**	**11,6 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	6,6	6,2	**6,0 %**
NOTE SOCIALE	5,7	5,2	**9,4 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	6,9	6,5	**6,0 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG

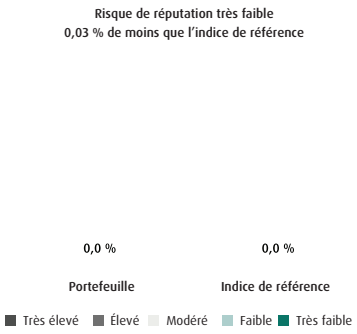




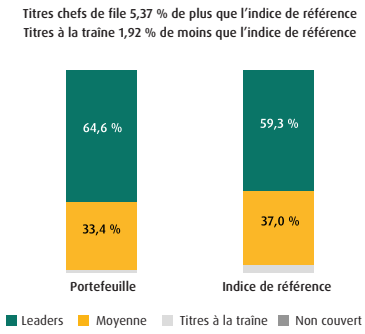
Risque carbone
(t de CO_2e/M$ de ventes)



Risque de réputation
(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance
(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI EAFE ESG Leaders ($ CA)	1,00	1,48	11,54	12,38
Indice MSCI EAEO ($ CA)	1,00	0,00	3,43	12,17

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI EAFE ESG Leaders ($ CA)	22,63	5,65	7,22	7,71
Indice MSCI EAEO ($ CA)	23,47	6,80	7,50	7,53

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (symbole : ESGE), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI EAFE ESG Leaders. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,25 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders
ESGE
Frais de gestion : 0,25 %
Cote de risque* : Moyenne

Indice MSCI China ESG Leaders

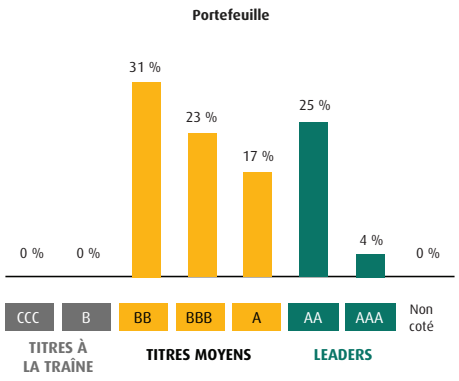
Portefeuille
MSCI China ESG Leaders **A**

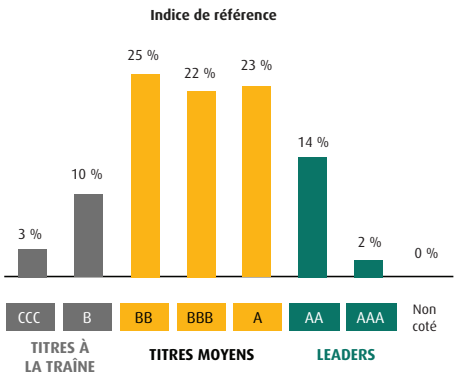
Indice de référence
MSCI Chine **BBB**

FICHE DE QUALITÉ ESG

	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**5,9**	**5,2**	**15,1 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	6,4	5,7	**13,4 %**
NOTE SOCIALE	4,8	4,7	**3,6 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	4,4	4,3	**2,0 %**

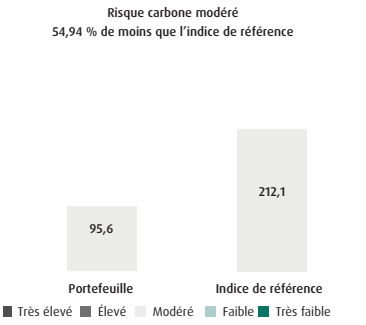
RÉPARTITION DES NOTES ESG





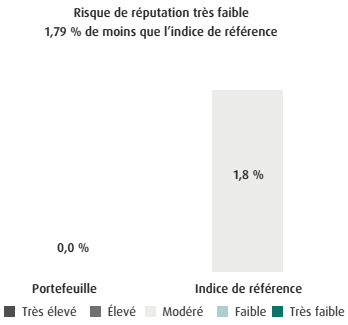
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



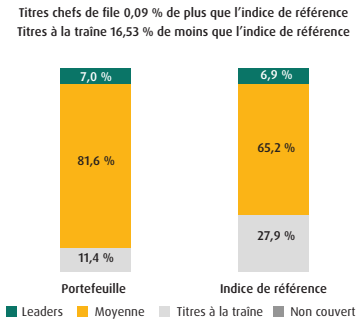
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI China ESG Leaders ($ CA)	0,98	6,99	9,47	25,04
Indice MSCI Chine ($ CA)	1,00	0,00	4,90	22,78

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI China ESG Leaders ($ CA)	18,38	-8,88	-0,76	5,85
Indice MSCI Chine ($ CA)	22,25	-4,76	0,00	4,54

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI China ESG Leaders (symbole : ZCH), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI China ESG Leaders. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,60 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO MSCI China ESG Leaders
ZCH
Frais de gestion : 0,60 %
Cote de risque* : Élevée

Indice MSCI India ESG Leaders

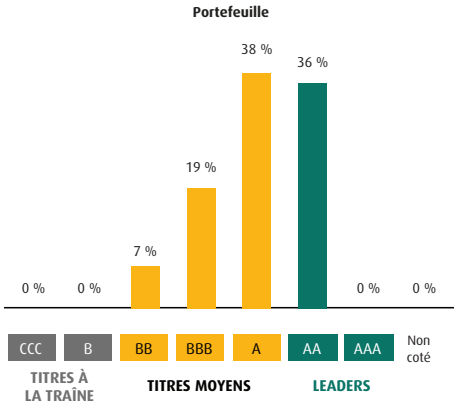
Portefeuille
MSCI India ESG Leaders **A**

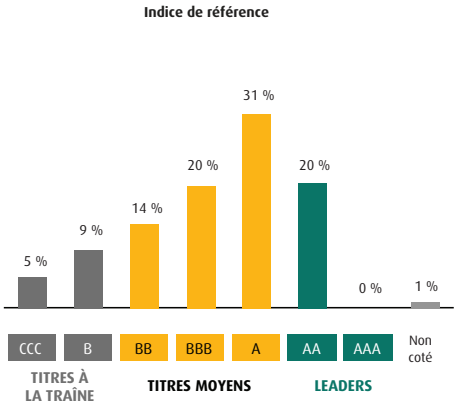
Indice de référence
Indice MSCI Inde **BBB**

