

COMPTE-RENDU TRIMESTRIEL :

**Mars 2024**

**FNB environnementaux,  
sociaux et de gouvernance  
(ESG) de BMO**

Investir, mobiliser,  
améliorer



## Avant-propos

Nous continuons de discuter des facteurs ESG, mais parfois en ayant des avis contradictoires. Dans de telles circonstances, il était formidable d'assister à la plus récente conférence de l'AIR à Vancouver. Cet événement de deux jours a permis de discuter de nombreux éléments différents liés à l'investissement responsable.

Les participants ont comparé les meilleures pratiques, échangé des perspectives particulières et, surtout, se sont encouragés à partager des renseignements vérifiés pour contrer une grande partie de la désinformation qui a malheureusement imprégné le contexte des placements.

Comme prévu, nous avons beaucoup parlé des données, ainsi que de la façon dont elles sont générées, mesurées et classées. L'immensité du paysage des facteurs ESG, de la responsabilité et de la durabilité est énorme et sert de nombreuses applications différentes. Décider quelles données sont importantes pour des sociétés de secteurs différents présente un autre défi. Nous avons eu des discussions intéressantes sur l'intelligence artificielle et sa capacité à générer et à noter plus de données, en offrant potentiellement plus de clarté que ce qui est actuellement possible.

Il est important de souligner ce thème, car la transparence et la relativité ont toujours été au cœur de ce compte-rendu trimestriel. Ce sont deux éléments fondamentaux de la création de clarté, puisqu'elles combinent des mesures claires et cohérentes avec une perspective précieuse de l'importance relative.

Un thème est revenu souvent lors des discussions sur l'AIR : la nécessité de présenter des arguments plus factuels pour répondre à certaines des critiques non fondées que les gens ont formulées au sujet de l'investissement responsable. Les investisseurs institutionnels qui font face à certaines de ces pressions pourraient trouver un soutien utile dans les données fournies dans le présent compte-rendu. Comme les données le montrent, le rendement ou l'écart de rendement est négligeable entre les listes de l'IR/ESG et leurs indices de référence à bêta élevé; par conséquent, ces solutions d'IR/ESG peuvent être utilisées comme exposition à la répartition de l'actif de base pour respecter les obligations fiduciaires afin d'atteindre les taux de rendement requis.

De plus, BMO Gestion mondiale d'actifs fournit des précisions complètes sur ses importantes activités de gérance, au moyen de ce rapport et sur son site Web ([Tableau de bord des votes par procuration | BMO Gestion d'actifs \(issgovernance.com\)](#)).

Nous espérons sincèrement que les investisseurs institutionnels utiliseront les données transparentes de notre compte-rendu sur les FNB ESG de BMO pour leurs propres discussions internes, mais aussi comme référence pour mesurer leurs gestionnaires externes.

## Avant-propos (suite)

### 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	

## Avant-propos (suite)

	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC	Non coté	Réduction du risque lié au carbone (t CO <sub>2</sub> /M\$ de ventes)
<b>MSCI World ESG Leaders</b>	26 %	44 %	22 %	8 %	0 %	0 %	0 %		60,0
Indice de référence	14 %	32 %	28 %	20 %	4 %	2 %	0 %		99,0
<b>Amélioration</b>	<b>12 %</b>	<b>12 %</b>	<b>-6 %</b>	<b>-12 %</b>	<b>-4 %</b>	<b>-2 %</b>	<b>0 %</b>	<b>1 %</b>	<b>39,0 %</b>
<b>MSCI Canada ESG Leaders</b>	15 %	72 %	13 %	0 %	0 %	0 %	0 %		132,0
Indice de référence	8 %	59 %	23 %	7 %	3 %	0 %	0 %	4 %	240,0
<b>Amélioration</b>	<b>7 %</b>	<b>13 %</b>	<b>-10 %</b>	<b>-7 %</b>	<b>-3 %</b>	<b>0 %</b>	<b>0 %</b>		<b>45,0 %</b>
<b>MSCI USA ESG Leaders</b>	21 %	40 %	28 %	11 %	1 %	0 %		0	56,0
Indice de référence	11 %	26 %	29 %	26 %	5 %	3 %	0 %	0	96,0
<b>Amélioration</b>	<b>10 %</b>	<b>14 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>-15 %</b>	<b>-4 %</b>	<b>-3 %</b>	<b>0 %</b>		<b>41,6 %</b>
<b>MSCI International ESG Leaders</b>	43 %	51 %	5 %	1 %	0 %	0 %	0 %		62,0
Indice de référence	24 %	44 %	24 %	5 %	2 %	1 %	0 %		90,0
<b>Amélioration</b>	<b>19 %</b>	<b>7 %</b>	<b>-19 %</b>	<b>-4 %</b>	<b>-2 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>0 %</b>		<b>31,1 %</b>
<b>MSCI China ESG Leaders</b>	3 %	18 %	22 %	24 %	32 %	0 %	0 %	0 %	88,0
Indice de référence	2 %	10 %	18 %	24 %	29 %	14 %	4 %	0	235,0
<b>Amélioration</b>	<b>1 %</b>	<b>8 %</b>	<b>4 %</b>	<b>0 %</b>	<b>3 %</b>	<b>-14 %</b>	<b>-4 %</b>		<b>62,6 %</b>
<b>MSCI India ESG Leaders</b>	0 %	24 %	43 %	26 %	7 %	0 %	0 %		260,0
Indice de référence	0 %	17 %	31 %	20 %	13 %	14 %	5 %	0	623,0
<b>Amélioration</b>	<b>0 %</b>	<b>7 %</b>	<b>12 %</b>	<b>6 %</b>	<b>-6 %</b>	<b>-14 %</b>	<b>-5 %</b>		<b>58,2 %</b>
<b>MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris</b>	18 %	29 %	26 %	19 %	4 %	3 %	0 %	1 %	37,0
Indice de référence	14 %	30 %	27 %	19 %	6 %	3 %	0 %		122,0
<b>Amélioration</b>	<b>4 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>0 %</b>	<b>-2 %</b>	<b>0 %</b>	<b>0 %</b>		<b>69,7 %</b>
<b>S&amp;P Global Clean Energy</b>	26 %	26 %	25 %	9 %	6 %	4 %	0 %	4 %	189,0
Indice de référence	6 %	36 %	35 %	20 %	3 %	1 %	0 %		324,0
<b>Amélioration</b>	<b>20 %</b>	<b>-10 %</b>	<b>-10 %</b>	<b>-11 %</b>	<b>3 %</b>	<b>3 %</b>	<b>0 %</b>		<b>41,6 %</b>
<b>Indice Bloomberg MSCI Canada Corp. SRI Bond</b>	12 %	59 %	21 %	8 %	0 %	0 %	0 %		172,8
Indice de référence	10 %	46 %	21 %	8 %	3 %	1 %	0 %	11 %	210,7
<b>Amélioration</b>	<b>2 %</b>	<b>13 %</b>	<b>0 %</b>	<b>0 %</b>	<b>-3 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>0 %</b>		<b>18,0 %</b>
<b>Indice Bloomberg MSCI USA Corp. SRI Bond</b>	8 %	36 %	37 %	19 %	0 %	0 %	0 %		82,0
Indice de référence	5 %	32 %	36 %	17 %	6 %	1 %	0 %		249,0
<b>Amélioration</b>	<b>3 %</b>	<b>4 %</b>	<b>1 %</b>	<b>2 %</b>	<b>-6 %</b>	<b>-1 %</b>	<b>0 %</b>		<b>67,0 %</b>
<b>Indice Bloomberg MSCI USA HY Corp SRI Bond</b>	4 %	33 %	30 %	34 %	0 %	0 %	0 %		195,0
Indice de référence	2 %	15 %	15 %	18 %	16 %	7 %	3 %		259,0
<b>Amélioration</b>	<b>2 %</b>	<b>18 %</b>	<b>15 %</b>	<b>16 %</b>	<b>-16 %</b>	<b>-7 %</b>	<b>-3 %</b>		<b>24,7 %</b>

