

États financiers semestriels

Portefeuilles BMO privé

30 juin 2024

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

AVIS DE NON-EXAMEN DES ÉTATS FINANCIERS SEMESTRIELS PAR LES AUDITEURS

BMO Gestion privée de placements inc., le gestionnaire du Portefeuille, nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Portefeuille. En vertu de la législation canadienne en valeurs mobilières (le « Règlement 81-106 »), si les auditeurs n'ont pas effectué l'examen des états financiers semestriels, un avis accompagnant les états financiers doit en faire état.

Les auditeurs indépendants du Portefeuille n'ont pas examiné ces états financiers semestriels conformément aux normes établies par l'organisation Comptables professionnels agréés du Canada (CPA Canada).



Gestion privée

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

ÉTAT DE LA SITUATION FINANCIÈRE

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

Aux	30 juin 2024	31 décembre 2023
Actif		
Actif courant		
Trésorerie	136	81
Placements		
Actifs financiers non dérivés	2 698 214	2 259 661
Souscriptions à recevoir	55 280	20 887
Intérêts à recevoir	777	336
Total de l'actif	2 754 407	2 280 965
Passif		
Passif courant		
Rachats à payer	29 893	17 142
Distributions à payer	1 087	1 059
Charges à payer	163	144
Total du passif	31 143	18 345
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	2 723 264	2 262 620
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part	10,00 \$	10,00 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Revenus		
Revenus d'intérêts	61 078	45 110
Gain net sur la juste valeur des placements et dérivés	61 078	45 110
Prêt de titres (note 8)	0	3
Total des autres revenus	0	3
Total des revenus	61 078	45 113
Charges		
Honoraires de sous-conseillers	1 294	1 044
Honoraires d'audit	5	5
Frais du comité d'examen indépendant	1	1
Droits de garde	16	15
Frais juridiques et frais de dépôt	86	80
Frais de service aux porteurs de parts	363	356
Frais d'imprimerie et de papeterie	9	9
Charges d'exploitation absorbées par le gestionnaire	(1 294)	(1 044)
Total des charges	480	466
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	60 598	44 647
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (note 8)	0,26	0,24

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

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

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens.)

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à l'ouverture de la période	2 262 620	2 084 053
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	60 598	44 647
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(60 598)	(44 647)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(60 598)	(44 647)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	3 882 009	2 403 399
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	54 263	39 267
Rachat de parts rachetables	(3 475 628)	(2 624 385)
Augmentation (diminution) nette au titre des transactions sur parts rachetables	460 644	(181 719)
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	460 644	(181 719)
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	2 723 264	1 902 334

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

TABLEAU DES FLUX DE TRÉSORERIE

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens.)

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation		
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	60 598	44 647
Ajustements au titre des éléments suivants :		
Augmentation des intérêts à recevoir	(441)	(254)
Augmentation des charges à payer	19	33
Amortissement des primes et escomptes	(8 587)	(1 085)
Achats de placements	(8 560 028)	(8 083 352)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	8 130 062	8 283 184
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(378 377)	243 173
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(6 307)	(5 246)
Produit de l'émission de parts rachetables	3 847 616	2 402 507
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(3 462 877)	(2 640 697)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	378 432	(243 436)
Augmentation (diminution) nette de la trésorerie	55	(263)
Trésorerie à l'ouverture de la période	81	336
Trésorerie à la clôture de la période	136	73
Information supplémentaire		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	52 050	43 771

* Cet élément est lié aux activités d'exploitation.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
TITRES DU MARCHÉ MONÉTAIRE — 94,1 %			
<i>Provincial — 1,5 %</i>			
Province du Manitoba, bons du Trésor, 4,628 %, 11 sept. 2024	11 000	10 900	10 900
Province d'Ontario, bons du Trésor, 4,807 %, 28 août 2024	3 500	3 473	3 473
South Coast British Columbia Transportation Authority, billets à ordre, 4,982 %, 10 juill. 2024	12 500	12 485	12 485
South Coast British Columbia Transportation Authority, billets à ordre, 4,982 %, 24 juill. 2024	10 000	9 969	9 969
South Coast British Columbia Transportation Authority, billets à ordre, 4,961 %, 14 août 2024	4 000	3 976	3 976
		40 803	40 803
<i>Municipal — 2,8 %</i>			
Municipal Finance Authority of British Columbia, bons du Trésor, 4,727 %, 17 juill. 2024	12 000	11 975	11 975
Municipal Finance Authority of British Columbia, papier commercial, 4,971 %, 17 juill. 2024	3 000	2 994	2 994
Municipal Finance Authority of British Columbia, papier commercial, 4,727 %, 24 juill. 2024	7 000	6 979	6 979
Municipal Finance Authority of British Columbia, papier commercial, 4,971 %, 31 juill. 2024	5 000	4 980	4 980
Municipal Finance Authority of British Columbia, papier commercial, 4,698 %, 4 sept. 2024	5 000	4 958	4 958
Municipal Finance Authority of British Columbia, papier commercial, 4,519 %, 18 déc. 2024	15 000	14 685	14 685
Toronto Hydro Corporation, papier commercial, 4,804 %, 3 juill. 2024	20 000	19 995	19 995
Toronto Hydro Corporation, papier commercial, 4,795 %, 8 juill. 2024	10 000	9 991	9 991
		76 557	76 557
<i>Sociétés — 89,8 %</i>			
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 2 juill. 2024	5 000	4 999	4 999
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 3 juill. 2024	9 000	8 998	8 998
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 4 juill. 2024	15 000	14 994	14 994
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 9 juill. 2024	10 000	9 990	9 990
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 10 juill. 2024	6 000	5 993	5 993
Alectra Inc., papier commercial, 4,784 %, 12 juill. 2024	16 000	15 977	15 977
La Banque de Nouvelle-Écosse, acceptations bancaires, 4,685 %, 6 août 2024	13 677	13 614	13 614
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets de dépôt au porteur, 4,938 %, 27 août 2024	10 000	9 923	9 923
Banner Trust, papier commercial, 5,148 %, 4 sept. 2024	11 625	11 519	11 519
Banner Trust, papier commercial, 5,136 %, 20 sept. 2024	20 000	19 773	19 773
Banner Trust, papier commercial, 4,806 %, 24 sept. 2024	4 700	4 648	4 648
Banner Trust, papier commercial, 5,082 %, 2 oct. 2024	5 000	4 935	4 935
Banner Trust, papier commercial, 4,911 %, 4 nov. 2024	10 000	9 831	9 831
Banner Trust, papier commercial, 4,892 %, 3 déc. 2024	6 000	5 876	5 876
Banner Trust, papier commercial, 4,680 %, 6 déc. 2024	10 000	9 798	9 798
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,284 %, 31 juill. 2024	22 000	21 905	21 905
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,060 %, 2 août 2024	35 000	34 845	34 845
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,310 %, 6 août 2024	24 000	23 875	23 875

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,311 %, 6 août 2024	3 750	3 730	3 730
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,076 %, 19 août 2024	10 000	9 932	9 932
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,168 %, 28 août 2024	4 000	3 967	3 967
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,169 %, 28 août 2024	2 000	1 984	1 984
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,043 %, 16 sept. 2024	2 490	2 464	2 464
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 8 oct. 2024	3 000	2 959	2 959
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 12 nov. 2024	5 500	5 398	5 398
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 4,721 %, 11 déc. 2024	10 000	9 790	9 790
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,022 %, 2 juill. 2024	30 000	29 996	29 996
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,806 %, 4 juill. 2024	10 000	9 996	9 996
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,797 %, 8 juill. 2024	10 000	9 991	9 991
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,772 %, 10 juill. 2024	10 000	9 988	9 988
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,771 %, 15 juill. 2024	24 000	23 956	23 956
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,030 %, 17 juill. 2024	17 000	16 963	16 963
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,004 %, 22 juill. 2024	20 000	19 943	19 943
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,769 %, 23 juill. 2024	10 000	9 971	9 971
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,783 %, 23 juill. 2024	8 000	7 977	7 977
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,752 %, 21 août 2024	20 000	19 868	19 868
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,734 %, 23 août 2024	10 000	9 931	9 931
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,718 %, 26 sept. 2024	9 400	9 295	9 295
Banque Canadienne Impériale de Commerce, acceptations bancaires, 4,712 %, 15 juill. 2024	15 000	14 973	14 973
Banque Canadienne Impériale de Commerce, acceptations bancaires, 4,723 %, 15 juill. 2024	10 000	9 982	9 982
Banque Canadienne Impériale de Commerce, acceptations bancaires, 4,737 %, 18 juill. 2024	9 250	9 230	9 230
Banque Canadienne Impériale de Commerce, acceptations bancaires, 4,682 %, 2 déc. 2024	3 930	3 853	3 853
Banque canadienne de l'Ouest, billets de dépôt au porteur, 4,585 %, 18 déc. 2024	25 000	24 468	24 468
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,990 %, 2 juill. 2024	4 000	3 999	3 999
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,982 %, 16 juill. 2024	6 000	5 988	5 988
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,991 %, 16 juill. 2024	22 100	22 055	22 055
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,979 %, 23 juill. 2024	6 000	5 982	5 982
Central 1 Credit Union, papier commercial, 5,005 %, 1 ^{er} août 2024	7 000	6 970	6 970
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,983 %, 6 août 2024	5 250	5 224	5 224
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,951 %, 27 août 2024	5 000	4 961	4 961
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,968 %, 3 sept. 2024	5 000	4 957	4 957
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,967 %, 5 sept. 2024	5 000	4 955	4 955
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,949 %, 6 sept. 2024	15 000	14 864	14 864
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,669 %, 9 sept. 2024	7 200	7 136	7 136
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,911 %, 9 sept. 2024	10 000	9 906	9 906
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,911 %, 10 sept. 2024	5 000	4 952	4 952
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,667 %, 13 sept. 2024	14 000	13 868	13 868
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,911 %, 16 sept. 2024	20 000	19 793	19 793
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,667 %, 17 sept. 2024	18 000	17 821	17 821
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,909 %, 18 sept. 2024	10 000	9 894	9 894
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,844 %, 22 oct. 2024	8 200	8 077	8 077
Central 1 Credit Union, papier commercial, 4,786 %, 3 déc. 2024	20 000	19 595	19 595