FICHE DE QUALITÉ ESG

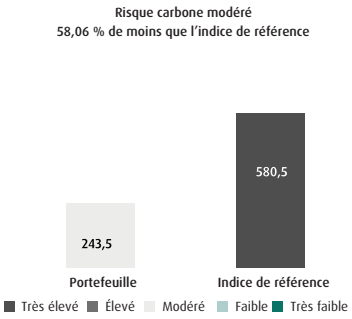
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**6,6**	**5,4**	**21,4 %**
NOTE ENVIRON-NEMENTALE	5,6	5,1	**10,6 %**
NOTE SOCIALE	5,1	4,7	**8,6 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	5,4	4,8	**12,5 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG

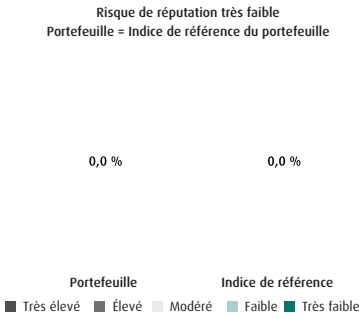




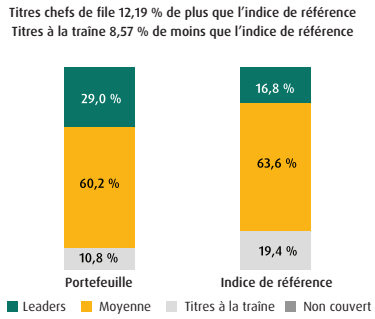
Risque carbone
(t de CO_2e/M$ de ventes)



Risque de réputation
(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance
(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI India ESG Leaders ($ CA)	0,90	5,86	26,90	18,33
Indice MSCI Inde ($ CA)	1,00	0,00	12,14	18,48

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI India ESG Leaders ($ CA)	30,75	10,32	13,58	11,94
Indice MSCI Inde ($ CA)	33,23	13,11	14,85	10,93

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI India ESG Leaders (symbole : ZID), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice MSCI India ESG Leaders Index. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,60 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

FINB BMO MSCI India ESG Leaders
ZID
Frais de gestion : 0,60 %
Cote de risque* :
Moyenne à élevée

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris

Portefeuille
Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris

A

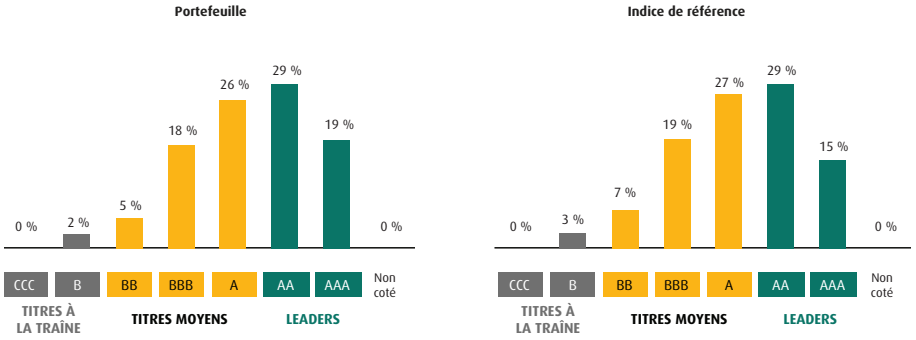
Indice de référence
MSCI Monde tous pays

A

FICHE DE QUALITÉ ESG

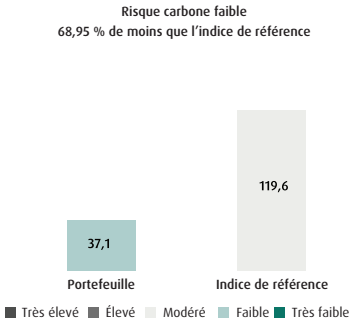
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,0**	**6,8**	**3,1 %**
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,5	6,1	**7,3 %**
NOTE SOCIALE	5,1	5,1	**1,5 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	5,7	5,7	**1,1 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG



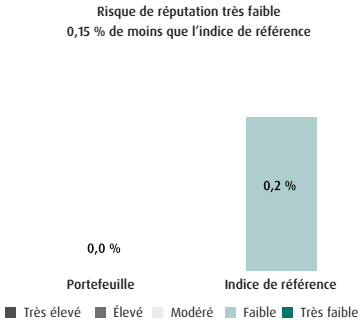
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



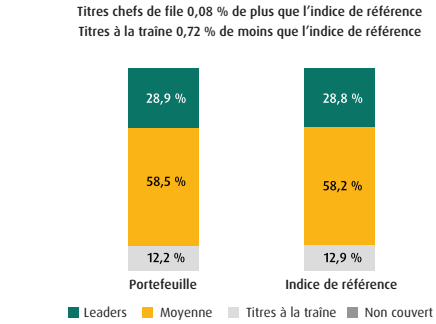
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (%, 10 ans)
Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris ($ CA)	1,01	1,28	10,56	15,01
MSCI Monde tous pays	1,00	0,00	2,48	14,81

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris ($ CA)	34,86	4,43	11,03	9,69
MSCI Monde tous pays	32,79	5,51	11,08	9,06

Au 31 octobre 2024. Les rendements indiciels ne tiennent pas compte des frais d'opération ni de la déduction d'autres frais et charges. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. Le rendement passé n'est pas indicatif des rendements futurs.

Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris (symbole : ZGRN) géré par BMO Gestion mondiale d'actifs cherche à reproduire l'indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,25 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris
ZGRN
Frais de gestion : 0,25 %
Cote de risque* : Moyenne

Indice S&P Global Clean Energy[3]

Portefeuille
Indice S&P Global Clean Energy

AA

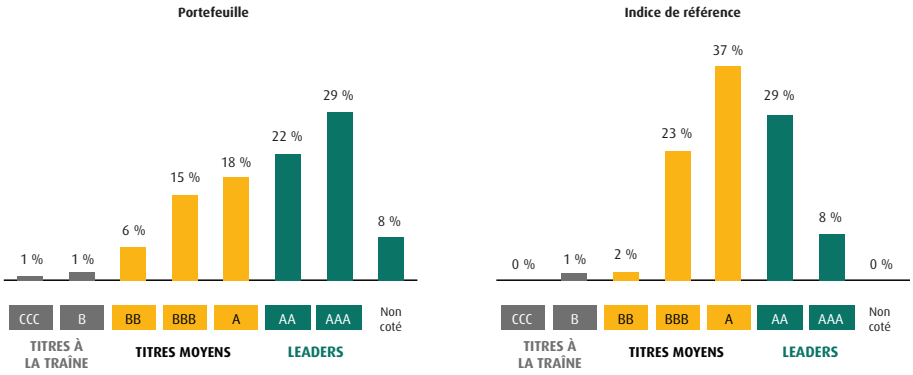
Indice de référence
Indice S&P Global 1200 Energy