## Table des matières

Indice MSCI World ESG Leaders	6
Indice MSCI Canada ESG Leaders	7
Indice MSCI USA ESG Leaders Index	8
Indice MSCI EAFE ESG Leaders	9
Indice MSCI China ESG Leaders	10
Indice MSCI India ESG Leaders	11
Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris <sup>1</sup>	12
Indice S&P Global Clean Energy <sup>3</sup>	13
Indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI	14
Indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI	15
Indice Bloomberg MSCI US High Yield Liquid Corporate Sustainability SRI	16
FINB BMO MSCI Global ESG Leaders (ESG <sup>®</sup> ) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	17
FINB BMO ACTIONS DU SECTEUR ÉNERGIE PROPRES (ZCLN) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	18
FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders (ESGA) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	19
FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	19
FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	19
FINB BMO MSCI China ESG Leaders (ZCH) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	19
FINB BMO MSCI India ESG Leaders (ZID) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	19
FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris (ZGRN) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	20
FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines (ESGF) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	20
FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement (ESGH) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023	20
Rapport sur la participation active – BMO Gestion mondiale d'actifs – Premier trimestre 2024	21
Engagements et objectifs de développement durable (ODD)	22
FINB BMO ACTIONS DU SECTEUR ÉNERGIE PROPRES (ZCLN) – Rapport sur la mobilisation – Premier trimestre 2024	23
Annexe	24
Harmonisation avec les objectifs de développement durable des Nations Unies	25
Indice MSCI World ESG Leaders – Ajouts – De janvier à mars 2024	27

Indice MSCI World ESG Leaders

Portefeuille  
MSCI World ESG Leaders



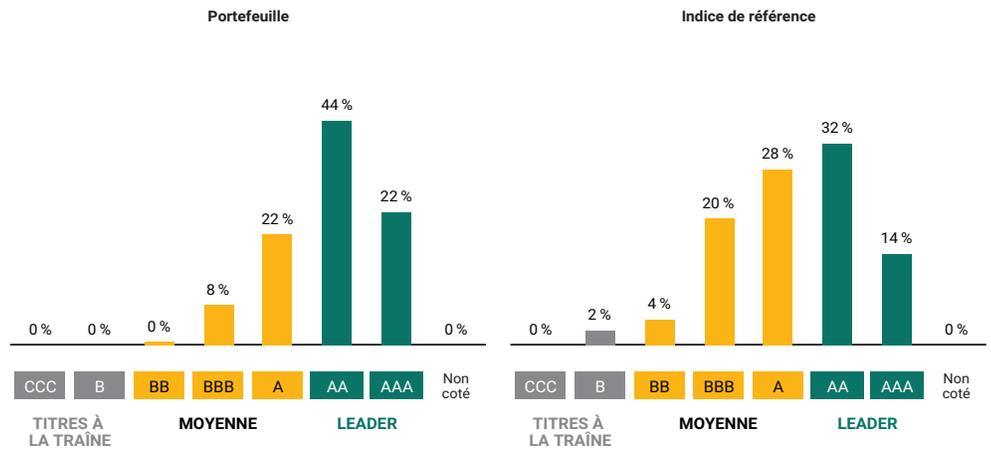
Indice de référence  
MSCI Monde



FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,8</b>	<b>6,9</b>	<b>13,0 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,6	6,1	7,4 %
NOTE SOCIALE	5,4	5,0	8,9 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,8	5,7	1,7 %

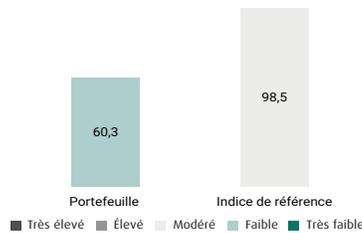
RÉPARTITION DES NOTES ESG



Risque carbone

(t de CO2e/MS DE VENTES)

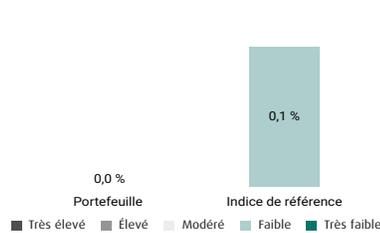
Risque carbone faible  
38,80 % de moins que l'indice de référence



Risque de réputation

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

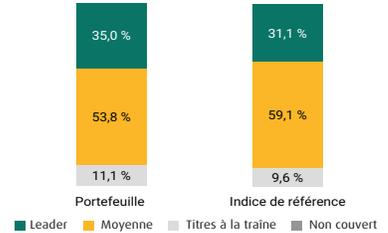
Risque de réputation très faible  
0,08 % de moins que l'indice de référence



Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 3,90 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 1,46 % de plus que l'indice de référence



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI World ESG Leaders (\$ CA)	1,00	1,29	12,66	11,88
Indice MSCI Monde (\$ CA)	1,00	0,00	2,29	11,91

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI World ESG Leaders (\$ CA)	21,69	10,39	11,55	11,51
Indice MSCI Monde (\$ CA)	19,92	9,59	10,92	11,34

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement. \*\*\* Méthodologie de l'indice MSCI ESG Leaders.

### Indice MSCI Canada ESG Leaders

Portefeuille  
MSCI Canada ESG Leaders



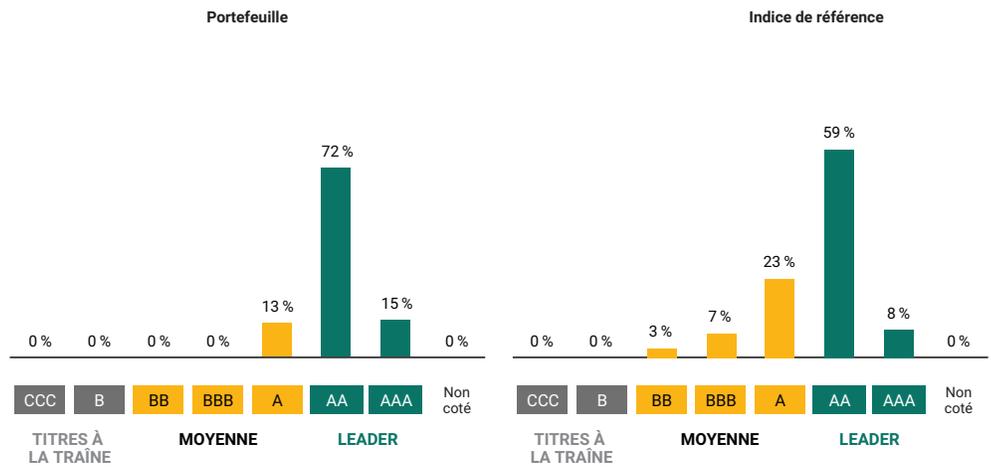
Indice de référence  
MSCI Canada



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>8,1</b>	<b>7,5</b>	<b>8,2 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	5,7	5,3	8,5 %
NOTE SOCIALE	5,2	5,0	3,7 %
NOTE DE GOUVERNANCE	7,0	6,7	4,8 %

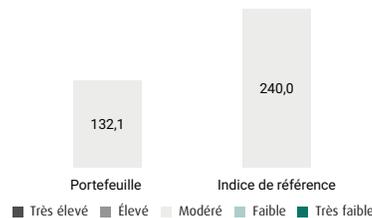
#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)

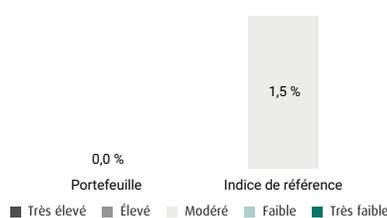
Risque carbone modéré  
44,93 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de réputation

