

États financiers semestriels

Portefeuilles BMO privé

30 juin 2024

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes)

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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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	28 606	31 221
Placements		
Actifs financiers non dérivés	5 215 433	4 839 057
Montant à recevoir pour la vente de placements	5 843	—
Souscriptions à recevoir	2 594	1 741
Intérêts à recevoir	38 282	22 120
Distributions à recevoir des fiducies de placement	—	1 312
Total de l'actif	5 290 758	4 895 451
Passif		
Passif courant		
Swaps à payer	121	—
Passifs dérivés	8 432	—
Achats de placements à payer	28 213	—
Marge à payer sur contrats à terme normalisés	3 847	—
Rachats à payer	5 076	3 469
Distributions à payer	739	—
Charges à payer	151	13
Total du passif	46 579	3 482
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	5 244 179	4 891 969
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part	10,24 \$	10,31 \$

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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	103 734	50 373
Distributions provenant des fiducies de placement	—	14 963
Perte sur les dérivés	(6 193)	—
Autres variations de la juste valeur des placements et dérivés		
Perte nette réalisée	(15 178)	(29 320)
Variation de la (moins-value) plus-value latente	(31 221)	22 515
Gain net sur la juste valeur des placements et dérivés	51 142	58 531
Prêt de titres (note 8)	207	235
Gain de change	340	0
Total des autres revenus	547	235
Total des revenus	51 689	58 766
Charges		
Honoraires de sous-conseillers	2 750	2 696
Honoraires d'audit	10	5
Frais du comité d'examen indépendant	3	3
Retenues d'impôts	6	1
Droits de garde	29	22
Frais d'intérêts	41	0
Frais juridiques et frais de dépôt	76	109
Frais de service aux porteurs de parts	287	285
Frais d'imprimerie et de papeterie	7	8
Commissions et autres coûts de transactions du portefeuille (note 6)	26	—
Charges d'exploitation absorbées par le gestionnaire	(2 747)	(4 219)
Total des charges	488	(1 090)
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	51 201	59 856
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part (note 8)	0,10	0,12

Les notes annexes font partie intégrante des présents états financiers.

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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	4 891 969	4 440 812
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	51 201	59 856
Distributions aux porteurs de parts rachetables		
Revenu de placement net	(80 806)	(64 841)
Total des distributions aux porteurs de parts rachetables	(80 806)	(64 841)
Transactions sur parts rachetables		
Produit de l'émission de parts rachetables	718 835	711 439
Réinvestissement des distributions aux porteurs de parts rachetables	76 170	61 159
Rachat de parts rachetables	(413 190)	(325 450)
Augmentation nette au titre des transactions sur parts rachetables	381 815	447 148
Augmentation nette de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables	352 210	442 163
Actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables à la clôture de la période	5 244 179	4 882 975

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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	51 201	59 856
Ajustements au titre des éléments suivants :		
Perte de change sur la trésorerie	2	0
Perte nette réalisée sur la vente de placements et de dérivés	15 178	29 320
Variation de la moins-value (plus-value) latente sur les placements et les dérivés	31 221	(22 515)
Augmentation des intérêts à recevoir	(16 162)	(2 835)
Diminution des distributions à recevoir des fiducies de placement	1 312	—
Augmentation des autres créances	—	(28)
Augmentation des swaps à payer	121	—
Augmentation de la marge à payer sur contrats à terme normalisés	3 847	—
Augmentation des charges à payer	138	—
Amortissement des primes et escomptes	(13 108)	(705)
Achats de placements	(4 030 022)	(1 221 686)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	3 643 670	724 402
Entrées de trésorerie sur dérivés	7 487	—
Flux de trésorerie nets liés aux activités d'exploitation	(305 115)	(434 191)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement		
Distributions aux porteurs de parts rachetables, déduction faite des distributions réinvesties	(3 897)	(3 031)
Produit de l'émission de parts rachetables	717 982	719 148
Sommes versées au rachat de parts rachetables	(411 583)	(324 309)
Flux de trésorerie nets liés aux activités de financement	302 502	391 808
Perte de change sur la trésorerie	(2)	0
Diminution nette de la trésorerie	(2 613)	(42 383)
Trésorerie à l'ouverture de la période	31 221	48 973
Trésorerie à la clôture de la période	28 606	6 590
Information supplémentaire		
Intérêts reçus, déduction faite des retenues d'impôts*	74 464	46 833
Distributions provenant des fiducies de placement, déduction faite des retenues d'impôts*	1 312	14 963
Frais d'intérêts payés*	41	0

* Cet élément est lié aux activités d'exploitation.