A

FICHE DE QUALITÉ ESG

	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,2**	**6,4**	**12,3 %**
NOTE ENVIRONNEMENTALE	7,5	5,2	**45,4 %**
NOTE SOCIALE	5,6	5,9	**-5,9 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	5,9	6,0	**-2,1 %**

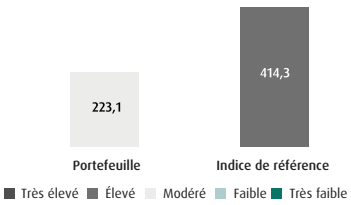
RÉPARTITION DES NOTES ESG



Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)

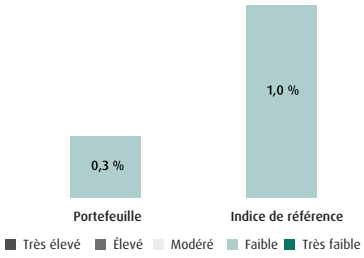
Risque carbone modéré
46,14 % de moins que l'indice de référence



Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)

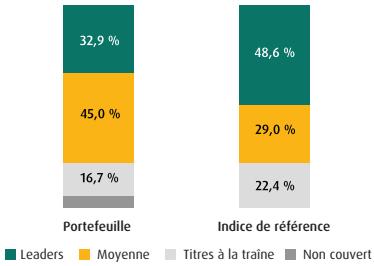
Risque de réputation très faible
0,64 % de moins que l'indice de référence



Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 15,74 % de plus que l'indice de référence
Titres à la traîne 5,70 % de moins que l'indice de référence



Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO actions du secteur énergie propre (Symbole : ZCLN), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, est offert moyennant des frais de gestion de 0,35 %, et cherche à reproduire l'indice S&P Global Clean Energy.

[3] Les mesures de risque et les données sur le rendement ne sont pas fournies, car l'indice sous-jacent suivi par le ZCLN ne fait pas partie de la gamme de MSCI.

[4] Veuillez noter que le ZCLN utilise un indice S&PDJ, de sorte que MSCI ne peut pas analyser les données de cette inscription pour se conformer à nos conventions relatives à la présentation de l'information.

Des analyses supplémentaires sont disponibles sur demande***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO actions du secteur énergie propre
ZCLN[4]
Frais de gestion : 0,35 %
Cote de risque* : Élevée

Indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI

Portefeuille
Indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI

AA

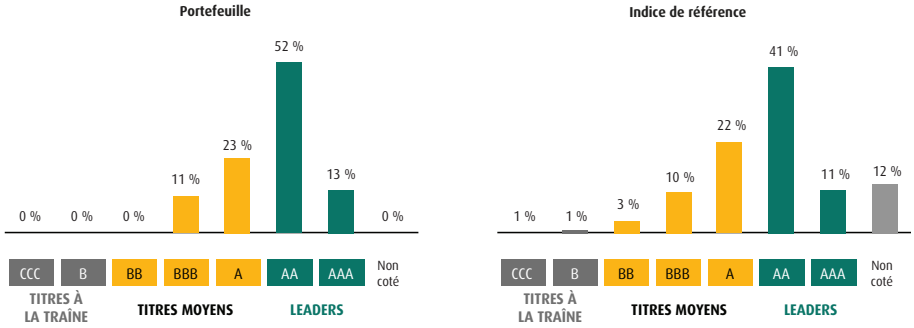
Indice de référence
Indice Bloomberg Canada Corporate

AA

FICHE DE QUALITÉ ESG

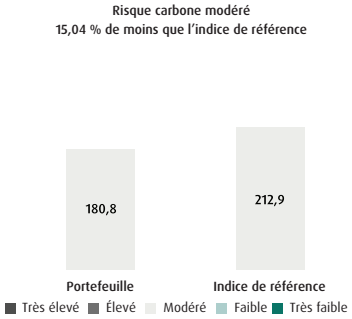
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,6**	**7,3**	**4,3 %**
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,9	6,6	**4,0 %**
NOTE SOCIALE	5,0	4,9	**1,8 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	6,7	6,5	**2,7 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG



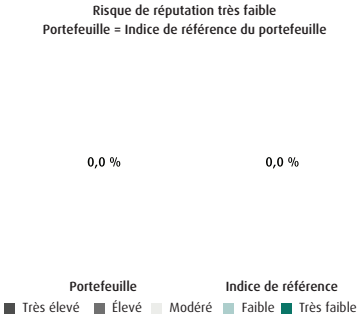
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



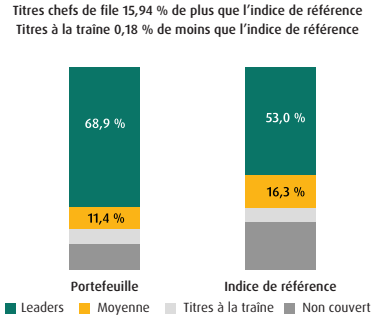
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO ESG obligations de sociétés (symbole : ESGB), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,15 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO ESG obligations de sociétés
ESGB
Durée : 5,6
Frais de gestion : 0,15 %
Cote de risque* : Faible

Indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI

Portefeuille
Indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI

A

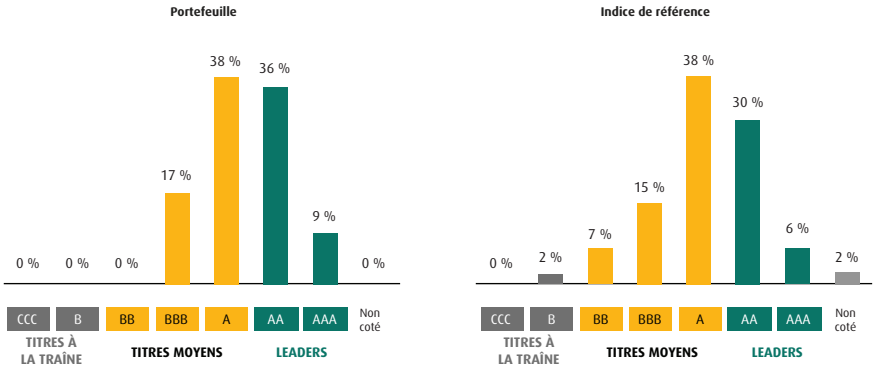
Indice de référence
Indice Bloomberg US Corporate

A

FICHE DE QUALITÉ ESG

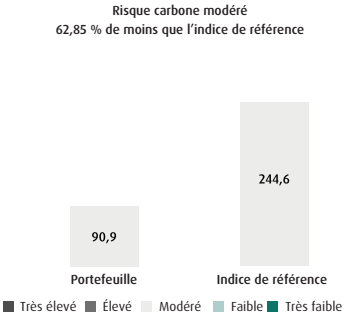
	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**7,1**	**6,6**	**7,2 %**
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,3	6,1	**3,3 %**
NOTE SOCIALE	5,1	4,8	**5,2 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	6,0	5,8	**2,8 %**