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

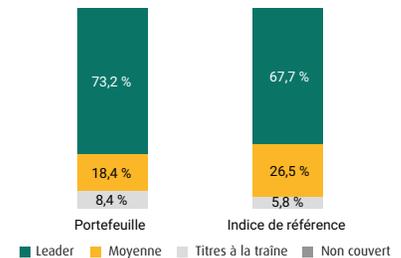
Risque de réputation très faible  
1,52 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 5,52 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 2,67 % de plus que l'indice de référence



#### Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI Canada ESG Leaders (\$ CA)	1,01	3,08	6,38	13,39
Indice MSCI Canada (\$ CA)	1,00	0,00	2,09	12,67

#### Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI Canada ESG Leaders (\$ CA)	8,26	3,28	5,68	6,70
Indice MSCI Canada (\$ CA)	9,33	7,49	7,98	6,55

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

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

Indice MSCI USA ESG Leaders Index

Portefeuille  
MSCI USA ESG Leaders



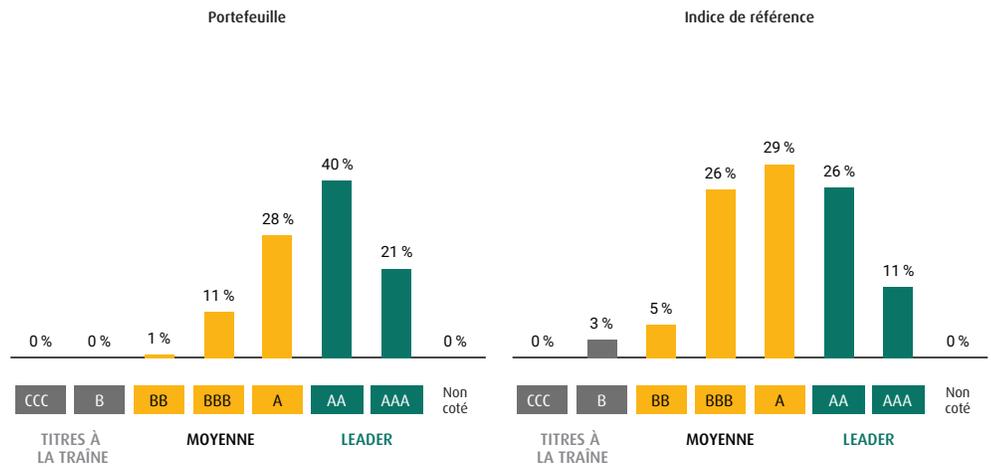
Indice de référence  
MSCI États-Unis



FICHE DE QUALITÉ ESG

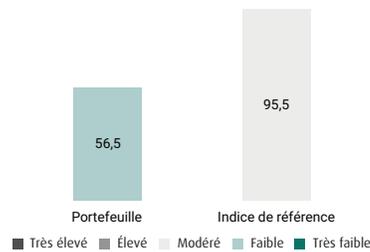
	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,6</b>	<b>6,6</b>	<b>14,6 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,7	6,2	8,3 %
NOTE SOCIALE	5,3	4,9	9,1 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,5	5,4	0,4 %

RÉPARTITION DES NOTES ESG



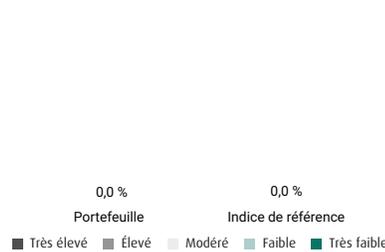
Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)  
Risque carbone faible  
40,88 % de moins que l'indice de référence



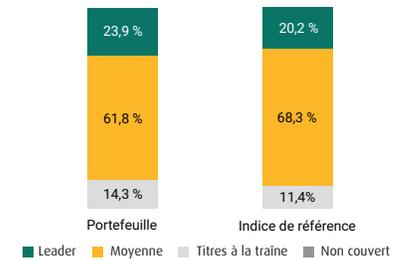
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)  
Risque de réputation très faible  
0,02 % de moins que l'indice de référence



Risque de gouvernance

(Centile mondial)  
Titres chefs de file 3,70 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 2,86 % de plus que l'indice de référence



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI USA ESG Leaders (\$ CA)	0,98	1,90	10,13	12,55
Indice MSCI États-Unis (\$ CA)	1,00	0,00	2,00	12,71

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI USA ESG Leaders (\$ CA)	27,34	12,40	13,94	14,28
Indice MSCI États-Unis (\$ CA)	24,35	10,87	13,09	14,27

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

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



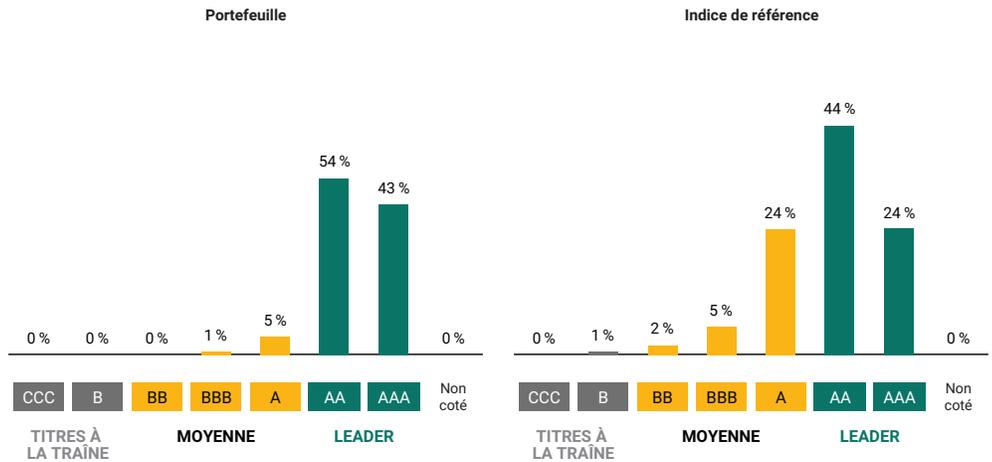
Indice de référence  
MSCI EAEO



FICHE DE QUALITÉ ESG

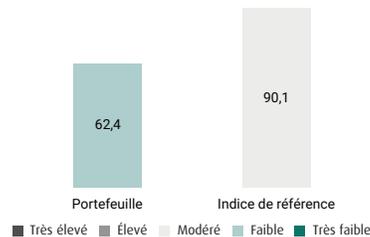
	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>8,5</b>	<b>7,7</b>	<b>10,1 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,5	6,2	4,7 %
NOTE SOCIALE	5,7	5,3	9,3 %
NOTE DE GOUVERNANCE	6,7	6,3	5,7 %

RÉPARTITION DES NOTES ESG



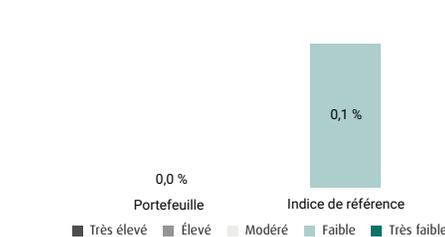
Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)  
Risque carbone faible  
30,76 % de moins que l'indice de référence



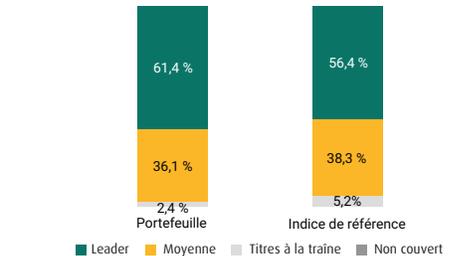
Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)  
Risque de réputation très faible  
0,05 % de moins que l'indice de référence



Risque de gouvernance

(Centile mondial)  
Titres chefs de file 4,95 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 2,78 % de moins que l'indice de référence



Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI EAFE ESG Leaders (\$ CA)	1,00	1,42	22,46	12,28
Indice MSCI EAEO (\$ CA)	1,00	0,00	3,20	12,08

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI EAFE ESG Leaders (\$ CA)	10,11	6,36	7,08	8,76
Indice MSCI EAEO (\$ CA)	10,69	6,72	6,75	8,34

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**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



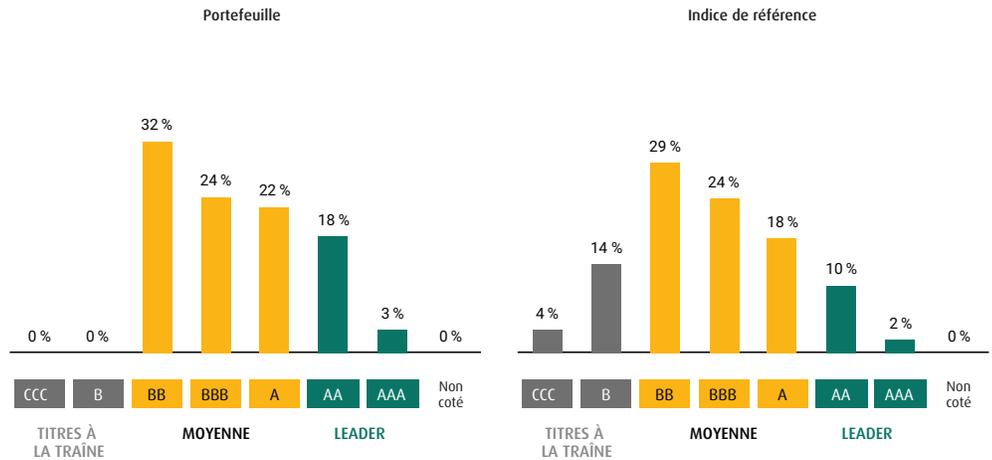
Indice de référence  
MSCI Chine



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

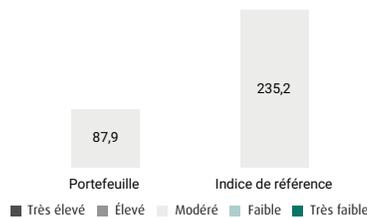
	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>5,8</b>	<b>4,8</b>	<b>20,3 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,4	5,4	19,3 %
NOTE SOCIALE	4,8	4,6	3,5 %
NOTE DE GOUVERNANCE	4,3	4,2	2,4 %

#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



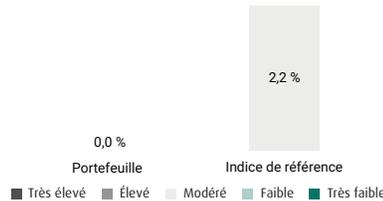
#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)  
Risque carbone modéré  
62,63 % de moins que l'indice de référence



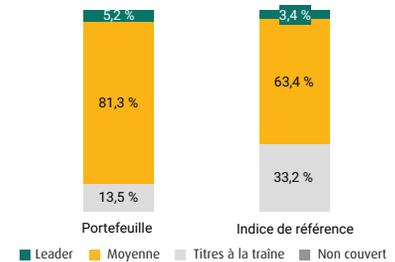
#### Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)  
Risque de réputation très faible  
2,16 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)  
Titres chefs de file 1,76 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 19,70 % de moins que l'indice de référence



#### Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI China ESG Leaders (\$ CA)	0,98	7,04	21,59	24,29
Indice MSCI Chine (\$ CA)	1,00	0,00	7,17	21,80

#### Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI China ESG Leaders (\$ CA)	-8,00	-18,17	-5,69	6,57
Indice MSCI Chine (\$ CA)	-5,57	-14,46	-5,15	4,45

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**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



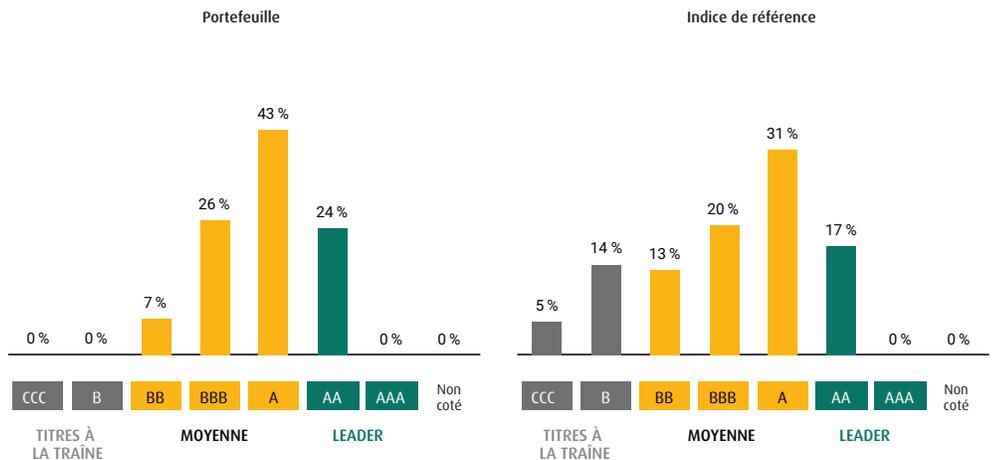
Indice de référence  
MSCI Inde



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

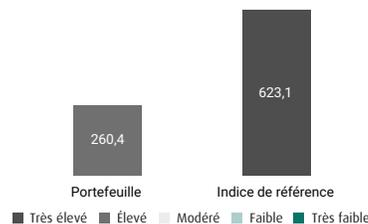
	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>6,2</b>	<b>5,2</b>	<b>20,9 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	5,8	5,0	16,3 %
NOTE SOCIALE	4,9	4,5	8,2 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,2	4,6	12,2 %

#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)  
Risque carbone élevé  
58,22 % de moins que l'indice de référence



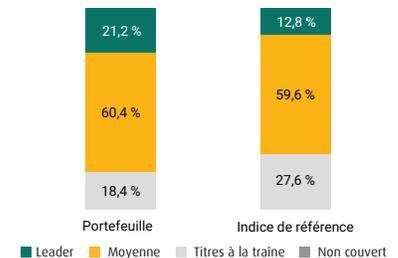
#### Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)  
Risque de réputation très faible  
Portefeuille = Indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)  
Titres chefs de file 8,43 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 9,18 % de moins que l'indice de référence



#### Mesures du risque

	Bêta	Écart de suivi	Taux de rotation (%)	Écart-type (% , 10 ans)
Indice MSCI India ESG Leaders (\$ CA)	0,89	5,91	29,30	18,09
Indice MSCI Inde (\$ CA)	1,00	0,00	10,84	18,40

#### Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI India ESG Leaders (\$ CA)	27,98	13,58	11,58	13,41
Indice MSCI Inde (\$ CA)	36,14	17,78	12,41	12,57

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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.