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 5,025 %, 2 août 2024	7 000	6 969	6 969
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 5,024 %, 6 août 2024	13 950	13 881	13 881
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,874 %, 18 sept. 2024	5 000	4 947	4 947
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,919 %, 18 sept. 2024	4 000	3 957	3 957
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,893 %, 19 sept. 2024	5 400	5 342	5 342
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,873 %, 23 sept. 2024	5 000	4 944	4 944
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,873 %, 24 sept. 2024	10 000	9 887	9 887
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,871 %, 26 sept. 2024	3 000	2 965	2 965
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,873 %, 1 ^{er} oct. 2024	15 000	14 816	14 816
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,864 %, 21 oct. 2024	4 650	4 581	4 581
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,583 %, 26 nov. 2024	10 000	9 815	9 815
Coast Capital Savings Federal Credit Union, billets de dépôt au porteur, 4,566 %, 19 déc. 2024	5 000	4 893	4 893
First Nations Finance Authority, papier commercial, 4,732 %, 11 juill. 2024	30 800	30 760	30 760
First Nations Finance Authority, papier commercial, 4,732 %, 25 juill. 2024	29 500	29 408	29 408
FortisBC Energy Inc., papier commercial, 4,953 %, 29 août 2024	15 000	14 880	14 880
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,283 %, 25 juill. 2024	1 189	1 185	1 185
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,226 %, 6 août 2024	11 121	11 064	11 064
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,169 %, 22 août 2024	5 622	5 581	5 581
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,169 %, 5 sept. 2024	18 203	18 033	18 033
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,150 %, 9 sept. 2024	11 184	11 074	11 074
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,143 %, 1 ^{er} oct. 2024	7 899	7 797	7 797
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,089 %, 18 oct. 2024	3 375	3 324	3 324
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,119 %, 18 oct. 2024	5 253	5 173	5 173
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,008 %, 1 ^{er} nov. 2024	14 637	14 391	14 391
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,007 %, 4 nov. 2024	9 589	9 424	9 424
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, papier commercial, 4,758 %, 24 juill. 2024	16 850	16 800	16 800
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, papier commercial, 4,758 %, 25 juill. 2024	20 000	19 938	19 938
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,225 %, 5 juill. 2024	10 000	9 994	9 994
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,204 %, 16 juill. 2024	14 250	14 220	14 220
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,203 %, 19 juill. 2024	5 800	5 785	5 785

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,206 %, 19 juill. 2024	15 000	14 962	14 962
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,168 %, 7 août 2024	10 800	10 744	10 744
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,168 %, 8 août 2024	4 000	3 979	3 979
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,155 %, 23 août 2024	4 000	3 970	3 970
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 5,096 %, 4 sept. 2024	5 200	5 153	5 153
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 4,875 %, 12 sept. 2024	10 000	9 903	9 903
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 4,863 %, 19 sept. 2024	10 000	9 894	9 894
Inter Pipeline (Corridor) Inc., papier commercial, 4,854 %, 25 sept. 2024	7 000	6 920	6 920
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,291 %, 7 août 2024	5 000	4 973	4 973
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,291 %, 8 août 2024	10 000	9 945	9 945
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,012 %, 23 août 2024	5 000	4 964	4 964
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,168 %, 28 août 2024	8 000	7 934	7 934
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,062 %, 10 sept. 2024	4 300	4 258	4 258
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,042 %, 13 sept. 2024	7 000	6 929	6 929
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,092 %, 2 oct. 2024	20 000	19 741	19 741
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,037 %, 4 oct. 2024	5 000	4 935	4 935
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,082 %, 4 oct. 2024	5 900	5 822	5 822
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,107 %, 4 oct. 2024	18 000	17 761	17 761
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 8 oct. 2024	11 500	11 343	11 343
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,057 %, 8 oct. 2024	6 500	6 411	6 411
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,041 %, 15 oct. 2024	10 000	9 854	9 854
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,064 %, 16 oct. 2024	5 000	4 926	4 926
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,064 %, 17 oct. 2024	11 000	10 836	10 836
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,062 %, 30 oct. 2024	10 000	9 833	9 833
King Street Funding Trust, papier commercial, 4,720 %, 16 déc. 2024	5 000	4 892	4 892
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,106 %, 13 août 2024	6 800	6 759	6 759
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,196 %, 27 août 2024	4 700	4 662	4 662
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,175 %, 3 sept. 2024	8 300	8 225	8 225
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,074 %, 4 sept. 2024	9 400	9 315	9 315
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,082 %, 23 sept. 2024	4 000	3 953	3 953
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,082 %, 1 ^{er} oct. 2024	12 300	12 143	12 143
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,023 %, 14 nov. 2024	4 720	4 632	4 632
Lakeshore Trust, papier commercial, 4,748 %, 20 nov. 2024	5 000	4 908	4 908
Lakeshore Trust, papier commercial, 4,720 %, 10 déc. 2024	5 000	4 896	4 896
Lakeshore Trust, papier commercial, 4,702 %, 6 janv. 2025	10 000	9 757	9 757
Régie de l'hydroélectricité du Manitoba, papier commercial, 4,714 %, 9 juill. 2024	14 215	14 200	14 200
Régie de l'hydroélectricité du Manitoba, papier commercial, 4,731 %, 11 juill. 2024	15 000	14 981	14 981
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,758 %, 3 juill. 2024	6 085	6 083	6 083

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 5,007 %, 1 ^{er} août 2024	16 000	15 932	15 932
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 5,044 %, 6 août 2024	5 000	4 975	4 975
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,978 %, 27 août 2024	10 000	9 922	9 922
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,931 %, 4 sept. 2024	12 000	11 895	11 895
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,939 %, 9 sept. 2024	9 500	9 410	9 410
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,840 %, 1 ^{er} nov. 2024	9 800	9 641	9 641
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,861 %, 14 nov. 2024	10 000	9 819	9 819
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,608 %, 6 déc. 2024	5 000	4 901	4 901
Banque Manuvie du Canada, acceptations bancaires, 4,868 %, 9 déc. 2024	6 250	6 116	6 116
Mercedes-Benz Finance Canada Inc., papier commercial, 5,057 %, 2 juill. 2024	4 000	3 999	3 999
Mercedes-Benz Finance Canada Inc., papier commercial, 4,856 %, 18 juill. 2024	35 900	35 819	35 819
Merit Trust, papier commercial, 5,202 %, 9 juill. 2024	3 000	2 997	2 997
Merit Trust, papier commercial, 5,072 %, 16 oct. 2024	8 000	7 881	7 881
Merit Trust, papier commercial, 5,062 %, 22 oct. 2024	5 000	4 922	4 922
Banque Nationale du Canada, acceptations bancaires, 4,973 %, 2 juill. 2024	6 000	5 999	5 999
Nestlé Capital Canada Ltd., papier commercial, 4,707 %, 30 juill. 2024	32 250	32 130	32 130
Nestlé Capital Canada Ltd., papier commercial, 4,697 %, 1 ^{er} août 2024	50 000	49 801	49 801
North West Redwater Partnership, papier commercial, 4,941 %, 5 juill. 2024	7 000	6 996	6 996
North West Redwater Partnership, papier commercial, 4,947 %, 10 juill. 2024	4 500	4 494	4 494
North West Redwater Partnership, papier commercial, 4,927 %, 16 juill. 2024	6 250	6 237	6 237
Ontario Teachers' Finance Trust, papier commercial, 4,863 %, 5 sept. 2024	4 260	4 223	4 223
Ontario Teachers' Finance Trust, papier commercial, 4,833 %, 24 oct. 2024	13 000	12 803	12 803
Ontario Teachers' Finance Trust, papier commercial, 4,680 %, 3 déc. 2024	10 000	9 802	9 802
PACCAR Financial Ltd., papier commercial, 4,806 %, 12 juill. 2024	23 000	22 967	22 967
PACCAR Financial Ltd., papier commercial, 4,791 %, 16 juill. 2024	11 000	10 978	10 978
PACCAR Financial Ltd., papier commercial, 4,790 %, 18 juill. 2024	5 700	5 687	5 687
Plaza Trust, papier commercial, 5,387 %, 22 juill. 2024	4 800	4 785	4 785
Plaza Trust, papier commercial, 5,106 %, 13 août 2024	10 000	9 940	9 940
Plaza Trust, papier commercial, 5,103 %, 20 août 2024	5 100	5 064	5 064
Plaza Trust, papier commercial, 5,076 %, 22 août 2024	4 000	3 971	3 971
Plaza Trust, papier commercial, 5,082 %, 26 sept. 2024	5 400	5 335	5 335