RÉPARTITION DES NOTES ESG



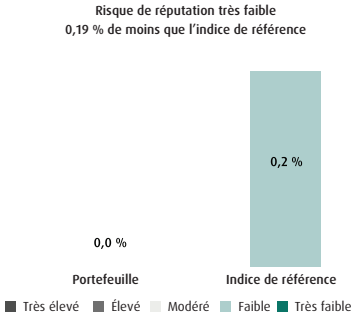
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



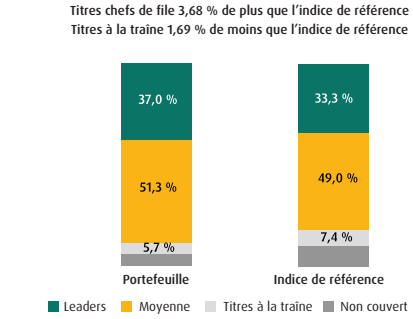
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines couvertes en dollars canadiens (symbole : ESGF), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,20 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. *** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines
ESGF
couvert en $ CA
Durée : 7,3
Frais de gestion : 0,20 %
Cote de risque* :
Faible à moyenne

Indice Bloomberg MSCI US High Yield Liquid Corporate Sustainability SRI

Portefeuille
Indice Bloomberg MSCI US High Yield Sustainability SRI

A

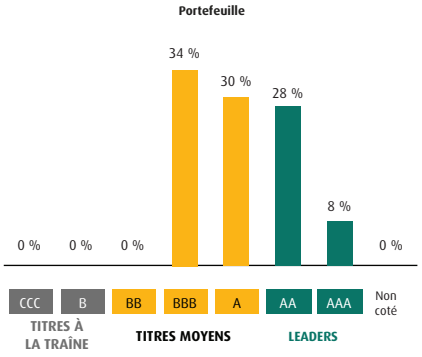
Indice de référence
Indice Bloomberg US High Yield

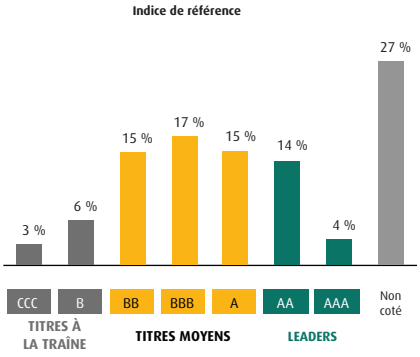
BBB

FICHE DE QUALITÉ ESG

	Porte-feuille	Indice de référence	Actif
NOTE DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)	**6,6**	**5,4**	**23,5 %**
NOTE ENVIRONNEMENTALE	5,2	4,7	**9,7 %**
NOTE SOCIALE	5,2	4,7	**10,9 %**
NOTE DE GOUVERNANCE	6,0	5,6	**7,8 %**

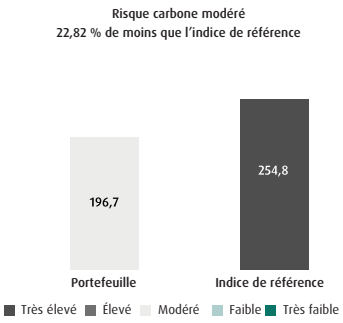
RÉPARTITION DES NOTES ESG





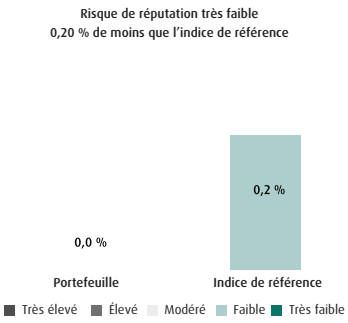
Risque carbone

(t de CO_2e/M$ de ventes)



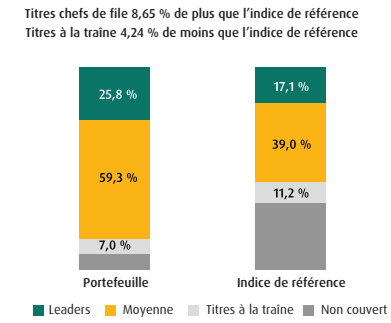
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)



Risque de gouvernance

(Centile mondial)



Investissez dans le progrès.

Le FINB BMO obligations de sociétés américaines à haut rendement (symbole : ESGH), géré par BMO Gestion mondiale d'actifs, cherche à reproduire l'indice Bloomberg MSCI US High Yield Liquid Corporate Sustainability SRI. Il est offert moyennant des frais de gestion de 0,45 %, procure une exposition au rendement des titres auxquels MSCI a attribué des cotes ESG plus élevées que celles de sociétés comparables et cible 50 % de la capitalisation boursière dans chaque secteur***.

Source : MSCI inc., au 31 octobre 2024. ESGH : La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

*** Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement

ESGH (non couvert) **ESGH.F** (couvert en dollars $ CA)

Durée : 3,1
Frais de gestion : 0,45 %
Cote de risque* : Faible à moyenne

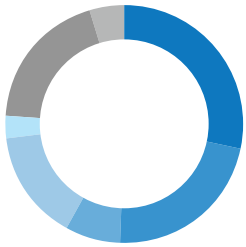
FINB BMO MSCI Global ESG Leaders (ESGG*) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints***	Pays couverts
35	32	6	11

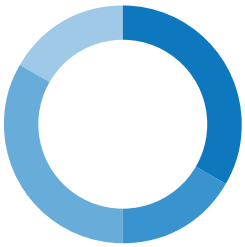
Sociétés mobilisées par région

Sociétés mobilisées par enjeu**



Changements climatiques	19
Gérance environnementale	15
Droits de la personne	5
Normes du travail	10
Santé publique	2
Gouvernance d'entreprise	13
Conduite des affaires	3

Jalons atteints par enjeu



Changements climatiques	2
Gérance environnementale	1
Normes du travail	2
Conduite des affaires	1

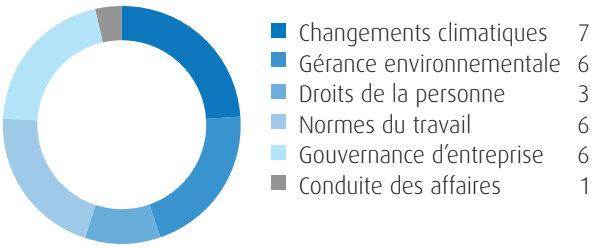
* ESGG est composé d'ESGA, d'ESGY et d'ESGE.
** Les sociétés peuvent avoir été mobilisées pour plus d'un enjeu; comprend les activités de mobilisation effectuées pour le compte des FNB BMO sous-jacents.
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 30 septembre 2024.
*** Un jalon est pris en compte lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