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 — 0,1 %			
<i>Provincial — 0,1 %</i>			
Province d'Ontario, bons du Trésor, 4,635 %, 4 sept. 2024	2 300	2 274	2 279
Total des titres du marché monétaire — 0,1 %		2 274	2 279
Obligations et débentures			
<i>Obligations fédérales — 17,7 %</i>			
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 92, obligations hypothécaires, garanties, 1,750 %, 15 juin 2030	67 000	58 487	60 040
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 97, obligations hypothécaires, garanties, 1,400 %, 15 mars 2031	10 000	8 521	8 620
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 101, obligations hypothécaires, garanties, 1,600 %, 15 déc. 2031	21 300	18 342	18 296
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 104, obligations hypothécaires, garanties, 2,150 %, 15 déc. 2031	21 200	19 282	18 966
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 107, obligations hypothécaires, garanties, 3,550 %, 15 sept. 2032	67 440	65 998	66 094
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 112, obligations hypothécaires, garanties, 3,650 %, 15 juin 2033	39 900	38 961	39 214
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 116, obligations hypothécaires, garanties, 4,150 %, 15 juin 2033	19 500	19 667	19 895
CPPIB Capital Inc., eurobillets à moyen terme, premier rang, non garantis, 3,000 %, 15 juin 2028	5 600	5 497	5 423
CPPIB Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,950 %, 30 sept. 2029	2 600	2 492	2 366
CPPIB Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,250 %, 1 ^{er} déc. 2031	2 000	1 777	1 774
Autorité financière des Premières Nations, série 17-1, billets, premier rang, garantis, 3,050 %, 1 ^{er} juin 2028	2 400	2 331	2 325
Autorité financière des Premières Nations, premier rang, garanties, 1,710 %, 16 juin 2030	3 000	2 605	2 642
Autorité financière des Premières Nations, billets, premier rang, garantis, 4,100 %, 1 ^{er} juin 2034	2 109	2 078	2 073
Gouvernement du Canada, 0,500 %, 1 ^{er} déc. 2030	1 832	1 497	1 522
Gouvernement du Canada, 1,500 %, 1 ^{er} juin 2031	4 498	3 935	3 953
Gouvernement du Canada, 1,500 %, 1 ^{er} déc. 2031	30 450	26 470	26 504
Gouvernement du Canada, série N597, 2,000 %, 1 ^{er} juin 2032	25 889	23 627	23 217
Gouvernement du Canada, 2,500 %, 1 ^{er} déc. 2032	51 339	48 000	47 613
Gouvernement du Canada, 2,750 %, 1 ^{er} juin 2033	38 710	36 396	36 493
Gouvernement du Canada, 5,750 %, 1 ^{er} juin 2033	29 500	34 928	34 455
Gouvernement du Canada, 3,250 %, 1 ^{er} déc. 2033	35 356	34 775	34 641
Gouvernement du Canada, 3,500 %, 1 ^{er} mars 2034	16 662	16 600	16 685
Gouvernement du Canada, 3,000 %, 1 ^{er} juin 2034	156 450	147 396	149 934
Gouvernement du Canada, 4,000 %, 1 ^{er} juin 2041	70 000	74 383	74 589
Gouvernement du Canada, obligations à rendement réel, 1,500 %, 1 ^{er} déc. 2044	37 964	35 144	36 432