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Plaza Trust, papier commercial, 5,066 %, 1 ^{er} oct. 2024	6 000	5 924	5 924
Plaza Trust, papier commercial, 5,120 %, 3 oct. 2024	5 600	5 526	5 526
Plaza Trust, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	9 000	8 881	8 881
Plaza Trust, papier commercial, 5,092 %, 15 oct. 2024	6 400	6 306	6 306
Plaza Trust, papier commercial, 4,784 %, 21 oct. 2024	5 400	5 321	5 321
Plaza Trust, papier commercial, 5,027 %, 7 nov. 2024	11 900	11 689	11 689
Plaza Trust, papier commercial, 5,044 %, 13 nov. 2024	4 000	3 926	3 926
Plaza Trust, papier commercial, 4,987 %, 26 nov. 2024	10 000	9 798	9 798
Prime Trust, papier commercial, 5,148 %, 4 sept. 2024	10 000	9 909	9 909
Prime Trust, papier commercial, 5,063 %, 15 oct. 2024	10 000	9 853	9 853
Prime Trust, papier commercial, 5,050 %, 21 oct. 2024	7 000	6 892	6 892
Prime Trust, papier commercial, 5,006 %, 20 nov. 2024	10 000	9 806	9 806
Prime Trust, papier commercial, 4,977 %, 27 nov. 2024	5 000	4 899	4 899
Prime Trust, papier commercial, 4,700 %, 11 déc. 2024	5 000	4 895	4 895
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,278 %, 12 juill. 2024	10 000	9 984	9 984
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,178 %, 29 août 2024	5 000	4 958	4 958
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,120 %, 9 sept. 2024	4 000	3 961	3 961
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	2 400	2 368	2 368
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,077 %, 21 oct. 2024	4 000	3 938	3 938
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,067 %, 22 nov. 2024	5 600	5 488	5 488
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,068 %, 22 nov. 2024	2 000	1 960	1 960
Pure Grove Funding, papier commercial, 4,987 %, 27 nov. 2024	5 550	5 437	5 437
Reliant Trust, papier commercial, 5,216 %, 2 août 2024	5 500	5 475	5 475
Reliant Trust, papier commercial, 4,700 %, 9 déc. 2024	5 000	4 897	4 897
Reliant Trust, papier commercial, 4,700 %, 11 déc. 2024	6 000	5 874	5 874
Banque Royale du Canada, reçus de dépôt à terme, 4,713 %, 2 juill. 2024	3 100	3 101	3 101
Banque Royale du Canada, acceptations bancaires, 5,000 %, 2 juill. 2024	5 000	4 999	4 999
Banque Royale du Canada, acceptations bancaires, 4,922 %, 22 août 2024	7 500	7 448	7 448
SAFE Trust, papier commercial, 5,153 %, 25 juill. 2024	12 400	12 358	12 358
SAFE Trust, papier commercial, 5,206 %, 2 août 2024	5 000	4 977	4 977
SAFE Trust, papier commercial, 5,176 %, 8 août 2024	5 000	4 973	4 973
SAFE Trust, papier commercial, 5,148 %, 22 août 2024	23 000	22 832	22 832
SAFE Trust, papier commercial, 5,025 %, 15 oct. 2024	24 000	23 651	23 651
SAFE Trust, papier commercial, 5,062 %, 15 oct. 2024	7 400	7 291	7 291
SAFE Trust, papier commercial, 5,036 %, 12 nov. 2024	4 000	3 926	3 926
SOUND Trust, papier commercial, 5,156 %, 25 juill. 2024	15 000	14 949	14 949
SOUND Trust, papier commercial, 5,176 %, 6 août 2024	16 000	15 919	15 919
SOUND Trust, papier commercial, 5,203 %, 6 août 2024	5 000	4 974	4 974
SOUND Trust, papier commercial, 5,176 %, 9 août 2024	8 000	7 956	7 956
SOUND Trust, papier commercial, 5,102 %, 13 sept. 2024	9 000	8 907	8 907
SOUND Trust, papier commercial, 5,056 %, 18 oct. 2024	9 350	9 209	9 209
SOUND Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	8 000	7 874	7 874
SOUND Trust, papier commercial, 5,054 %, 1 ^{er} nov. 2024	10 000	9 830	9 830
SOUND Trust, papier commercial, 5,052 %, 6 nov. 2024	5 000	4 912	4 912
SOUND Trust, papier commercial, 4,949 %, 25 nov. 2024	10 000	9 801	9 801
SOUND Trust, papier commercial, 4,700 %, 13 déc. 2024	4 000	3 915	3 915

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
STABLE Trust, papier commercial, 5,156 %, 25 juill. 2024	10 000	9 966	9 966
STABLE Trust, papier commercial, 5,102 %, 13 sept. 2024	5 000	4 948	4 948
STABLE Trust, papier commercial, 5,082 %, 20 sept. 2024	9 100	8 998	8 998
STABLE Trust, papier commercial, 5,064 %, 10 oct. 2024	5 000	4 930	4 930
STABLE Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	8 000	7 874	7 874
STABLE Trust, papier commercial, 4,704 %, 18 déc. 2024	10 000	9 781	9 781
Storm King Funding, papier commercial, 5,088 %, 15 juill. 2024	6 000	5 988	5 988
Storm King Funding, papier commercial, 5,068 %, 26 sept. 2024	5 000	4 940	4 940
Storm King Funding, papier commercial, 5,082 %, 26 sept. 2024	10 000	9 879	9 879
Storm King Funding, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	5 000	4 934	4 934
Storm King Funding, papier commercial, 5,077 %, 21 oct. 2024	8 200	8 073	8 073
Storm King Funding, papier commercial, 5,054 %, 25 oct. 2024	17 000	16 728	16 728
Storm King Funding, papier commercial, 4,997 %, 21 nov. 2024	14 400	14 119	14 119
SURE Trust, papier commercial, 5,140 %, 23 août 2024	10 800	10 720	10 720
SURE Trust, papier commercial, 5,080 %, 2 oct. 2024	5 000	4 935	4 935
SURE Trust, papier commercial, 5,056 %, 18 oct. 2024	10 700	10 539	10 539
SURE Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	5 000	4 921	4 921
SURE Trust, papier commercial, 5,054 %, 25 oct. 2024	5 200	5 117	5 117
SURE Trust, papier commercial, 4,949 %, 28 nov. 2024	10 000	9 797	9 797
Groupe TMX Limitée, papier commercial, 4,703 %, 15 juill. 2024	25 000	24 955	24 955
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 5,170 %, 29 juill. 2024	4 900	4 881	4 881
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 5,073 %, 19 août 2024	10 000	9 932	9 932
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 5,081 %, 19 août 2024	3 000	2 980	2 980
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,939 %, 16 oct. 2024	5 500	5 421	5 421
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,887 %, 8 nov. 2024	15 000	14 740	14 740
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,884 %, 13 nov. 2024	2 250	2 209	2 209
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,811 %, 18 nov. 2024	5 740	5 634	5 634
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,611 %, 25 nov. 2024	14 000	13 741	13 741
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,827 %, 4 déc. 2024	15 000	14 691	14 691
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,827 %, 18 déc. 2024	10 000	9 776	9 776
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,789 %, 3 janv. 2025	6 085	5 937	5 937
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,796 %, 6 janv. 2025	5 000	4 876	4 876
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,757 %, 29 janv. 2025	5 000	4 862	4 862
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,744 %, 5 févr. 2025	3 000	2 915	2 915
Toyota Crédit Canada Inc., papier commercial, 4,764 %, 19 févr. 2025	10 000	9 697	9 697
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,202 %, 9 juill. 2024	26 700	26 670	26 670
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,192 %, 15 juill. 2024	10 000	9 980	9 980
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,263 %, 29 juill. 2024	20 000	19 919	19 919
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,076 %, 22 août 2024	13 900	13 800	13 800
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,136 %, 26 sept. 2024	20 000	19 756	19 756
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,050 %, 21 oct. 2024	24 800	24 417	24 417
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,005 %, 14 nov. 2024	10 000	9 813	9 813
Total des titres du marché monétaire — 94,1 %		2 444 316	2 444 316
		2 561 676	2 561 676

OBLIGATIONS ET DÉBENTURES

Obligations et débentures de sociétés — 5,0 %

La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, premier rang, non garantis, taux variable, 24 mars 2025	5 000	5 000	5 000
---	-------	-------	-------

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

Au 30 juin 2024 (Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf indication contraire.)

Titres (suite)	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable, 27 juin 2025	5 000	5 000	5 000
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets de dépôt, premier rang, non garantis, taux variable, 27 mars 2025	8 000	8 000	8 000
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets de dépôt, non garantis, 3,300 %, 26 mai 2025	6 000	5 922	5 922
CARDS II Trust, série A, billets, garantis, 2,427 %, 15 nov. 2024	27 000	26 738	26 738
Banque HSBC Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,403 %, 24 mars 2025	5 000	4 956	4 956
John Deere Financial Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,090 %, 17 juill. 2024	4 000	3 993	3 993
Banque Nationale du Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, taux variable, 2 août 2024	12 000	12 000	12 000
Banque Nationale du Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, taux variable, 21 oct. 2024	10 000	10 000	10 000
Banque Royale du Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, taux variable, 27 sept. 2024	5 000	5 000	5 000
Banque Royale du Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, taux variable, 15 nov. 2024	6 000	6 000	6 000
Banque Royale du Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, taux variable, 21 mars 2025	10 000	10 000	10 000
La Banque Toronto-Dominion, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,226 %, 24 juill. 2024	18 000	17 979	17 979
La Banque Toronto-Dominion, billets de dépôt, premier rang, non garantis, taux variable, 18 oct. 2024	10 000	10 000	10 000
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 2,310 %, 23 oct. 2024	6 000	5 950	5 950
		136 538	136 538
Total des obligations et débetures — 5,0 %		136 538	136 538
Total du portefeuille de placements — 99,1 %		2 698 214	2 698 214
Autres actifs, moins les passifs — 0,9 %			25 050
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES — 100,0 %			2 723 264

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

1. Le Portefeuille

Le Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien (le « Portefeuille ») est un fonds commun de placement à capital variable constitué en fiducie selon les lois de la province d'Ontario, régi par une déclaration de fiducie dont la plus récente mise à jour date du 8 juillet 2016. BMO Gestion privée de placements inc. (le « gestionnaire ») est le gestionnaire du Portefeuille. L'adresse du siège social du Portefeuille est le 1 First Canadian Place, 41st Floor, Toronto (Ontario), M5X 1A1.

L'état de la situation financière et les notes annexes de chacun des Portefeuilles sont en date du 30 juin 2024 et du 31 décembre 2023. L'état du résultat global, l'état de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, le tableau des flux de trésorerie et les notes annexes portent sur les périodes closes le 30 juin 2024 et le 30 juin 2023.

La publication de ces états financiers a été autorisée par le conseil d'administration du gestionnaire le 6 août 2024.

Ces états financiers doivent être lus conjointement avec les états financiers annuels au 31 décembre 2023, qui ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière publiées par l'International Accounting Standards Board (les « normes IFRS de comptabilité »).

2. Mode de préparation et de présentation

Ces états financiers non audités ont été préparés conformément aux normes IFRS de comptabilité et à la Norme comptable internationale (IAS) 34, *Information financière intermédiaire*. Les états financiers ont été préparés selon la méthode du coût historique, à l'exception de la réévaluation des actifs financiers et des passifs financiers (y compris des instruments financiers dérivés) mesurés à la juste valeur par le biais du résultat net (JVRN).