FINB BMO MSCI USA ESG Leaders (ESGY) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

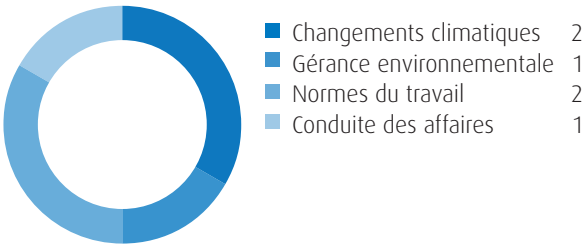
Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
15	14	6	2

Sociétés mobilisées par enjeu*



Jalons atteints par enjeu



FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
20	18	0	9

FINB BMO MSCI China ESG Leaders (ZCH) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
14	12	3	1

FINB BMO MSCI India ESG Leaders (ZID) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
7	5	0	1

* Les sociétés peuvent avoir été mobilisées pour plus d'un enjeu; comprend les activités de mobilisation effectuées pour le compte des FNB BMO sous-jacents.
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 30 septembre 2024.
** Un jalon est pris en compte lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris (ZGRN) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
34	30	8	10

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines (ESGF) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
18	16	2	3

FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement (ESGH) – Rapport sur la mobilisation – Troisième trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
1	1	1	1

* Les sociétés peuvent avoir été mobilisées pour plus d'un enjeu; comprend les activités de mobilisation effectuées pour le compte des FNB BMO sous-jacents.
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 30 septembre 2024.
** Un jalon est pris en compte lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

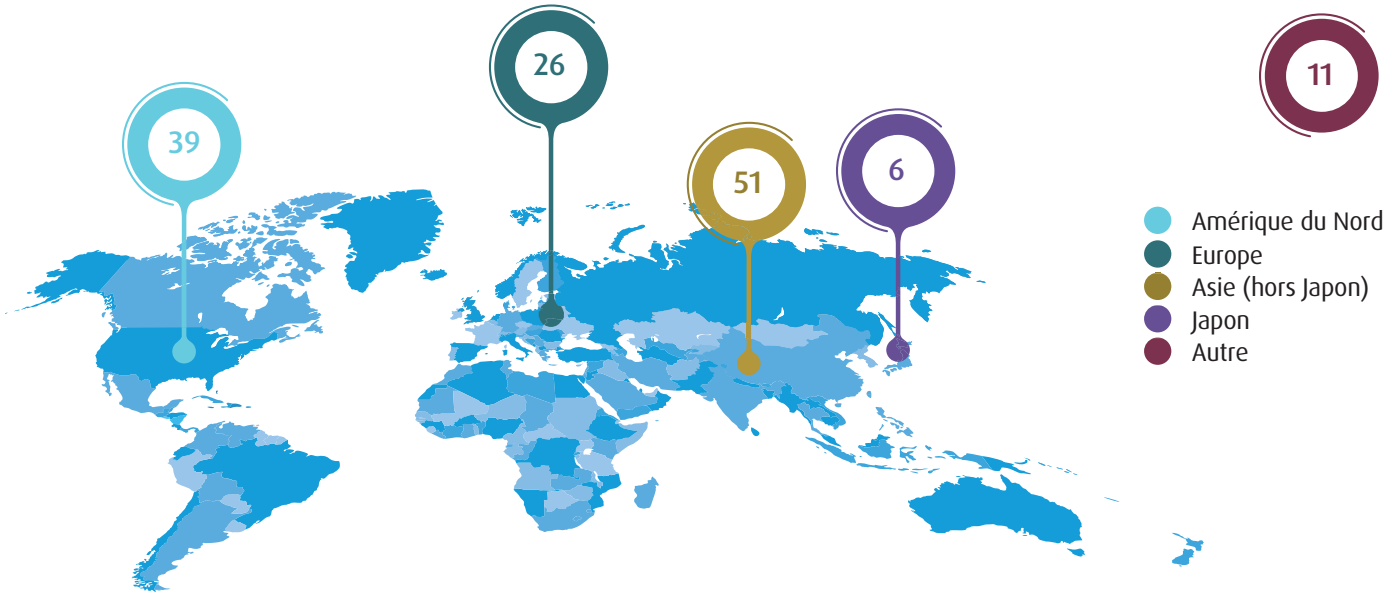
Symbole	Fonds	Assemblées au cours desquelles nous avons voté	Éléments ayant fait l'objet d'un vote	Votes contre la direction (pourcentage)
ESGA	FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders	3	53	9 %
ESGY	FINB BMO MSCI USA ESG Leaders	17	224	6 %
ESGE	FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders	26	343	11 %
ZCH-T	FINB BMO MSCI China ESG Leaders	74	339	20 %
ZGRN	FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris	34	417	14 %
ZCLN	FINB BMO actions du secteur énergie propre	38	189	13 %
ESGG	FINB BMO MSCI Global ESG Leaders	46	620	9 %

Rapport sur la participation active – BMO Gestion mondiale d'actifs – Troisième trimestre 2024

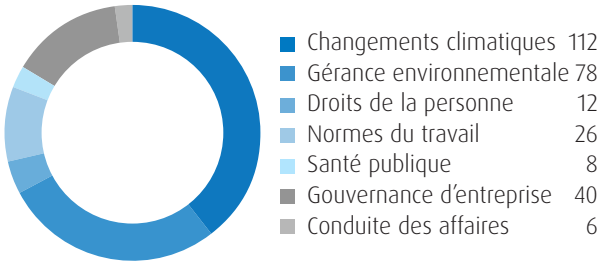
Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
150	133	16	30