Source : MSCI Inc. Au 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

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

Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris<sup>1</sup>

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



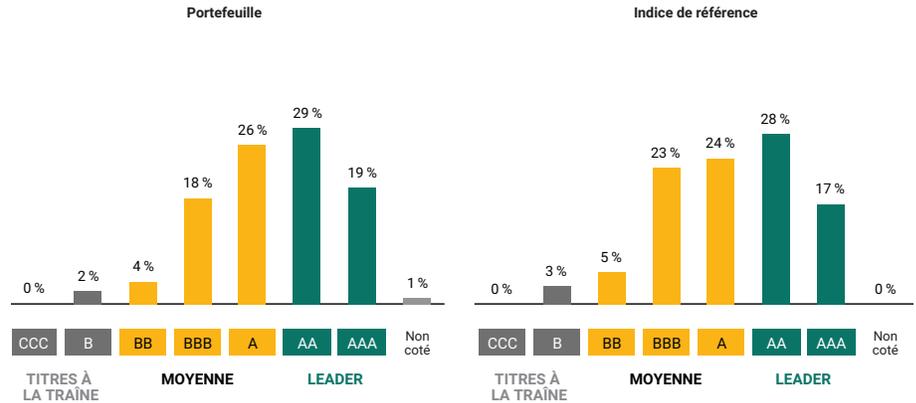
Indice de référence  
MSCI Monde tous pays



FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,1</b>	<b>6,8</b>	<b>3,6 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,6	6,6	0,2 %
NOTE SOCIALE	5,1	5,0	1,4 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,7	5,5	4,1 %

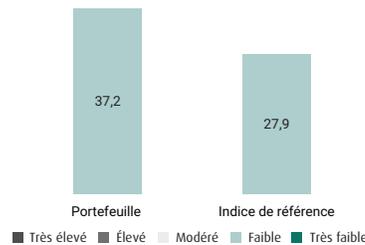
RÉPARTITION DES NOTES ESG



Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)

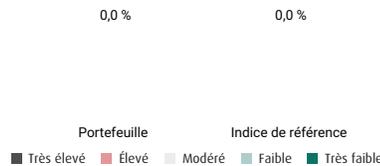
Risque carbone faible  
33,35% de plus que l'indice de référence



Risque de réputation

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

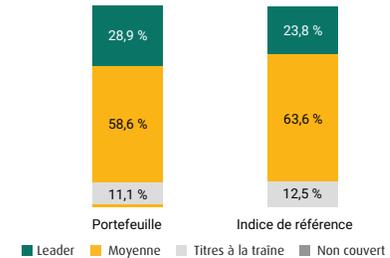
Risque de réputation très faible  
Portefeuille = Indice de référence



Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 5,15 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 1,45 % de moins que l'indice de référence



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)	1,02	1,27	11,29	11,83
MSCI Monde tous pays	1,00	0,00	2,57	11,55

Rendement

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Indice MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris (\$ CA)	16,78	6,95	9,68	11,57
MSCI Monde tous pays	18,98	8,18	9,91	11,07

Au 30 avril 2024. Les rendements indiciaires 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.

**FINB BMO MSCI ACWI actions alignées sur l'Accord de Paris**  
**ZGRN<sup>2</sup>**  
Frais de gestion : 0,25 %  
Cote de risque\* : Moyenne

<sup>1</sup> Les mesures de risque et les données sur le rendement ne sont pas fournies, car le fonds n'était pas offert depuis une année complète au 31 décembre 2022.

<sup>2</sup> Veuillez noter que le FNB a été inscrit à la cote de la bourse le 17 janvier 2022, de sorte que nous n'aurons pas les données pour l'ensemble de l'année avant la date anniversaire.

Source : MSCI Inc. Au 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

### Indice S&P Global Clean Energy<sup>3</sup>

Portefeuille  
Indice S&P Global Clean Energy



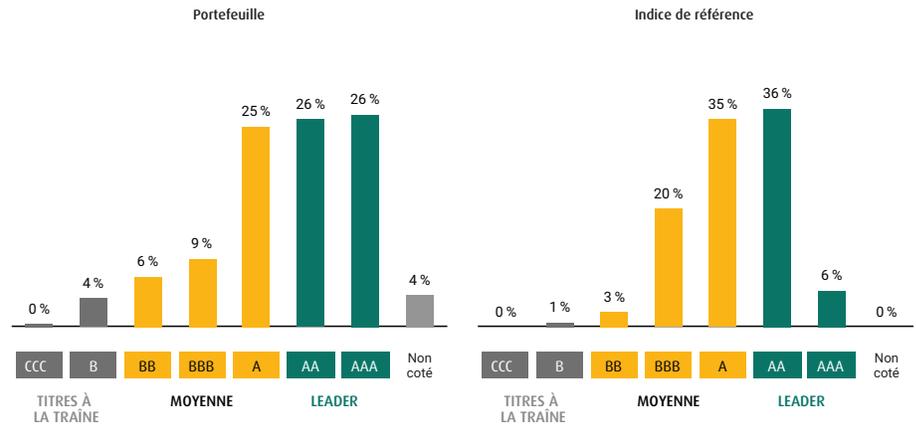
Indice de référence  
S&P Global 1200 Energy



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,3</b>	<b>6,8</b>	<b>8,3 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	7,4	5,2	41,1 %
NOTE SOCIALE	5,7	6,1	-7,9 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,6	6,1	-8,3 %

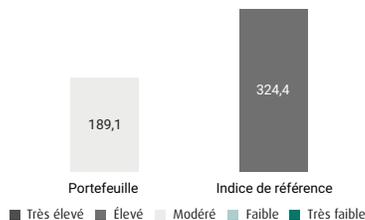
#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)

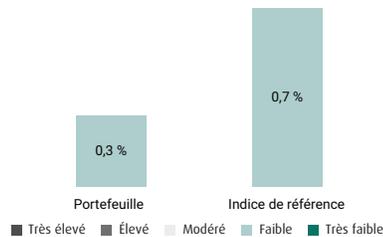
Risque carbone modéré  
41,70 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de réputation

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

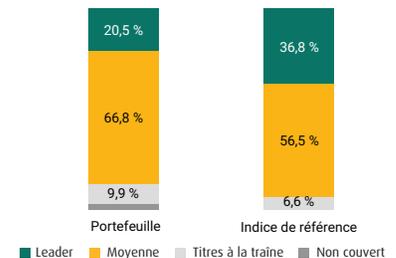
Risque de réputation faible  
0,40 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 16,29 % de moins que l'indice de référence  
Titres à la traîne 3,27 % de plus 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.

<sup>3</sup> 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.

<sup>4</sup> 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**FINB BMO actions du secteur énergie propre ZCLN<sup>4</sup>**  
Frais de gestion : 0,35 %  
Cote de risque\* : Élevée

### Indice Bloomberg MSCI Canada Corporate Sustainability SRI

Portefeuille  
Indice Bloomberg  
MSCI Canada Corporate  
Sustainability SRI



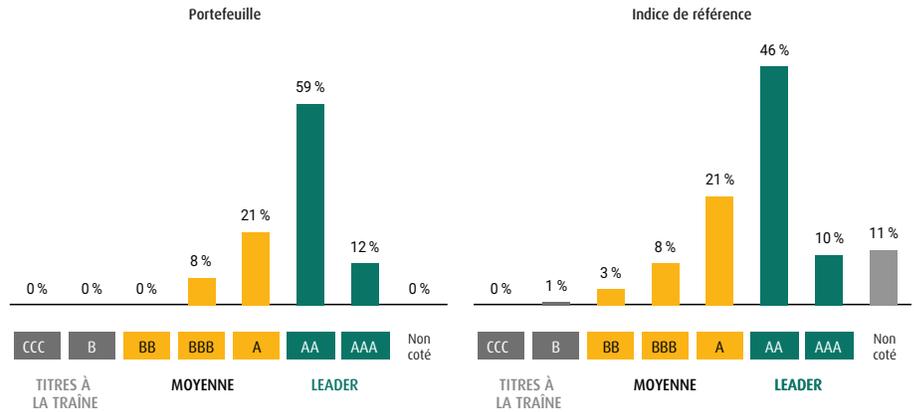
Indice de référence  
Bloomberg Canada  
Corporate



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

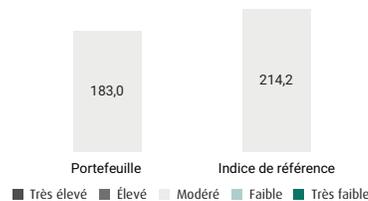
	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,6</b>	<b>7,3</b>	<b>4,7 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	7,0	6,9	1,3 %
NOTE SOCIALE	5,0	5,0	0,7 %
NOTE DE GOUVERNANCE	6,4	6,3	0,7 %