3. Informations significatives sur les méthodes comptables

Instruments financiers

Les instruments financiers englobent les actifs financiers et passifs financiers, notamment les actions et les titres de créance, les fonds d'investissement et les instruments dérivés. Ces placements font partie d'un groupe d'instruments financiers gérés conformément à la stratégie de placement du Portefeuille et évalués à la juste valeur.

Le Portefeuille classe et évalue les instruments financiers conformément à IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »). À la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont comptabilisés à la juste valeur. Un instrument financier est comptabilisé lorsque le Portefeuille devient partie aux dispositions contractuelles de l'instrument et décomptabilisé lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie de l'instrument a expiré ou que la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété est transférée par le Portefeuille. Par conséquent, les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de transaction. Les placements et dérivés sont ensuite évalués à la JVRN, et toute variation de la juste valeur est constatée à l'état du résultat global à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente ».

Tous les actifs financiers et passifs financiers sont comptabilisés à l'état de la situation financière.

Les parts rachetables en circulation du Portefeuille, qui sont des instruments remboursables au gré du porteur, ouvrent droit à une obligation contractuelle de distribution annuelle, par le Portefeuille, de tout revenu net et de gains en capital nets réalisés. Cette distribution annuelle peut être versée en espèces au gré du porteur de parts; l'option de rachat permanente n'est donc pas la seule obligation contractuelle relative aux parts rachetables. Par conséquent, les parts du Portefeuille ne répondent pas aux critères de classement à titre de capitaux propres. Les obligations du Portefeuille relatives à l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables (« actif net ») sont donc classées à titre de passifs financiers et sont présentées à la valeur de rachat.

Coût des placements

Le coût des placements correspond à la somme payée pour chaque titre et il est déterminé selon la méthode du coût moyen, mais exclut les commissions et autres coûts de transactions du portefeuille, qui sont présentés séparément à l'état du résultat global. Les gains et les pertes réalisés à la cession sont calculés en fonction du coût des placements.

Évaluation de la juste valeur

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

Les cours de clôture des titres cotés en bourse sont considérés comme étant la juste valeur s'ils s'inscrivent dans l'écart acheteur-vendeur. Lorsque le cours de

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

clôture ne s'inscrit pas dans l'écart acheteur-vendeur, le gestionnaire détermine le point de l'écart acheteur-vendeur qui est le plus représentatif de la juste valeur compte tenu des faits et circonstances en cause.

Des processus sont en place pour évaluer quotidiennement la juste valeur des actions négociées dans les pays hors Amérique du Nord, pour éviter les cours périmés et pour tenir compte, entre autres, des événements importants intervenus après la clôture d'un marché étranger.

La juste valeur des obligations, des débetures, des titres adossés à des créances mobilières, des placements à court terme et des autres titres de créance correspond au dernier cours ou au cours de clôture, ou tout autre cours lorsque ce dernier se situe dans l'écart acheteur-vendeur.

Les parts de fonds communs de placement détenues à titre de placements sont évaluées à leur valeur liquidative à la date d'évaluation (la « date d'évaluation » correspond à chaque jour ouvrable de la Bourse de Toronto), car ces valeurs peuvent être obtenues plus aisément et plus régulièrement.

Le Portefeuille peut conclure, directement ou indirectement, des contrats de change à terme à des fins de couverture ou à des fins autres que de couverture. La juste valeur des contrats de change à terme conclus par le Portefeuille correspond à l'écart entre la juste valeur du contrat à la date d'évaluation et sa valeur d'origine.

Les bons de souscription non cotés, le cas échéant, sont évalués en fonction d'un modèle d'établissement des cours prenant en compte des facteurs comme la valeur de marché du titre sous-jacent, le prix d'exercice et les conditions du bon de souscription.

Lorsque le cours d'un titre ne peut être obtenu, n'est pas fiable ou ne semble pas refléter la valeur actuelle, le gestionnaire peut déterminer une autre valeur qu'il considère comme juste et raisonnable ou recourir à une technique d'évaluation qui, dans toute la mesure du possible, utilise des données d'entrée et des hypothèses fondées sur des données de marché observables, notamment la volatilité, les titres comparables, la valeur liquidative (fonds négociés en bourse) et d'autres taux ou cours pertinents. Ces techniques d'évaluation comprennent l'utilisation de flux de trésorerie actualisés, des modèles internes qui reposent sur des données observables ou des comparaisons avec des titres identiques en substance. Dans certains cas, le

gestionnaire peut avoir recours à des modèles internes lorsque les données d'entrée ne sont pas des données de marché observables.

Trésorerie

La trésorerie se compose de l'encaisse et des dépôts bancaires, y compris les acceptations bancaires et les dépôts à vue. La valeur comptable de la trésorerie correspond approximativement à la juste valeur de par sa nature à court terme.

Autres actifs et autres passifs

Les autres actifs et les autres passifs comprennent généralement les montants à recevoir pour la vente de placements, les souscriptions à recevoir, les intérêts à recevoir, les dividendes à recevoir, les distributions à recevoir des fiducies de placement, les achats de placements à payer, les rachats à payer, les distributions à verser et les charges à payer. Ces actifs financiers et passifs financiers sont, par nature, à court terme et sont évalués au coût amorti, qui se rapproche de leur juste valeur.

Participations dans des filiales, des coentreprises et des entreprises associées

Une filiale est une entité dont le Portefeuille détient le contrôle parce qu'il est exposé ou qu'il a droit à des rendements variables sur son investissement et qu'il a la capacité d'influer sur ces rendements du fait du pouvoir qu'il détient sur l'entité. Le gestionnaire a déterminé que le Portefeuille est une entité d'investissement et, à ce titre, il comptabilise les filiales, le cas échéant, à la juste valeur. Une coentreprise est une entité établie en vertu d'un accord par lequel le Portefeuille exerce un contrôle conjoint avec d'autres actionnaires. Une entreprise associée est une entité pour laquelle le Portefeuille exerce une influence notable sur les décisions liées à l'exploitation, à l'investissement et au financement (le Portefeuille détient entre 20 % et 50 % des actions avec droit de vote de l'entité). Toutes ces entités, le cas échéant, ont été classées comme étant à la JVRN.

Entités structurées non consolidées

Le gestionnaire a déterminé que les fonds d'investissement dans lesquels le Portefeuille peut investir constituent des entités structurées non consolidées, puisque les décisions prises à l'égard de ces titres ne découlent pas d'un droit de vote ou d'un autre droit similaire qu'il pourrait détenir. De façon similaire, les placements dans des instruments titrisés et des titres adossés à des créances mobilières et à des

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

créances hypothécaires sont aussi considérés comme des intérêts dans des entités structurées non consolidées.

Le Portefeuille peut investir dans des fonds d'investissement dont les objectifs de placement consistent à générer un revenu à court et à long terme, ainsi qu'une plus-value du capital. Ces fonds peuvent recourir à l'effet de levier d'une manière conforme à leur objectif de placement et aux exigences des autorités en valeurs mobilières canadiennes. Ils financent leurs activités par l'émission de parts rachetables pouvant être rachetées à la demande du porteur et conférant à celui-ci une quote-part dans l'actif net du fonds. La variation de la juste valeur de chacun des fonds d'investissement au cours des périodes est constatée à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente » à l'état du résultat global.

Les titres adossés à des créances hypothécaires sont créés à partir de portefeuilles de prêts hypothécaires résidentiels ou commerciaux, notamment de prêts hypothécaires accordés par des organismes d'épargne et de crédit, des banques de crédit hypothécaire, des banques commerciales et d'autres institutions. Les titres adossés à des créances mobilières sont créés à partir de divers types d'actifs, dont des prêts automobiles, des créances sur cartes de crédit, des prêts sur la valeur nette du bien foncier et des prêts aux étudiants.

Le Portefeuille ne fournit ni ne s'est engagé à fournir aucun autre soutien financier important ni autre soutien à ces entités structurées non consolidées autre que son placement dans ces dernières.

D'autres informations sur les intérêts du Portefeuille dans des entités structurées non consolidées, le cas échéant, se trouvent à la note 8.

Compensation des actifs financiers et des passifs financiers

Les instruments financiers sont comptabilisés sur la base du solde net ou brut à l'état de la situation financière, selon l'intention et l'obligation juridique de compenser des positions opposées sur des instruments détenus auprès des mêmes contreparties. Les montants qui font l'objet d'une compensation dans l'état de la situation financière découlent de transactions à l'égard desquelles le Portefeuille a un droit juridiquement exécutoire d'opérer compensation et l'intention de procéder au règlement des positions sur la base du solde net. Les montants non compensés dans l'état de la situation financière découlent de positions

pour lesquelles il n'y a aucun droit juridiquement exécutoire d'opérer compensation, ou il y a un droit de compensation seulement en cas de défaillance, d'insolvabilité ou de faillite ou lorsque le Portefeuille n'a pas l'intention de procéder au règlement sur la base du solde net. Le Portefeuille n'était partie à aucune convention cadre de compensation pendant les périodes présentées.

Constatation des revenus

Les revenus de dividendes et les distributions provenant des fiducies de placement sont comptabilisés à la date ex-dividende et à la date ex-distribution, respectivement.

Les revenus d'intérêts provenant des placements portant intérêt sont constatés à l'état du résultat global au moyen de la méthode du taux d'intérêt effectif. Les intérêts à recevoir présentés à l'état de la situation financière sont comptabilisés en fonction des taux d'intérêt nominaux des placements portant intérêt.

Conversion de devises

La juste valeur des placements et des autres actifs et passifs en devises est convertie dans la monnaie fonctionnelle du Portefeuille, au cours du change en vigueur à la fin de la période. Les achats et ventes de placements, ainsi que les revenus et charges, sont convertis au cours de change en vigueur à la date des transactions correspondantes. Les gains (pertes) de change réalisés et latents sur les opérations de placement sont comptabilisés respectivement aux postes « Gain (perte) net réalisé » et « Variation de la plus-value (moins-value) latente » dans l'état du résultat global. Les gains (pertes) de change réalisés et latents se rapportant à la trésorerie, aux créances et aux dettes, s'il y a lieu, figurent au poste « Gain (perte) de change » à l'état du résultat global.