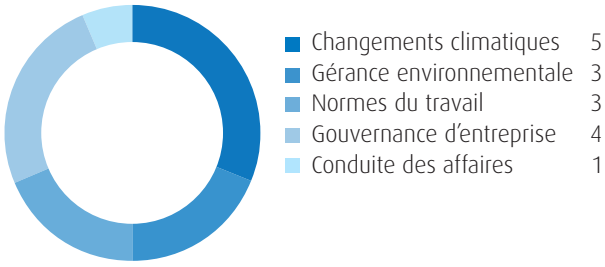
Sociétés mobilisées par région



Sociétés mobilisées par enjeu*



Jalons atteints par enjeu



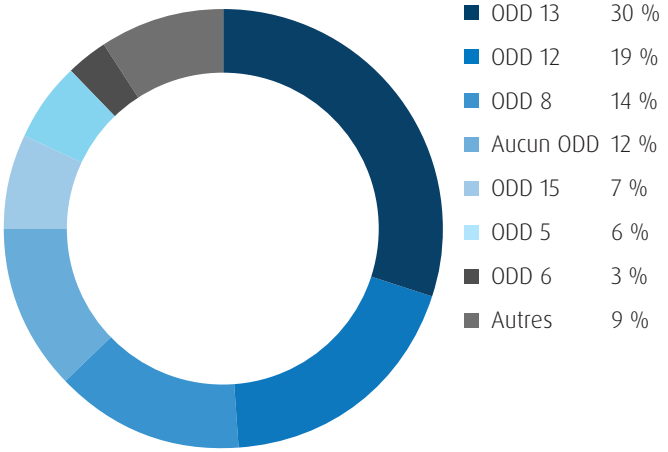
* Les sociétés peuvent avoir été mobilisées pour plus d'un enjeu.
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 30 septembre 2024.
** Un jalon est pris en compte lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

Engagements et objectifs de développement durable (ODD)

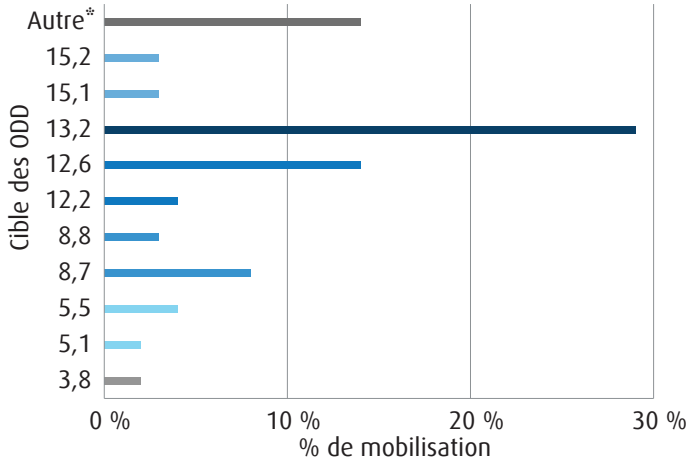
Visant à tracer un parcours vers un monde plus durable, les 17 objectifs de développement durable (ODD) ont été développés par l'ONU et des parties prenantes de différents secteurs d'activité.

Nous utilisons les cibles sous-jacentes détaillées associées à chaque ODD pour définir les objectifs d'entreprise pertinents, s'il y a lieu, et formuler les effets positifs de l'engagement sur le plan social et environnemental. Des cibles sont systématiquement fixées pour les initiatives de mobilisation afin d'assurer une plus grande exactitude et d'avoir une incidence plus importante.

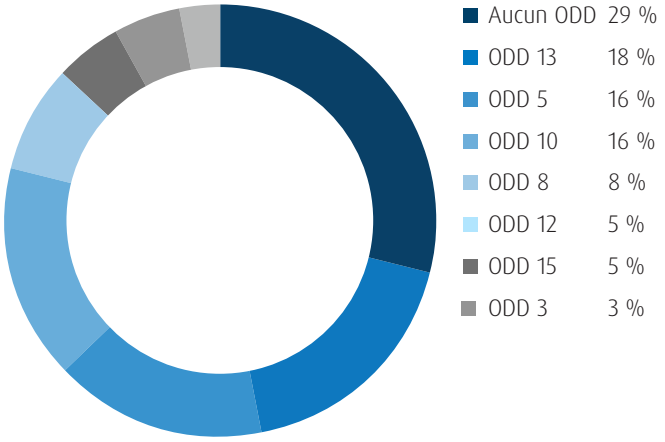
Engagement : Niveau de l'ODD



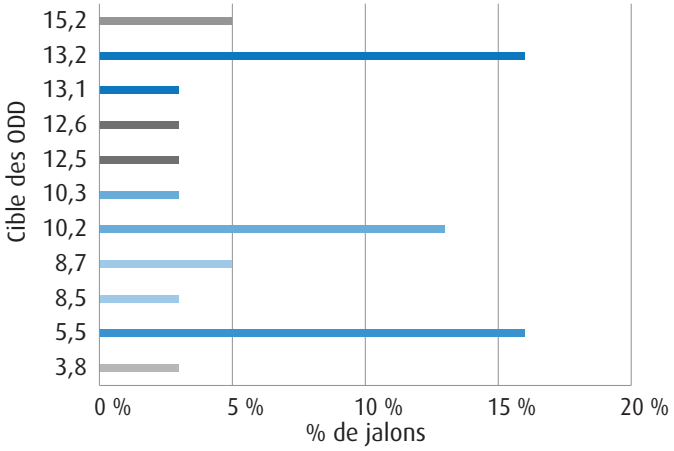
Engagement : Niveau cible de l'ODD



Jalon : Niveau de l'ODD



Jalon : Niveau cible de l'ODD



* L'élément « Autres » représente les cibles des ODD qui correspondent à moins de 2 % de l'objectif de l'ODD pertinent.
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 30 juin 2024.
On considère qu'un jalon est atteint lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