#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



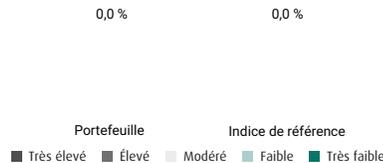
#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)  
Risque carbone modéré  
14,55 % de moins que l'indice de référence



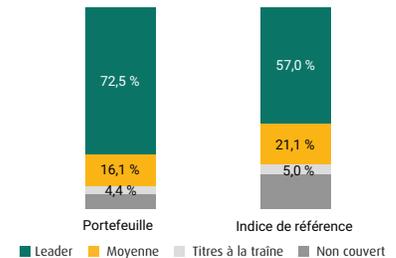
#### Risque de réputation

(Signal d'alerte d'exposition à la controverse)  
Risque de réputation très faible  
Portefeuille = Indice de référence



#### Risque de gouvernance

(centile mondial)  
Titres chefs de file 15,55 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 0,61 % de moins que l'indice de référence



#### 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**FINB BMO ESG de sociétés américaines à haut rendement**  
**ESGB**  
Duration : 5,5  
Frais de gestion : 0,15 %  
Cote de risque\* : Faible

### Indice Bloomberg MSCI US Corporate Sustainability SRI

Portefeuille  
Indice Bloomberg  
MSCI US Corporate  
Sustainability SRI



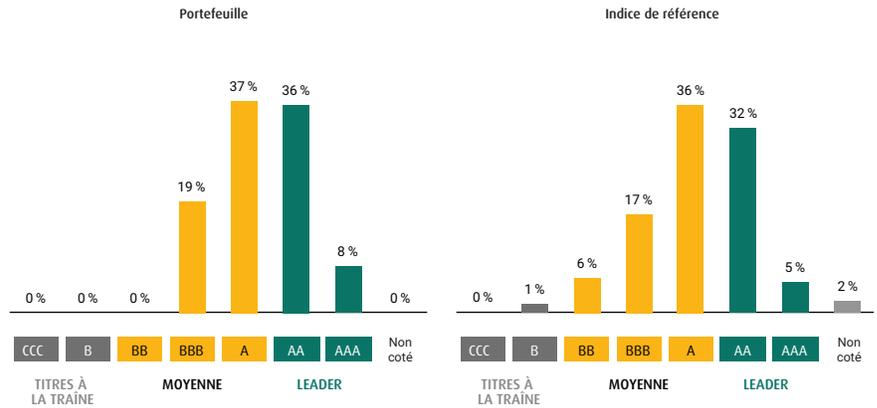
Indice de référence  
Bloomberg US Corporate



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>7,0</b>	<b>6,6</b>	<b>6,3 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	6,4	6,8	-5,5 %
NOTE SOCIALE	4,9	4,6	7,1 %
NOTE DE GOUVERNANCE	5,8	5,4	7,9 %

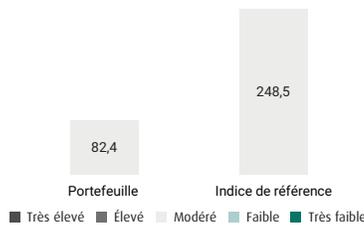
#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



#### Risque carbone

(t de CO2e/M\$ DE VENTES)

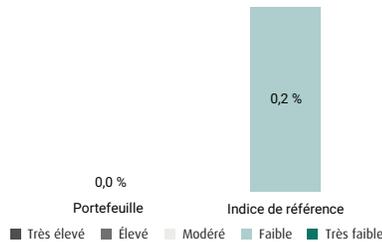
Risque carbone modéré  
66,86 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de réputation

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

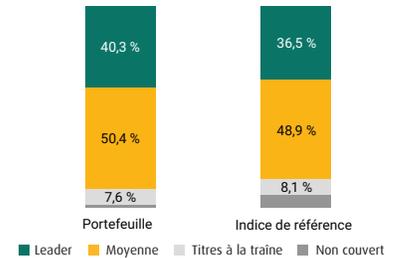
Risque de réputation très faible  
0,18 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 3,79 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 0,42 % de moins que l'indice de référence



### 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 30 avril 2024. \* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement**

**ESGF**

couvert en \$ CA  
Durée : 7,1  
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



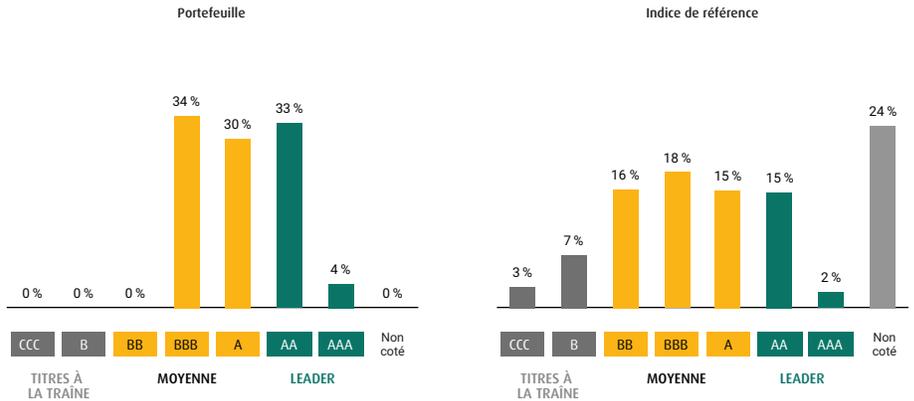
Indice de référence  
Bloomberg US High Yield



#### FICHE DE QUALITÉ ESG

	Portefeuille	Indice de référence	Actif
<b>NOTES DE QUALITÉ ESG (de 0 à 10)</b>	<b>6,6</b>	<b>5,3</b>	<b>24,6 %</b>
NOTE ENVIRONNEMENTALE	5,3	4,8	9,6 %
NOTE SOCIALE	4,9	4,3	15,5 %
NOTE DE GOUVERNANCE	6,0	5,5	8,7 %

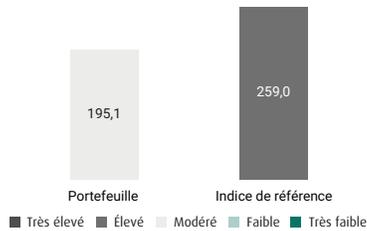
#### RÉPARTITION DES NOTES ESG



#### Risque carbone

(t de CO2e/MS DE VENTES)

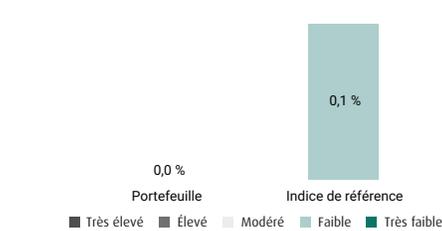
Risque carbone modéré  
24,68 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de réputation

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

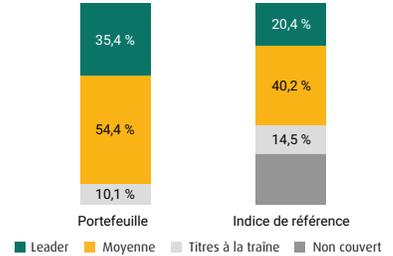
Risque de réputation très faible  
0,06 % de moins que l'indice de référence



#### Risque de gouvernance

(Centile mondial)

Titres chefs de file 14,98 % de plus que l'indice de référence  
Titres à la traîne 4,40 % de moins que l'indice de référence



#### 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 30 avril 2024. ESGH : La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.  
\* La variation des taux de change pourrait aussi réduire la valeur de votre placement.

**FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement**

**ESGH** **ESGH.F**

non couvert      couvert en dollars \$ CA

Durée : 3,5

Frais de gestion : 0,45 %

Cote de risque\* : Faible à moyenne

## FINB BMO MSCI Global ESG Leaders (ESGG\*) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

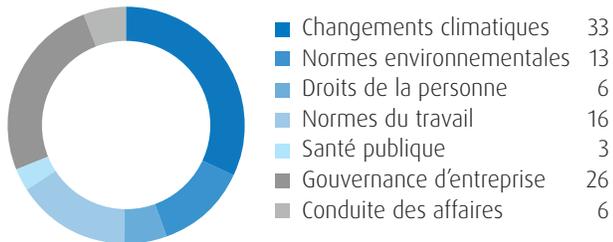
## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints***	Pays couverts
55	46	7	11

## Sociétés mobilisées par région



## Sociétés mobilisées par enjeu\*\*



## Jalons atteints par enjeu



\* 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 31 mars 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 ACTIONS DU SECTEUR ÉNERGIE PROPRE (ZCLN) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

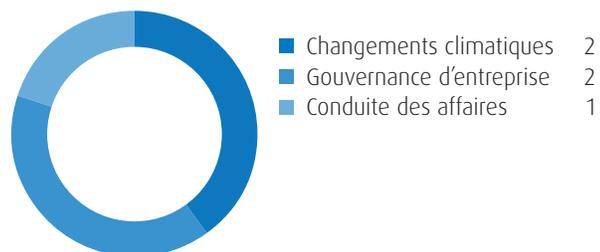
## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
3	2	0	2

## Sociétés mobilisées par région



## Sociétés mobilisées par enjeu\*



\* Les sociétés peuvent avoir été mobilisées pour plus d'un enjeu.

Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 31 mars 2024.

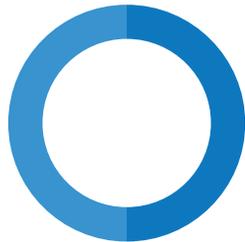
\*\* Un jalon est pris en compte lorsqu'une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s'harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

## FINB BMO MSCI Canada ESG Leaders (ESGA) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
2	2	0	2

## Sociétés mobilisées par enjeu\*



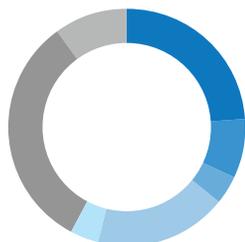
■ Changements climatiques	1
■ Gouvernance d'entreprise	1

## FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

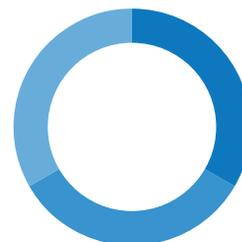
Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
24	21	3	2

## Sociétés mobilisées par enjeu\*



■ Changements climatiques	12
■ Normes environnementales	4
■ Droits de la personne	2
■ Normes du travail	9
■ Santé publique	2
■ Gouvernance d'entreprise	16
■ Conduite des affaires	5

## Jalons atteints par enjeu



■ Changements climatiques	1
■ Normes du travail	1
■ Gouvernance d'entreprise	1

## FINB BMO MSCI EAFE ESG Leaders (ESGE) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
29	23	4	8

## FINB BMO MSCI China ESG Leaders (ZCH) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
10	10	1	1

## FINB BMO MSCI India ESG Leaders (ZID) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023

## Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
2	2	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 31 mars 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 – Quatrième trimestre 2023****Sociétés mobilisées pendant ce trimestre**

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
76	69	23	13

**FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines (ESGF) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023****Sociétés mobilisées pendant ce trimestre**

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
31	25	6	3

**FINB BMO ESG obligations de sociétés américaines à haut rendement (ESGH) – Rapport sur la mobilisation – Quatrième trimestre 2023****Sociétés mobilisées pendant ce trimestre**

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
1	1	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 31 mars 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.

Rapport sur la participation active – BMO Gestion mondiale d’actifs – Premier trimestre 2024

Sociétés mobilisées pendant ce trimestre

Nombre de mobilisations	Sociétés mobilisées	Jalons atteints**	Pays couverts
243	213	53	28

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 31 mars 2024.

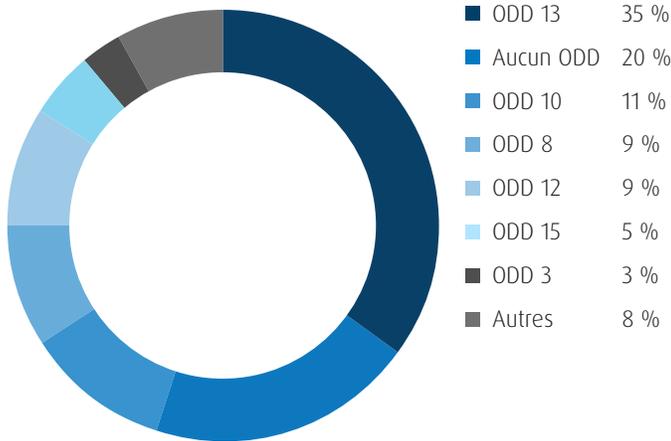
\*\* Un jalon est pris en compte lorsqu’une société apporte des améliorations tangibles à ses politiques et pratiques qui s’harmonisent avec nos activités de vote et de mobilisation.

### Engagements et objectifs de développement durable (ODD)

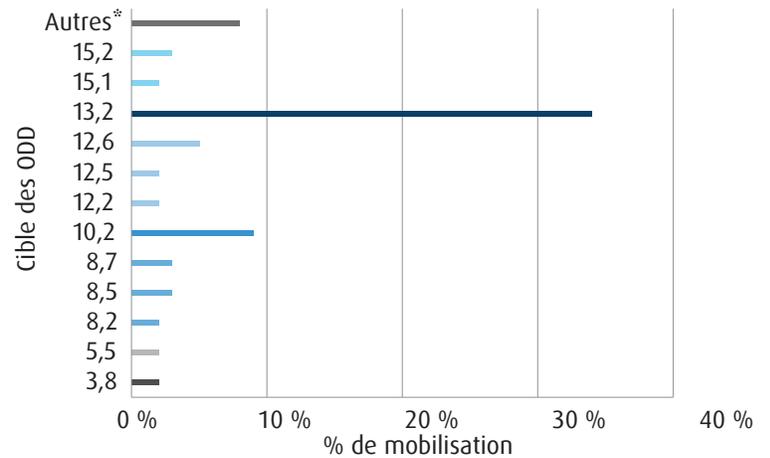
Visant à tracer un parcours vers un monde plus durable, les 17 objectifs de développement durable (ODD) ont été développés par l'ONU et des parties prenantes de différents secteurs d'activité.

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.