Prêt de titres

Un Portefeuille peut s'engager dans des opérations de prêt de titres aux termes d'un contrat conclu avec BNY Mellon (l'« agent chargé du prêt de titres »). La valeur de marché globale de tous les titres prêtés par le Portefeuille ne peut pas excéder 50 % de sa valeur liquidative. Le Portefeuille reçoit une garantie dont la valeur doit correspondre à au moins 102 % de la valeur des titres prêtés. Cette garantie est généralement constituée d'obligations ou de garanties du gouvernement du Canada ou d'une province canadienne, du gouvernement des États-Unis ou d'un de ses organismes, mais peut aussi comprendre des obligations d'autres gouvernements pourvu que

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

leur notation soit adéquate. De plus, dans le cadre du programme, l'agent chargé du prêt de titres et les parties liées au dépositaire du Portefeuille indemnisent entièrement ce dernier advenant tout défaut d'un emprunteur.

Pour les Portefeuilles participant au programme, la valeur globale des titres prêtés et de la garantie détenue au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, ainsi que l'information sur le revenu du Portefeuille tiré du prêt de titres sont indiquées à la note 8, le cas échéant.

Les revenus provenant du prêt de titres, le cas échéant, sont inclus dans l'état du résultat global et constatés en résultat lorsqu'ils sont gagnés. La répartition du revenu tiré du prêt de titres est présentée à la note 8, le cas échéant.

Pénalité pour négociation à court terme

Pour décourager les opérations de négociation excessives, le Portefeuille peut, à la seule discrétion du gestionnaire, imposer une pénalité pour négociation à court terme. Cette pénalité est versée directement au Portefeuille et est constatée à titre de « Pénalité pour négociation à court terme » à l'état du résultat global.

Augmentation ou diminution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part

L'« Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part », qui figure à l'état du résultat global, représente l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, divisée par le nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période. Se reporter à la note 8 pour plus de renseignements.

Impôts

Le Portefeuille répond à la définition de fiducie d'investissement à participation unitaire au sens de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada). La totalité du revenu net imposable du Portefeuille et une part suffisante des gains en capital nets réalisés pour chaque année d'imposition sont versées aux porteurs de parts à titre de distributions, de manière à ce que le Portefeuille n'ait aucun impôt à payer. Le gestionnaire a donc déterminé, en substance, que le Portefeuille n'était pas imposable. Il ne comptabilise donc aucun impôt à l'état du résultat global ni ne constate d'actif ou de passif d'impôt différé dans l'état de la situation financière.

Le Portefeuille peut être assujéti à des retenues d'impôts sur les revenus d'investissement et les gains en capital dans certains pays. Ces revenus et ces gains en capital sont comptabilisés au montant brut, et les retenues d'impôts s'y rattachant sont présentées à titre de charges distinctes dans l'état du résultat global.

4. Jugements et estimations comptables critiques

La préparation d'états financiers nécessite d'appliquer les méthodes comptables du Portefeuille avec jugement et de faire des estimations et des hypothèses en ce qui a trait à l'avenir. Les sections suivantes présentent les jugements et les estimations comptables les plus importants établis par le gestionnaire lors de la préparation des états financiers du Portefeuille.

Jugements comptables :

Monnaie fonctionnelle et de présentation

Les porteurs de parts du Portefeuille sont principalement des résidents canadiens, et les souscriptions et les rachats de parts rachetables sont libellés en dollars canadiens. Le Portefeuille investit dans des titres libellés en dollars canadiens et américains, et dans d'autres devises, le cas échéant. Le rendement du Portefeuille est évalué et présenté aux investisseurs en dollars canadiens. Le gestionnaire considère le dollar canadien comme la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des transactions, de la conjoncture et des événements sous-jacents. Les états financiers sont présentés en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle et de présentation du Portefeuille.

Classement et évaluation du portefeuille de placements

Pour classer et évaluer les instruments financiers détenus par le Portefeuille, le gestionnaire est tenu d'évaluer le modèle économique que suit le Portefeuille pour la gestion de ses instruments financiers. Le gestionnaire est aussi tenu de poser des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon IFRS 9. Le gestionnaire a évalué le modèle économique du Portefeuille, notamment en ce qui a trait à la gestion de l'ensemble des actifs et passifs financiers et à la méthode d'évaluation de la performance à la juste valeur. Il estime que la comptabilisation à la JVRN conformément à IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour le portefeuille de placements du Portefeuille. La perception du capital et des intérêts est secondaire au modèle économique du Fonds.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Estimations comptables :

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

Le gestionnaire a établi des politiques et des procédures de contrôle afin de s'assurer que ces estimations sont bien contrôlées, sont revues indépendamment et sont appliquées de façon uniforme d'une période à l'autre. Les estimations de la valeur des actifs et des passifs du Portefeuille sont réputées appropriées à la date de présentation de l'information financière.

Le Portefeuille peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs. La note 3 présente les méthodes utilisées pour établir les estimations ayant servi à déterminer la juste valeur.

5. Parts et transactions sur parts

Les parts rachetables du Portefeuille sont classées à titre de passifs financiers. Ces parts sont sans valeur nominale et ouvrent droit à des distributions, le cas échéant, et, au moment du rachat, au remboursement d'une tranche proportionnelle de la valeur liquidative du Portefeuille. Le Portefeuille est tenu de verser des distributions dont le montant doit être suffisant pour qu'il n'ait aucun impôt à payer sur les gains en capital réalisés, les dividendes et les intérêts. À moins d'indication contraire à la note 8, le Portefeuille n'a aucune restriction ni condition précise en matière de capital pour les souscriptions et rachats de parts. Les opérations pertinentes liées aux parts rachetables figurent dans l'état de l'évolution de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables.

Conformément à ses objectifs et stratégies de placement, et aux pratiques de gestion des risques décrites à la note 7, le Portefeuille s'efforce d'investir les souscriptions reçues dans les titres appropriés, tout en maintenant des liquidités suffisantes pour honorer les demandes de rachat, et augmente au besoin ces liquidités en effectuant des emprunts à court terme ou en vendant des placements.

Les parts rachetables du Portefeuille sont offertes en tout temps et peuvent être achetées ou rachetées à la valeur liquidative par part à toute date d'évaluation. Aux fins de souscription ou de rachat, la valeur liquidative par part est calculée en divisant la valeur liquidative du Portefeuille, soit la juste valeur totale des actifs moins les passifs, par le nombre total de parts du Portefeuille en circulation à chaque date d'évaluation, conformément à la partie 14 du *Règlement 81-106 sur l'information continue des fonds d'investissement*, aux fins de traitement des transactions sur parts. L'actif

net est déterminé conformément aux normes IFRS de comptabilité et peut différer de la valeur liquidative du Portefeuille. Si tel est le cas, un rapprochement est présenté à la note 8.

6. Opérations avec des parties liées

a) Frais de gestion

Le gestionnaire est responsable de la gestion courante du Portefeuille, notamment la gestion du portefeuille de placements, de même que la prestation de services d'administration, tels que les services d'évaluation, la comptabilité et la tenue des registres des porteurs de parts. Il peut assurer lui-même ces services ou conclure des ententes avec des tiers à cet égard. Le gestionnaire ne touche aucune rémunération du Portefeuille pour ses services. Les porteurs de parts paient plutôt des frais de gestion de placements directement à la Société de fiducie BMO et au gestionnaire, comme convenu par les porteurs de parts, la Société de fiducie BMO et le gestionnaire.

b) Frais de service aux porteurs de parts, honoraires de sous-conseillers et autres coûts de transactions du portefeuille

Des membres du groupe du gestionnaire fournissent des services au Portefeuille. Les charges engagées pour l'administration du Portefeuille ont été payées à la Société de fiducie BMO (le « fiduciaire ») et à BMO Gestion d'actifs inc. (l'« agent chargé de la tenue des registres ») et ont été facturées au Portefeuille. Ces frais sont inclus dans le poste « Frais de service aux porteurs de parts » à l'état du résultat global.

Les sous-conseillers (y compris les membres du groupe du gestionnaire, le cas échéant) embauchés par le gestionnaire offrent des conseils et prennent des décisions en matière de placement pour le portefeuille de placements du Portefeuille. Pour ces services, les sous-conseillers sont rémunérés mensuellement par le gestionnaire au nom du Portefeuille. Ces honoraires sont inclus dans le poste « Honoraires de sous-conseillers » à l'état du résultat global. Les honoraires des sous-conseillers inférieurs ou correspondants à 0,15 % de la valeur liquidative du Portefeuille sont absorbés par le gestionnaire.

c) Charges du portefeuille

De plus, le Portefeuille paie directement certaines charges d'exploitation, notamment la rémunération et les dépenses des membres du comité d'examen indépendant (CEI) et celles de tout conseiller juridique indépendant ou d'autres conseillers employés par

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

le CEI, les coûts des programmes d'orientation et de formation continue des membres du CEI et les coûts et dépenses associés aux réunions du CEI.

d) Commissions et autres coûts de transactions du portefeuille

Le Portefeuille peut exécuter des opérations avec BMO Nesbitt Burns Inc., membre du groupe du gestionnaire, ou par l'entremise de celui-ci, dans le cadre d'ententes de courtage standard et aux prix du marché. Les frais sont inclus dans le poste « Commissions et autres coûts de transactions du portefeuille » à l'état du résultat global. Se reporter à la note 8 pour connaître les frais relatifs aux parties liées imputés au Portefeuille pendant les périodes closes les 30 juin 2024 et 30 juin 2023.

e) Autres opérations avec des parties liées

De temps à autre, le gestionnaire peut conclure, au nom du Portefeuille, des transactions ou des accords avec ou mettant en cause des filiales ou des membres du groupe de la Banque de Montréal ou certaines autres personnes ou sociétés apparentées ou liées au gestionnaire. Il peut s'agir notamment de transactions ou d'accords avec ou mettant en cause des filiales et des membres du groupe de Banque de Montréal, y compris, sans s'y limiter, BMO Asset Management Corp., BMO Gestion d'actifs inc., BMO Investissements Inc., BMO Ligne d'action Inc., BMO Nesbitt Burns Inc., Société de fiducie BMO ou d'autres fonds d'investissement offerts par des membres du groupe de la Banque de Montréal, et qui peuvent porter sur l'achat ou la vente de titres auprès ou par l'entremise des filiales ou des membres du groupe de la Banque de Montréal, l'achat ou la vente de titres émis ou garantis par des filiales ou des membres du groupe de la Banque de Montréal, la conclusion d'instruments dérivés dont la contrepartie est une filiale ou un membre du groupe de la Banque de Montréal, l'achat ou le rachat de parts ou d'actions d'autres fonds d'investissement offerts par des membres du groupe de la Banque de Montréal ou la prestation de services au gestionnaire.