Annexe

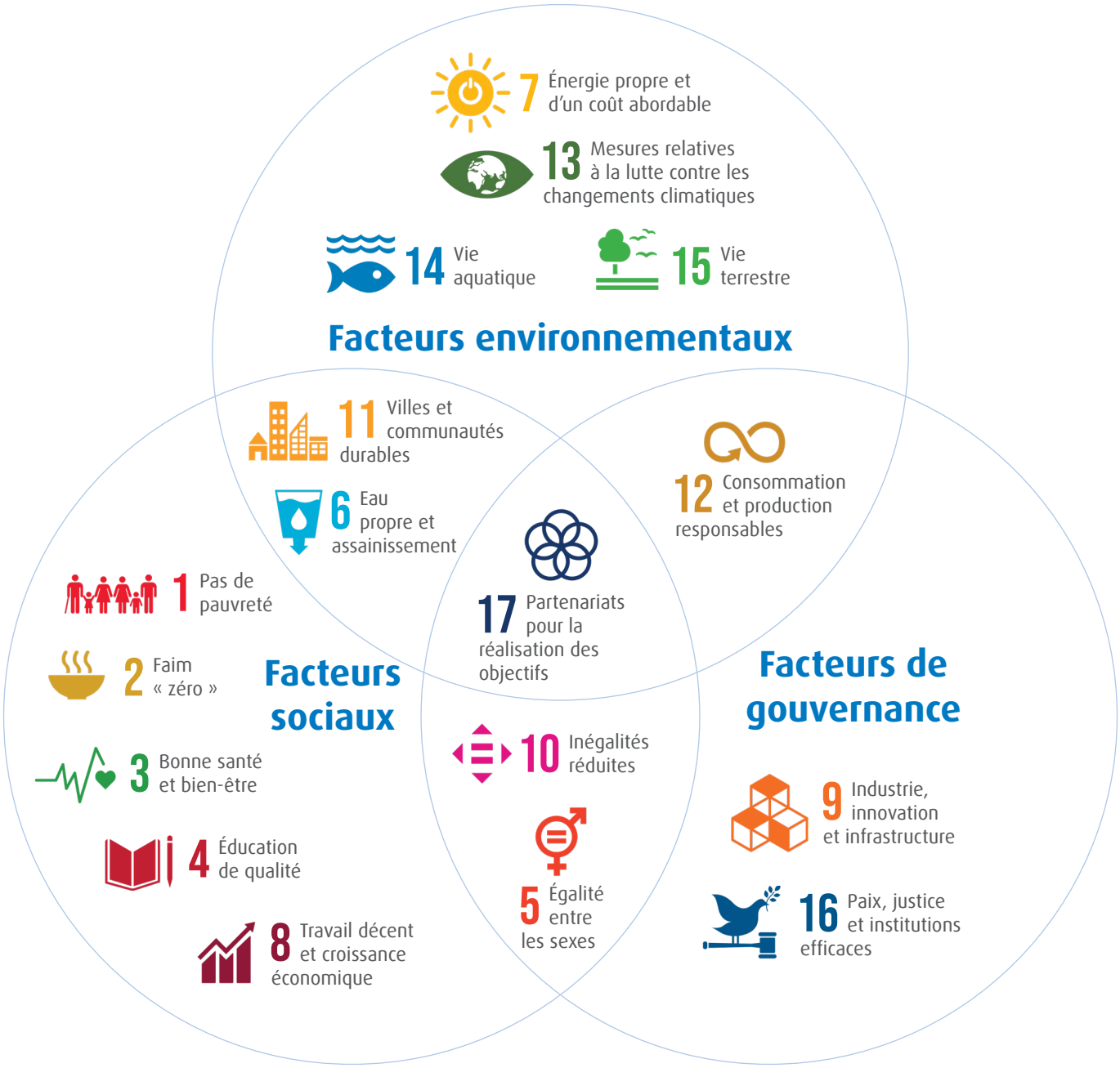
ODD	Cible	Résumé de la cible
ODD1	1.1	Éliminer la pauvreté et assurer un salaire de subsistance à tous
ODD2	2.2	Mettre fin à toutes les formes de malnutrition, en particulier chez les enfants et les femmes
ODD3	3.3	Éradiquer le sida, la tuberculose, le paludisme, les maladies transmises par l'eau et autres maladies transmissibles
ODD3	3.5	Renforcer la prévention et le traitement de l'abus de substances psychoactives
ODD3	3.8	Assurer l'accès à des médicaments et à des soins de santé
ODD5	5.1	Mettre fin à toutes les formes de discrimination à l'égard des femmes et des filles
ODD5	5.2	Éliminer toutes les formes de violence à l'égard des femmes
ODD5	5.5	Assurer aux femmes un accès égal aux possibilités d'emploi, y compris aux postes de direction
ODD6	6.1	Assurer l'accès universel à l'eau potable, à un coût abordable
ODD6	6.3	Améliorer la qualité de l'eau en réduisant la pollution
ODD6	6.4	Accroître l'efficacité de l'utilisation des ressources en eau afin de remédier à la pénurie d'eau
ODD6	6.5	Mettre en œuvre une gestion des ressources en eau à tous les niveaux
ODD6	6.6	Protéger et restaurer les écosystèmes liés à l'eau
ODD7	7.2	Augmenter substantiellement la part mondiale de l'énergie renouvelable
ODD7	7.3	Multiplier par deux le taux mondial d'amélioration de l'efficacité énergétique
ODD8	8.2	Accroître la productivité grâce à l'innovation
ODD8	8.5	Assurer le plein emploi et un travail productif pour tous
ODD8	8.7	Éradiquer le travail forcé, l'esclavage moderne et la traite des personnes
ODD8	8.8	Protéger et promouvoir les milieux de travail sûrs pour tous les travailleurs
ODD9	9.4	Moderniser et adapter les industries pour les rendre plus durables
ODD10	10.2	Autonomiser toutes les personnes et favoriser leur intégration
ODD10	10.5	Améliorer la réglementation et la surveillance des marchés financiers
ODD10	10.7	Faciliter la migration en toute sécurité au moyen de politiques gérées
ODD11	11.4	Renforcer les efforts visant à protéger le patrimoine naturel mondial
ODD11	11.5	Réduire les pertes sociales et économiques causées par les catastrophes
ODD11	11.6	Réduire l'impact environnemental négatif des villes
ODD12	12.2	Gérer et utiliser les ressources naturelles de manière durable
ODD12	12.3	Réduire de moitié le volume de déchets alimentaires au niveau de la distribution comme de la consommation
ODD12	12.4	Instaurer une gestion rationnelle des produits chimiques et de tous les déchets tout au long de leur cycle de vie
ODD12	12.5	Réduire la production de déchets par la prévention, la réduction, le recyclage et la réutilisation
ODD12	12.6	Encourager les entreprises à adopter des pratiques viables et à intégrer dans leurs rapports des informations sur la responsabilité environnementale, sociale et de gouvernance
ODD13	13.1	Renforcer la capacité d'adaptation aux événements liés aux changements climatiques
ODD13	13.2	Intégrer les plans de lutte contre les changements climatiques dans les politiques et les stratégies
ODD13	13.a	Aborder l'atténuation des changements climatiques pour les pays en développement

Source : https://sdgs.un.org/fr/goals

Harmonisation avec les objectifs de développement durable des Nations Unies

Établis en 2012, les **ODD des Nations Unies (objectifs de développement durable des Nations Unies)** sont un modèle visant à créer un avenir plus durable d'ici 2030 qui a été adopté par 193 pays de par le monde. Les pays, et non les entreprises, sont signataires des ODD. Toutefois, les renseignements ci-dessous illustrent l'amélioration relative de l'exposition aux placements dans l'indice MSCI World ESG Leaders par rapport à l'indice MSCI Monde. Les investisseurs pourraient souhaiter suivre les progrès de leurs placements en vue de leur harmonisation avec les 17 ODD. MSCI fournit un cadre à cet effet; ci-dessous, vous pouvez voir avec lesquels des 17 ODD l'indice MSCI World ESG Leaders est harmonisé.