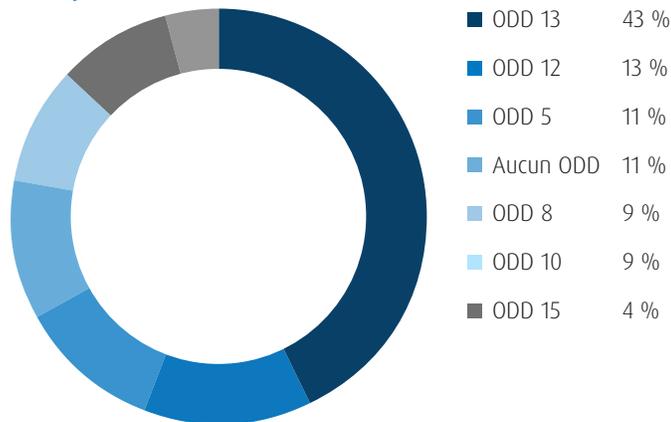
**Engagement : Niveau de l'ODD**



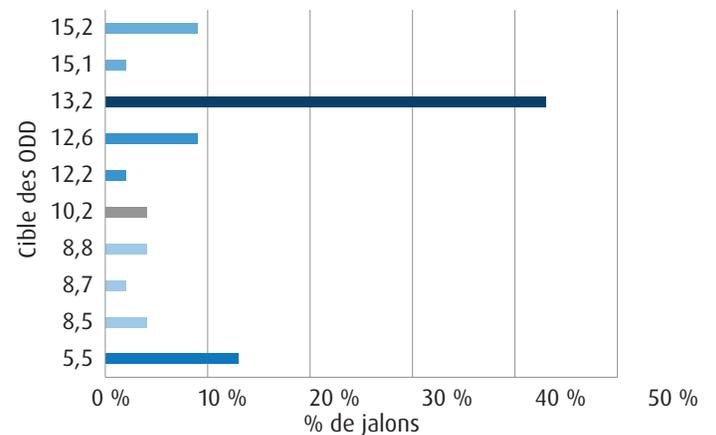
**Engagement : Niveau cible de l'ODD**



**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.

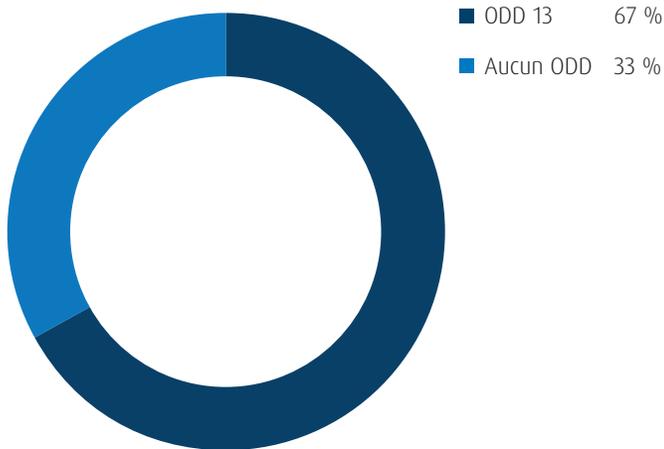
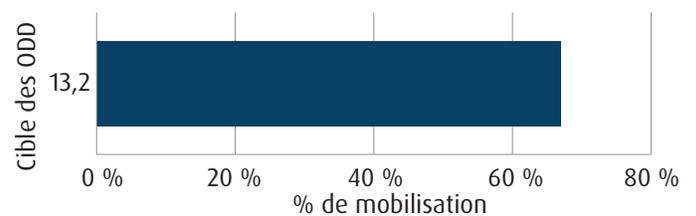
Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 31 mars 2024.

\* 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 ACTIONS DU SECTEUR ÉNERGIE PROPRE (ZCLN) – Rapport sur la mobilisation – Premier trimestre 2024**

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**

Source : Columbia Threadneedle Investments. Au 31 mars 2024.

## Annexe



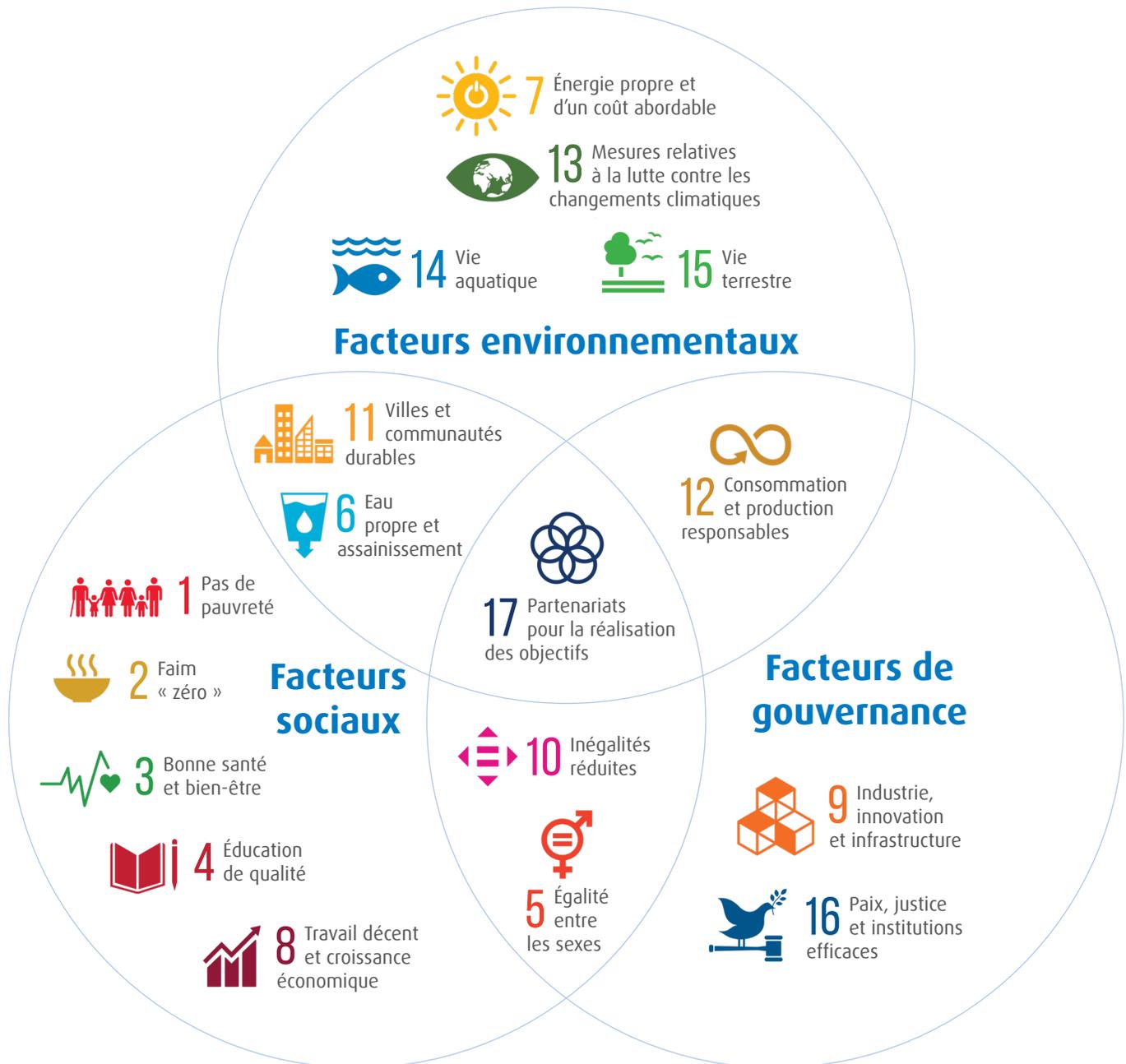
ODD	Cible	Résumé de la cible
■ ODD1	1.1	Éliminer la pauvreté et assurer un salaire de subsistance à tous
■ ODD2	2.2	Mettre fin à toutes les formes de malnutrition, en particulier chez les enfants et les femmes
■ ODD3	3.3	Éradiquer le sida, la tuberculose, le paludisme, les maladies transmises par l'eau 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.

**Indice MSCI World ESG Leaders – Ajouts – De janvier à mars 2024****Ajouts**

- Subaru Corp
- Denso Corp.
- CK Infrastructure Holdings Ltd
- Murata Manufacturing Co. Ltd
- NRG Energy Inc
- Bandai Namco Holdings Inc

**Suppressions**

- Naturgy Energy Group SA
- Sumitomo Chemical Co Ltd
- VF Corp
- L3Harris Technologies Inc.
- Algonquin Power & Utilities Corp.
- IGO Ltd
- Open House Group Co Ltd
- HelloFresh SE

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.**

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 règlements applicables.

« 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.

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.

Le présent document 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<sup>MD</sup>, S&P 500<sup>MD</sup>, US 500, The 500, iBoxx<sup>MD</sup>, iTraxx<sup>MD</sup> et CDX<sup>MD</sup> sont des marques de commerce de S&P Global, Inc. ou de ses sociétés affiliées (« S&P »), et Dow Jones<sup>MD</sup> 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.