7. Risques liés aux instruments financiers

En raison de ses activités, le Portefeuille est exposé à divers risques associés aux instruments financiers, à savoir le risque de marché (y compris le risque de change, le risque de taux d'intérêt et l'autre risque de marché), le risque de crédit et le risque de liquidité. Dans le tableau relatif à la concentration, les titres sont classés selon la catégorie d'actif, la région géographique et le segment de marché. Le processus de gestion des

risques du Portefeuille décrit les moyens utilisés pour assurer la conformité aux directives en matière de placement.

Le gestionnaire gère les effets potentiels de ces risques financiers sur le rendement du Portefeuille en employant et en supervisant des gestionnaires de portefeuille professionnels et expérimentés qui surveillent régulièrement les positions du Portefeuille et l'évolution du marché, et qui assurent la diversification des portefeuilles de placements dans les limites des directives de placement.

Lorsque le Portefeuille investit dans d'autres fonds d'investissement, il peut être indirectement exposé aux risques liés aux instruments financiers de ce ou ces fonds d'investissement, selon leurs objectifs de placement et le type de titres qu'ils détiennent. La décision d'acheter ou de vendre un fonds d'investissement est fondée sur les directives de placement et les positions, plutôt que sur le risque inhérent aux fonds d'investissement.

a) Risque de change

Le risque de change s'entend du risque que la juste valeur des instruments financiers libellés en monnaies autres que la monnaie fonctionnelle du Portefeuille varie en raison des fluctuations des cours de change. Les placements sur les marchés étrangers sont exposés au risque de change, car les prix libellés en devises sont convertis dans la monnaie fonctionnelle du Portefeuille au moment de l'établissement de la juste valeur. Le Portefeuille peut conclure des contrats de change à terme à des fins de couverture pour réduire son exposition au risque de change ou pour s'exposer à des devises. Selon IFRS 7, l'exposition au risque de change découlant des actifs et passifs non monétaires est une composante du risque de prix et non du risque de change. Toutefois, le gestionnaire surveille le risque lié à tous les actifs et passifs financiers libellés en devises. L'exposition du Portefeuille au risque de change, le cas échéant, est présentée de façon plus détaillée à la note 8.

b) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt s'entend du risque que la juste valeur des placements du Portefeuille portant intérêt fluctue en raison des variations des taux d'intérêt du marché. Le Portefeuille est principalement exposé au risque de taux d'intérêt du fait de ses placements dans des titres de créance (comme les obligations, les titres du marché monétaire, les placements à court terme et les débentures) et dans des

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

instruments dérivés de taux d'intérêt, le cas échéant. Les autres actifs et passifs sont par nature à court terme ou ne portent pas intérêt. L'exposition du Portefeuille au risque de taux d'intérêt, le cas échéant, est présentée de façon plus détaillée à la note 8.

c) Autre risque de marché

L'autre risque de marché s'entend du risque que la juste valeur d'un instrument financier fluctue en raison des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou de change), que ces variations soient causées par des facteurs propres à l'instrument financier ou à son émetteur, ou par des facteurs touchant tous les instruments financiers similaires négociés sur un marché. Les autres actifs et passifs sont des éléments monétaires à court terme par nature et ne sont donc pas soumis à l'autre risque de marché. L'exposition du Portefeuille à l'autre risque de marché, le cas échéant, est présentée de façon plus détaillée à la note 8.

d) Risque de crédit

Le risque de crédit s'entend du risque qu'une perte puisse survenir si l'émetteur d'un titre ou la contrepartie à un instrument financier ne réussit pas à s'acquitter de ses obligations financières. La juste valeur des titres de créance prend en compte la solvabilité de l'émetteur. L'exposition au risque de crédit pour les instruments dérivés négociés hors cote correspond au gain latent du Portefeuille sur les obligations contractuelles conclues avec la contrepartie à la date de présentation de l'information financière. L'exposition au risque de crédit des autres actifs correspond à leur valeur comptable. L'exposition du Portefeuille au risque de crédit, le cas échéant, est présentée de façon plus détaillée à la note 8.

Le Portefeuille peut conclure des opérations de prêt de titres avec des contreparties autorisées. Le risque de crédit associé à ces opérations est minime étant donné que toutes les contreparties ont une notation approuvée suffisante et que la valeur de marché de la garantie détenue par le Portefeuille doit correspondre à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés, comme il est indiqué à la note 8, s'il y a lieu.

e) Risque de liquidité

Le risque de liquidité du Portefeuille se trouve principalement dans les rachats de parts quotidiens en trésorerie et dans les autres passifs. Le Portefeuille investit principalement dans des titres négociés sur des marchés actifs et cessibles facilement. En outre, il conserve suffisamment de positions en trésorerie

pour maintenir son niveau de liquidité. Le Portefeuille peut, de temps à autre, conclure des contrats de dérivés négociés hors cote ou investir dans des titres non cotés, qui ne sont pas négociés sur un marché organisé et peuvent être non liquides. Les titres pour lesquels une cotation n'a pu être obtenue et qui peuvent être non liquides sont indiqués dans l'inventaire du portefeuille. Le gestionnaire surveille la proportion de titres non liquides par rapport à la valeur liquidative du Portefeuille afin de s'assurer que cette proportion ne dépasse pas le plafond réglementaire et qu'elle n'a aucune incidence importante sur la liquidité nécessaire pour faire face aux obligations financières du Portefeuille.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

8. Information spécifique au Portefeuille

a) Information sur le Portefeuille et évolution des parts

Le Portefeuille est entré en activité le 15 mai 1997.

Le nombre de parts émises et en circulation est présenté dans le tableau ci-après.

Périodes closes les (en milliers de parts)	30 juin 2024	30 juin 2023
Parts émises et en circulation à l'ouverture de la période	226 262	208 405
Émises contre trésorerie	388 201	240 340
Émises au réinvestissement de distributions	5 426	3 927
Rachetées durant la période	(347 563)	(262 439)
Parts émises et en circulation à la clôture de la période	272 326	190 233

b) Rapprochement de la valeur liquidative et de l'actif net

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, il n'y avait aucun écart entre la valeur liquidative par part du Portefeuille et son actif net par part calculé conformément aux normes IFRS de comptabilité.

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

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part, au 30 juin 2024 et au 30 juin 2023, se calcule comme suit :

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	60 598	44 647
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période (en milliers de parts)	236 578	189 811
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part	0,26	0,24

d) Impôts sur le revenu

À la fin de l'année d'imposition terminée le 31 décembre 2023, il n'y avait aucun report de perte en capital ou de perte autre qu'en capital.

e) Opérations avec des parties liées

Services aux porteurs de parts

Les frais à payer aux parties liées pour les services aux porteurs de parts sont les suivants :

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Services aux porteurs de parts (\$)	171	168

Commissions de courtage et accords de paiement indirect

Aucune commission de courtage n'a été imputée au Portefeuille au cours des périodes closes les 30 juin 2024 et 30 juin 2023.

f) Risques liés aux instruments financiers

L'objectif du Portefeuille consiste à assurer la liquidité et un niveau élevé de revenu d'intérêts et à préserver le capital investi. Le Portefeuille investit surtout dans des titres de créance à court terme de grande qualité et à faible risque émis par des autorités gouvernementales et des sociétés canadiennes, comme les bons du Trésor, les acceptations bancaires, les obligations, les titres adossés à des créances mobilières et le papier commercial.

Aucun changement ayant une incidence sur le niveau de risque global lié à un placement dans le Portefeuille n'a eu lieu au cours de la période.

Risque de change

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Portefeuille n'était pas exposé au risque de change, car il était pleinement investi dans des titres canadiens.

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2024, 99,1 % (99,9 % au 31 décembre 2023) de l'actif net du Portefeuille était investi dans des titres de créance dont le terme à courir ou la date de rajustement du taux était à moins d'un an. Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, la sensibilité du Portefeuille au risque de taux d'intérêt, établie d'après la durée pondérée du portefeuille, n'était pas significative.

Autre risque de marché

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, le Portefeuille était peu exposé à l'autre risque de marché, car il était pleinement investi dans des titres à revenu fixe.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Risque de crédit

Le tableau ci-après résume l'exposition du Portefeuille au risque de crédit selon les notations.

Notation	% de l'actif net aux	
	30 juin 2024	31 déc. 2023
R-1 Élevé	42,8	52,5
R-1 Moyen	24,4	16,6
R-1 Faible	26,9	28,1
AAA	4,7	2,7
AA	0,2	—
A	0,1	—
Total	99,1	99,9

Prêt de titres

Aucun actif ne faisait l'objet d'une opération de prêt de titres au 30 juin 2024 ni au 31 décembre 2023.

Le tableau ci-après présente un rapprochement entre le montant brut généré par les opérations de prêt de titres et le revenu tiré de ces opérations pour les périodes closes le 30 juin 2024 et le 30 juin 2023 :

Périodes closes les	30 juin 2024		30 juin 2023	
	Montant	% du revenu brut tiré du prêt de titres	Montant	% du revenu brut tiré du prêt de titres
Revenu brut tiré du prêt de titres	0	100,0	4	100,0
Retenues d'impôts	—	—	—	—
	0	100,0	4	100,0
Paiement aux agents chargés du prêt de titres	0	30,0	1	30,0
Revenu net tiré du prêt de titres	0	70,0	3	70,0

Risque de concentration

Le risque de concentration du Portefeuille est résumé dans le tableau ci-après.

Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023
Titres du marché monétaire		
Provincial	1,5 %	0,4 %
Municipal	2,8 %	5,5 %
Sociétés	89,8 %	91,3 %
Obligations et débetures		
Obligations et débetures de sociétés	5,0 %	2,3 %
Titres adossés à des créances mobilières	— %	0,4 %
Autres actifs, moins les passifs	0,9 %	0,1 %
	100,0 %	100,0 %

g) Hiérarchie des justes valeurs

Le Portefeuille classe ses instruments financiers en trois niveaux fondés sur les données utilisées pour les évaluer. Les titres de niveau 1 sont évalués selon les prix cotés sur les marchés actifs pour des titres identiques. Les titres de niveau 2 sont évalués selon les données observables importantes sur le marché, comme les prix cotés de titres similaires et les prix cotés sur les marchés non actifs, ou selon les données observables entrant dans les modèles. Les titres de niveau 3 sont évalués selon des données non observables importantes, fondées sur des hypothèses établies par le gestionnaire en fonction de ce que les intervenants du marché pourraient raisonnablement utiliser dans le cadre de l'évaluation des titres. Les tableaux ci-après fournissent l'information pertinente.

Au 30 juin 2024

Actifs financiers	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Titres de créance	—	2 698 215	—	2 698 215

Au 31 déc. 2023

Actifs financiers	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Titres de créance	—	2 259 661	—	2 259 661

Transferts entre les niveaux

Aucun transfert n'a eu lieu entre les niveaux durant les périodes.

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

h) Entités structurées non consolidées

L'information sur la valeur comptable et la taille des investissements dans des entités structurées est présentée dans le tableau ci-après :

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
Banner Trust, papier commercial, 5,400 %, 25 janv. 2024	—	8 968	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,350 %, 8 avr. 2024	—	6 899
Banner Trust, papier commercial, 5,401 %, 4 mars 2024	—	11 715	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,315 %, 19 avr. 2024	—	9 841
Banner Trust, papier commercial, 5,363 %, 6 mars 2024	—	19 809	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,284 %, 31 juill. 2024	21 905	—
Banner Trust, papier commercial, 5,477 %, 2 avr. 2024	—	4 931	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,060 %, 2 août 2024	34 845	—
Banner Trust, papier commercial, 5,148 %, 4 sept. 2024	11 519	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,310 %, 6 août 2024	23 875	—
Banner Trust, papier commercial, 5,136 %, 20 sept. 2024	19 773	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,311 %, 6 août 2024	3 730	—
Banner Trust, papier commercial, 4,806 %, 24 sept. 2024	4 648	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,076 %, 19 août 2024	9 932	—
Banner Trust, papier commercial, 5,082 %, 2 oct. 2024	4 935	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,168 %, 28 août 2024	3 967	—
Banner Trust, papier commercial, 4,911 %, 4 nov. 2024	9 831	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,169 %, 28 août 2024	1 984	—
Banner Trust, papier commercial, 4,892 %, 3 déc. 2024	5 876	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,043 %, 16 sept. 2024	2 464	—
Banner Trust, papier commercial, 4,680 %, 6 déc. 2024	9 798	—	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 8 oct. 2024	2 959	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,289 %, 3 janv. 2024	—	14 996	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 12 nov. 2024	5 398	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,304 %, 3 janv. 2024	—	18 195	Bay Street Funding Trust, papier commercial, 4,721 %, 11 déc. 2024	9 790	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,332 %, 3 janv. 2024	—	5 998	BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,022 %, 2 juill. 2024	29 996	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,329 %, 10 janv. 2024	—	8 988	BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,806 %, 4 juill. 2024	9 996	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,349 %, 1 ^{er} févr. 2024	—	14 932	BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,797 %, 8 juill. 2024	9 991	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,347 %, 5 févr. 2024	—	24 474	BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,772 %, 10 juill. 2024	9 988	—
Bay Street Funding Trust, papier commercial, 5,258 %, 28 févr. 2024	—	4 958	BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,771 %, 15 juill. 2024	23 956	—
			BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,030 %, 17 juill. 2024	16 963	—
			BCI QuadReal Realty, papier commercial, 5,004 %, 22 juill. 2024	19 943	—

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,769 %, 23 juill. 2024	9 971	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,169 %, 5 sept. 2024	18 033	—
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,783 %, 23 juill. 2024	7 977	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,150 %, 9 sept. 2024	11 074	—
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,752 %, 21 août 2024	19 868	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,143 %, 1 ^{er} oct. 2024	7 797	—
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,734 %, 23 août 2024	9 931	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,089 %, 18 oct. 2024	3 324	—
BCI QuadReal Realty, papier commercial, 4,718 %, 26 sept. 2024	9 295	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,119 %, 18 oct. 2024	5 173	—
CARDS II Trust, série A, billets, garantis, 2,427 %, 15 nov. 2024	26 738	—	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,008 %, 1 ^{er} nov. 2024	14 391	—
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,328 %, 5 janv. 2024	—	15 263	Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,007 %, 4 nov. 2024	9 424	—
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,327 %, 8 janv. 2024	—	11 988	Glacier Credit Card Trust, série 2019-1, billets adossés à des créances sur cartes de crédit, premier rang, 2,280 %, 6 juin 2024	—	9 861
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,388 %, 23 janv. 2024	—	4 984	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,332 %, 3 janv. 2024	—	22 993
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,319 %, 1 ^{er} févr. 2024	—	14 181	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,288 %, 5 janv. 2024	—	4 997
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,421 %, 2 févr. 2024	—	8 542	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,347 %, 19 janv. 2024	—	9 974
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,316 %, 12 févr. 2024	—	5 039	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,366 %, 7 févr. 2024	—	4 973
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,280 %, 5 mars 2024	—	9 637	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,402 %, 8 févr. 2024	—	9 944
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,402 %, 22 mars 2024	—	5 414	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,320 %, 28 févr. 2024	—	4 958
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,382 %, 1 ^{er} avr. 2024	—	6 008	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,278 %, 4 mars 2024	—	4 954
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,369 %, 9 avr. 2024	—	5 856	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,421 %, 4 mars 2024	—	12 878
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,283 %, 25 juill. 2024	1 185	—	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,384 %, 13 mars 2024	—	6 926
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,226 %, 6 août 2024	11 064	—	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,352 %, 4 avr. 2024	—	5 819
Glacier Credit Card Trust, papier commercial, 5,169 %, 22 août 2024	5 581	—	King Street Funding Trust, papier commercial, 5,350 %, 8 avr. 2024	—	14 784

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,352 %, 12 avr. 2024	—	10 343	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,375 %, 24 janv. 2024	—	9 966
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,291 %, 7 août 2024	4 973	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,403 %, 1 ^{er} mars 2024	—	9 316
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,291 %, 8 août 2024	9 945	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,401 %, 4 mars 2024	—	4 953
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,012 %, 23 août 2024	4 964	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,304 %, 1 ^{er} avr. 2024	—	7 105
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,168 %, 28 août 2024	7 934	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,301 %, 15 avr. 2024	—	5 908
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,062 %, 10 sept. 2024	4 258	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,283 %, 29 avr. 2024	—	2 260
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,042 %, 13 sept. 2024	6 929	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,106 %, 13 août 2024	6 759	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,092 %, 2 oct. 2024	19 741	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,196 %, 27 août 2024	4 662	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,037 %, 4 oct. 2024	4 935	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,175 %, 3 sept. 2024	8 225	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,082 %, 4 oct. 2024	5 822	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,074 %, 4 sept. 2024	9 315	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,107 %, 4 oct. 2024	17 761	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,082 %, 23 sept. 2024	3 953	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,054 %, 8 oct. 2024	11 343	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,082 %, 1 ^{er} oct. 2024	12 143	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,057 %, 8 oct. 2024	6 411	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 5,023 %, 14 nov. 2024	4 632	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,041 %, 15 oct. 2024	9 854	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 4,748 %, 20 nov. 2024	4 908	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,064 %, 16 oct. 2024	4 926	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 4,720 %, 10 déc. 2024	4 896	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,064 %, 17 oct. 2024	10 836	—	Lakeshore Trust, papier commercial, 4,702 %, 6 janv. 2025	9 757	—
King Street Funding Trust, papier commercial, 5,062 %, 30 oct. 2024	9 833	—	Merit Trust, papier commercial, 5,400 %, 25 janv. 2024	—	7 523
King Street Funding Trust, papier commercial, 4,720 %, 16 déc. 2024	4 892	—	Merit Trust, papier commercial, 5,421 %, 9 févr. 2024	—	2 983
Lakeshore Trust, papier commercial, 5,268 %, 2 janv. 2024	—	8 929	Merit Trust, papier commercial, 5,333 %, 21 mars 2024	—	7 808

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
Merit Trust, papier commercial, 5,285 %, 16 avr. 2024	—	9 846	Plaza Trust, papier commercial, 5,387 %, 22 juill. 2024	4 785	—
Merit Trust, papier commercial, 5,285 %, 22 avr. 2024	—	4 919	Plaza Trust, papier commercial, 5,106 %, 13 août 2024	9 940	—
Merit Trust, papier commercial, 5,202 %, 9 juill. 2024	2 997	—	Plaza Trust, papier commercial, 5,103 %, 20 août 2024	5 064	—
Merit Trust, papier commercial, 5,072 %, 16 oct. 2024	7 881	—	Plaza Trust, papier commercial, 5,076 %, 22 août 2024	3 971	—
Merit Trust, papier commercial, 5,062 %, 22 oct. 2024	4 922	—	Plaza Trust, papier commercial, 5,082 %, 26 sept. 2024	5 335	—
Ontario Teachers' Finance Trust, papier commercial, 5,118 %, 22 avr. 2024	—	12 796	Plaza Trust, papier commercial, 5,066 %, 1 ^{er} oct. 2024	5 924	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,331 %, 8 janv. 2024	—	5 494	Plaza Trust, papier commercial, 5,120 %, 3 oct. 2024	5 526	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,353 %, 10 janv. 2024	—	10 886	Plaza Trust, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	8 881	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,353 %, 18 janv. 2024	—	15 960	Plaza Trust, papier commercial, 5,092 %, 15 oct. 2024	6 306	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,349 %, 19 janv. 2024	—	6 483	Plaza Trust, papier commercial, 4,784 %, 21 oct. 2024	5 321	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,375 %, 19 janv. 2024	—	17 952	Plaza Trust, papier commercial, 5,027 %, 7 nov. 2024	11 689	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,249 %, 5 mars 2024	—	4 954	Plaza Trust, papier commercial, 5,044 %, 13 nov. 2024	3 926	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,249 %, 28 mars 2024	—	5 135	Plaza Trust, papier commercial, 4,987 %, 26 nov. 2024	9 798	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,303 %, 5 avr. 2024	—	8 876	Prime Trust, papier commercial, 5,372 %, 18 janv. 2024	—	13 965
Plaza Trust, papier commercial, 5,227 %, 15 avr. 2024	—	9 850	Prime Trust, papier commercial, 5,400 %, 26 janv. 2024	—	2 989
Plaza Trust, papier commercial, 5,276 %, 18 avr. 2024	—	4 725	Prime Trust, papier commercial, 5,324 %, 4 avr. 2024	—	4 438
Plaza Trust, papier commercial, 5,263 %, 22 avr. 2024	—	4 919	Prime Trust, papier commercial, 5,284 %, 29 avr. 2024	—	4 914
Plaza Trust, papier commercial, 5,351 %, 2 mai 2024	—	9 821	Prime Trust, papier commercial, 5,148 %, 4 sept. 2024	9 909	—
Plaza Trust, papier commercial, 5,372 %, 22 juill. 2024	—	4 657	Prime Trust, papier commercial, 5,063 %, 15 oct. 2024	9 853	—