La construction de l'indice MSCI ESG Leaders évalue les sociétés en fonction des facteurs ESG et non en fonction de leur alignement sur les ODD. Puisque les pays sont signataires des ODD, les renseignements ci-dessous illustrent les améliorations relatives de l'exposition, qui sont un sous-produit de la construction de l'indice.



Objectifs de développement durable des Nations Unies	Indice MSCI World ESG Leaders	Indice MSCI Monde
1. Pas de pauvreté	✗	✗
2. Faim « zéro »	✓	✗
3. Bonne santé et bien-être	✓	✗
4. Éducation de qualité	✗	✗
5. Égalité entre les sexes	✓	✓
6. Eau propre et assainissement	✓	✗
7. Énergie propre et d'un coût abordable	✗	✗
8. Travail décent et croissance économique	✓	✗
9. Industrie, innovation et infrastructure	✗	✗
10. Inégalités réduites	✓	✗
11. Villes et communautés durables	✓	✗
12. Consommation et production responsables	✗	✗
13. Mesures relatives à la lutte contre les changements climatiques	✗	✗
14. Vie aquatique	✗	✗
15. Vie terrestre	✗	✗
16. Paix, justice et institutions efficaces	✗	✗
17. Partenariats pour la réalisation des objectifs	✗	✗

✓ Indique que l'indice est conforme à l'ODD ✗ Indique que l'indice n'est pas conforme

Source : MSCI ESG Research, au 31 mars 2024.

Pour en savoir plus sur les votes :

« Tableau de bord du vote par procuration »

Le risque lié au carbone mesure l'exposition aux sociétés à fortes émissions de carbone. Il est fondé sur les mesures carbone de MSCI et est calculé comme la moyenne pondérée de l'intensité carbonique des émetteurs du portefeuille.

La mesure des données entre l'indice de référence et l'indice MSCI Leaders est uniforme, mais il peut y avoir des différences entre les périodes auxquelles les données font référence en raison du moment où les entreprises communiquent leurs données sur les émissions au cours de l'année.

Réservé aux investisseurs institutionnels.

La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

Les placements dans des fonds négociés en bourse peuvent comporter des frais de courtage, des frais de gestion et d'autres frais. Veuillez lire l'Aperçu du FNB ou le prospectus des FNB BMO avant d'investir. Les fonds négociés en bourse ne sont pas garantis, leur valeur fluctue fréquemment et leur rendement passé n'est pas indicatif de leur rendement futur.

Pour connaître les risques liés à un placement dans les FNB BMO, veuillez consulter les risques spécifiques énoncés dans le prospectus du FNB BMO. Les FNB BMO s'échangent comme des actions, ils peuvent se négocier à escompte à leur valeur liquidative et leur valeur marchande fluctue, ce qui peut augmenter le risque de perte. Les distributions ne sont pas garanties et sont susceptibles d'être changées ou éliminées.

Les FNB BMO sont gérés par BMO Gestion d'actifs inc., qui est une société gestionnaire de fonds d'investissement et de portefeuille et une entité juridique distincte de la Banque de Montréal.

BMO Gestion mondiale d'actifs est une marque de commerce sous laquelle BMO Gestion d'actifs inc. et BMO Investissements inc. exercent leurs activités. Certains des produits et services offerts sous le nom BMO Gestion mondiale d'actifs sont conçus spécifiquement pour différentes catégories d'investisseurs au Canada et peuvent ne pas être accessibles à tous les investisseurs. Les produits et les services ne sont offerts qu'aux investisseurs au Canada, conformément aux lois et aux règlements applicables.

Tout énoncé qui repose nécessairement sur des événements futurs peut être une déclaration prospective. Les déclarations prospectives ne sont pas des garanties de rendement. Elles comportent des risques, des éléments d'incertitude et des hypothèses. Bien que ces déclarations soient fondées sur des hypothèses considérées comme raisonnables, rien ne garantit que les résultats réels ne seront pas sensiblement différents des résultats attendus. L'investisseur est prié de ne pas se fier indûment aux déclarations prospectives. Concernant les déclarations prospectives, l'investisseur doit examiner attentivement les éléments de risque décrits dans la version la plus récente du prospectus simplifié.

Ce rapport est fourni à titre informatif seulement. L'information qui s'y trouve ne constitue pas une source de conseils fiscaux, juridiques ou de placement et ne doit pas être considérée comme telle. Les placements doivent être évalués en fonction des objectifs de chaque investisseur. Il est préférable, en toute circonstance, d'obtenir l'avis de professionnels.

MSCI ou Bloomberg ne parraine et n'endosse pas les FNB mentionnés dans les présentes, n'en fait pas la promotion et n'assume par ailleurs aucune responsabilité à l'égard de ces FNB ou de tout indice sur lequel se fondent ces FNB. Le prospectus du FNB renferme une description plus détaillée des liens limités que MSCI ou Bloomberg a avec le gestionnaire et les FNB associés.

L'indice est un produit de S&P Dow Jones Indices LLC ou de ses filiales (« SPDJI ») et est utilisé sous licence par le gestionnaire. S&P[MD], S&P 500[MD], US 500, The 500, iBoxx[MD], iTraxx[MD] et CDX[MD] sont des marques de commerce de S&P Global, Inc. ou de ses sociétés affiliées (« S&P »), et Dow Jones[MD] est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« Dow Jones »). Ces marques de commerce ont été octroyées sous licence par SPDJI et ont fait l'objet d'une sous-licence octroyée au gestionnaire à certaines fins. Le FNB n'est ni commandité, ni cautionné, ni vendu, ni promu par SPDJI, Dow Jones, S&P et leurs sociétés affiliées; elles ne font aucune déclaration sur l'opportunité d'investir dans ces produits et ne sont aucunement responsables des erreurs, omissions ou interruptions de l'indice.

* Tous les placements comportent des risques. La valeur d'un FNB peut diminuer autant qu'augmenter, et vous pourriez perdre de l'argent. Le risque d'un FNB est évalué en fonction de la volatilité de son rendement au moyen de la méthode normalisée de classification des risques prescrite par les Autorités canadiennes en valeurs mobilières. La volatilité antérieure n'indique pas quelle sera la volatilité du FNB à l'avenir. Un FNB dont la cote de risque est faible peut tout de même perdre de l'argent. Pour en savoir plus sur la cote de risque et les risques spécifiques qui peuvent avoir une incidence sur le rendement d'un FNB, veuillez passer en revue le prospectus des FNB BMO.

« BMO (le médaillon contenant le M souligné) » est une marque de commerce déposée de la Banque de Montréal, utilisée sous licence. Les points de vue et opinions sont ceux de BMO Gestion mondiale d'actifs et ne doivent pas être considérés comme des recommandations ou des sollicitations d'achat ou de vente de produits qui auraient pu être mentionnés.