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
Prime Trust, papier commercial, 5,050 %, 21 oct. 2024	6 892	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,287 %, 21 mars 2024	—	23 722
Prime Trust, papier commercial, 5,006 %, 20 nov. 2024	9 806	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,264 %, 15 avr. 2024	—	9 849
Prime Trust, papier commercial, 4,977 %, 27 nov. 2024	4 899	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,153 %, 25 juill. 2024	12 358	—
Prime Trust, papier commercial, 4,700 %, 11 déc. 2024	4 895	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,206 %, 2 août 2024	4 977	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,375 %, 25 janv. 2024	—	2 989	SAFE Trust, papier commercial, 5,176 %, 8 août 2024	4 973	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,303 %, 5 avr. 2024	—	4 931	SAFE Trust, papier commercial, 5,148 %, 22 août 2024	22 832	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,351 %, 2 mai 2024	—	9 821	SAFE Trust, papier commercial, 5,025 %, 15 oct. 2024	23 651	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,278 %, 12 juill. 2024	9 984	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,062 %, 15 oct. 2024	7 291	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,178 %, 29 août 2024	4 958	—	SAFE Trust, papier commercial, 5,036 %, 12 nov. 2024	3 926	—
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,120 %, 9 sept. 2024	3 961	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,328 %, 23 janv. 2024	—	7 974
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	2 368	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,325 %, 5 févr. 2024	—	15 918
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,077 %, 21 oct. 2024	3 938	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,373 %, 8 févr. 2024	—	4 972
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,067 %, 22 nov. 2024	5 488	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,298 %, 15 févr. 2024	—	14 902
Pure Grove Funding, papier commercial, 5,068 %, 22 nov. 2024	1 960	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,360 %, 12 mars 2024	—	14 200
Pure Grove Funding, papier commercial, 4,987 %, 27 nov. 2024	5 437	—	SOUND Trust, papier commercial, 5,156 %, 25 juill. 2024	14 949	—
Reliant Trust, papier commercial, 5,403 %, 2 févr. 2024	—	4 976	SOUND Trust, papier commercial, 5,176 %, 6 août 2024	15 919	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,326 %, 7 févr. 2024	—	4 973	SOUND Trust, papier commercial, 5,203 %, 6 août 2024	4 974	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,304 %, 13 févr. 2024	—	12 322	SOUND Trust, papier commercial, 5,176 %, 9 août 2024	7 956	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,281 %, 21 févr. 2024	—	22 830	SOUND Trust, papier commercial, 5,102 %, 13 sept. 2024	8 907	—

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		Aux	Valeur comptable	
	30 juin 2024	31 déc. 2023		30 juin 2024	31 déc. 2023
SOUND Trust, papier commercial, 5,056 %, 18 oct. 2024	9 209	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,373 %, 22 janv. 2024	—	13 558
SOUND Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	7 874	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,253 %, 18 mars 2024	—	4 945
SOUND Trust, papier commercial, 5,054 %, 1 ^{er} nov. 2024	9 830	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,258 %, 28 mars 2024	—	9 578
SOUND Trust, papier commercial, 5,052 %, 6 nov. 2024	4 912	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,303 %, 5 avr. 2024	—	4 931
SOUND Trust, papier commercial, 4,949 %, 25 nov. 2024	9 801	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,284 %, 29 avr. 2024	—	4 914
SOUND Trust, papier commercial, 4,700 %, 13 déc. 2024	3 915	—	Storm King Funding, papier commercial, 5,088 %, 15 juill. 2024	5 988	—
STABLE Trust, papier commercial, 5,275 %, 8 janv. 2024	—	4 995	Storm King Funding, papier commercial, 5,068 %, 26 sept. 2024	4 940	—
STABLE Trust, papier commercial, 5,308 %, 17 janv. 2024	—	6 036	Storm King Funding, papier commercial, 5,082 %, 26 sept. 2024	9 879	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,185 %, 22 janv. 2024	—	9 970	Storm King Funding, papier commercial, 5,074 %, 4 oct. 2024	4 934	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,298 %, 15 févr. 2024	—	9 935	Storm King Funding, papier commercial, 5,077 %, 21 oct. 2024	8 073	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,259 %, 15 mars 2024	—	4 947	Storm King Funding, papier commercial, 5,054 %, 25 oct. 2024	16 728	—
SAFE Trust, papier commercial, 5,298 %, 22 mars 2024	—	8 993	Storm King Funding, papier commercial, 4,997 %, 21 nov. 2024	14 119	—
STABLE Trust, papier commercial, 5,156 %, 25 juill. 2024	9 966	—	SURE Trust, papier commercial, 5,304 %, 22 janv. 2024	—	4 985
STABLE Trust, papier commercial, 5,102 %, 13 sept. 2024	4 948	—	SURE Trust, papier commercial, 5,323 %, 24 janv. 2024	—	19 933
STABLE Trust, papier commercial, 5,082 %, 20 sept. 2024	8 998	—	SURE Trust, papier commercial, 5,279 %, 23 févr. 2024	—	9 923
STABLE Trust, papier commercial, 5,064 %, 10 oct. 2024	4 930	—	SURE Trust, papier commercial, 5,360 %, 12 mars 2024	—	10 588
STABLE Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	7 874	—	SURE Trust, papier commercial, 5,296 %, 1 ^{er} avr. 2024	—	5 427
STABLE Trust, papier commercial, 4,704 %, 18 déc. 2024	9 781	—	SURE Trust, papier commercial, 5,140 %, 23 août 2024	10 720	—
Storm King Funding, papier commercial, 5,349 %, 19 janv. 2024	—	17 953	SURE Trust, papier commercial, 5,080 %, 2 oct. 2024	4 935	—

Portefeuille BMO privé du marché monétaire canadien

(non audité)

Notes annexes (suite)

(Tous les montants sont en milliers de dollars canadiens, sauf les montants par part.)

30 juin 2024

Aux	Valeur comptable		
	30 juin 2024	31 déc. 2023	
SURE Trust, papier commercial, 5,056 %, 18 oct. 2024	10 539	—	La valeur comptable des titres adossés à des créances hypothécaires et d'autres créances mobilières est comptabilisée à titre de « Placements – Actifs financiers non dérivés » à l'état de la situation financière. Ce montant représente également l'exposition maximale à des pertes à ce jour.
SURE Trust, papier commercial, 5,054 %, 23 oct. 2024	4 921	—	
SURE Trust, papier commercial, 5,054 %, 25 oct. 2024	5 117	—	La variation de la juste valeur des titres adossés à des créances hypothécaires et d'autres créances mobilières est constatée à titre de « Variation de la plus-value (moins-value) latente » à l'état du résultat global.
SURE Trust, papier commercial, 4,949 %, 28 nov. 2024	9 797	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,401 %, 29 janv. 2024	—	19 917	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,421 %, 9 févr. 2024	—	26 595	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,430 %, 15 févr. 2024	—	9 933	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,428 %, 26 févr. 2024	—	19 833	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,333 %, 21 mars 2024	—	24 510	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,285 %, 22 avr. 2024	—	13 675	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,202 %, 9 juill. 2024	26 670	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,192 %, 15 juill. 2024	9 980	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,263 %, 29 juill. 2024	19 919	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,076 %, 22 août 2024	13 800	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,136 %, 26 sept. 2024	19 756	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,050 %, 21 oct. 2024	24 417	—	
Zeus Receivables Trust, papier commercial, 5,005 %, 14 nov. 2024	9 814	—	
Total	1 339 906	1 015 803	

Gestionnaire

BMO Gestion privée
de placements inc.
1 First Canadian Place
100 King Street West, 41st Floor
Toronto (Ontario) M5X 1A1

Fiduciaire

Société de fiducie BMO
1 First Canadian Place
100 King Street West, 41st Floor
Toronto (Ontario) M5X 1A1

Auditeur indépendant

PricewaterhouseCoopers s.r.l./s.e.n.c.r.l.
PwC Tower
18 York Street, Suite 2600
Toronto (Ontario) M5J 0B2

BMO Gestion privée est le nom de marque du groupe d'exploitation qui comprend la Banque de Montréal et certaines de ses sociétés affiliées qui offre des produits et des services de gestion privée. Les produits et les services ne sont pas tous offerts par toutes les entités juridiques au sein de BMO Gestion privée. Les services bancaires sont offerts par l'entremise de la Banque de Montréal. Les services de gestion de placements, de planification de patrimoine, de planification fiscale et de planification philanthropique sont offerts par BMO Nesbitt Burns Inc. et BMO Gestion privée de placements inc. Les services de garde de valeurs ainsi que les services successoraux et fiduciaires sont offerts par la Société de fiducie BMO. Les entités juridiques de BMO Gestion privée n'offrent pas de conseils fiscaux.

^{MD} Marque de commerce déposée de la Banque de Montréal, utilisée sous licence.

www.bmo.com/gestionprivee

Pour plus de renseignements, veuillez téléphoner au 1 855 852-1026



Gestion privée