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Gouvernement du Canada, 3,500 %, 1 ^{er} déc. 2045	99 100	99 970	99 796
Gouvernement du Canada, non garanties, 2,750 %, 1 ^{er} déc. 2048	60 629	54 125	53 912
Gouvernement du Canada, 2,000 %, 1 ^{er} déc. 2051	25 000	18 566	18 711
Gouvernement du Canada, 1,750 %, 1 ^{er} déc. 2053	7 180	4 966	4 983
Labrador-Island Link Funding Trust, série A, billets, premier rang, non garantis, 3,760 %, 1 ^{er} juin 2033	4 500	4 440	4 389
PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 0,900 %, 15 juin 2026	2 000	1 895	1 881
PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,500 %, 15 mars 2028	3 000	2 786	2 756
PSP Capital Inc., série 12, billets, premier rang, non garantis, 2,050 %, 15 janv. 2030	2 000	1 903	1 818
PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,600 %, 1 ^{er} mars 2032	2 783	2 643	2 516
PSP Capital Inc., non garanties, 4,150 %, 1 ^{er} juin 2033	4 440	4 370	4 431
		924 853	928 959
Obligations provinciales — 26,3 %			
Province de l'Alberta, débentures, non garanties, 2,050 %, 1 ^{er} juin 2030	22 550	21 496	20 395
Province de l'Alberta, débentures, non garanties, 1,650 %, 1 ^{er} juin 2031	16 300	14 568	14 046
Province de l'Alberta, non garanties, 3,500 %, 1 ^{er} juin 2031	2 949	2 978	2 869
Province de l'Alberta, billets, non garantis, 4,150 %, 1 ^{er} juin 2033	8 000	7 848	8 004
Province de l'Alberta, non garanties, 3,900 %, 1 ^{er} déc. 2033	2 594	2 619	2 539
Province de l'Alberta, non garanties, 3,450 %, 1 ^{er} déc. 2043	17 930	15 533	15 706
Province de l'Alberta, non garanties, 3,300 %, 1 ^{er} déc. 2046	13 000	10 757	10 966
Province de l'Alberta, non garanties, 3,050 %, 1 ^{er} déc. 2048	12 497	9 875	9 995
Province de l'Alberta, non garanties, 4,450 %, 1 ^{er} déc. 2054	25 000	24 684	25 503
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 2,300 %, 18 juin 2026	1 750	1 699	1 693
Province de la Colombie-Britannique, débentures-billets, non garanties, 2,200 %, 18 juin 2030	7 500	7 167	6 832
Province de la Colombie-Britannique, billets, premier rang, non garantis, 1,550 %, 18 juin 2031	15 000	13 353	12 810
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 3,200 %, 18 juin 2032	17 873	16 941	16 812
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 3,550 %, 18 juin 2033	18 755	17 421	17 895
Province de la Colombie-Britannique, billets, non garantis, 4,150 %, 18 juin 2034	9 464	9 324	9 414
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 4,300 %, 18 juin 2042	10 000	9 833	9 846
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 3,200 %, 18 juin 2044	15 000	12 308	12 571
Province de la Colombie-Britannique, non garanties, 4,250 %, 18 déc. 2053	46 000	44 541	45 186
Province du Manitoba, billets, premier rang, non garantis, 2,050 %, 2 juin 2030	6 300	6 153	5 687

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Province du Manitoba, billets, premier rang, non garantis, 2,050 %, 2 juin 2031	2 354	2 126	2 080
Province du Manitoba, billets, non garantis, 3,900 %, 2 déc. 2032	10 204	10 227	10 032
Province du Manitoba, billets, non garantis, 3,800 %, 2 juin 2033	2 862	2 841	2 778
Province du Manitoba, débentures, 4,100 %, 5 mars 2041	10 000	9 483	9 506
Province du Manitoba, non garanties, 2,850 %, 5 sept. 2046	15 000	11 323	11 495
Province du Manitoba, non garanties, 3,400 %, 5 sept. 2048	10 000	8 290	8 367
Province du Nouveau-Brunswick, non garanties, 2,550 %, 14 août 2031	4 250	3 952	3 866
Province du Nouveau-Brunswick, non garanties, 3,950 %, 14 août 2032	4 500	4 364	4 445
Province du Nouveau-Brunswick, billets, non garantis, 3,100 %, 14 août 2048	5 000	3 943	3 973
Province du Nouveau-Brunswick, non garanties, 5,000 %, 14 août 2054	8 510	9 230	9 292
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, débentures, non garanties, 1,250 %, 2 juin 2027	2 750	2 596	2 546
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, non garanties, 6,150 %, 17 avr. 2028	1 000	1 086	1 075
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, débentures, non garanties, 1,750 %, 2 juin 2030	7 700	7 095	6 786
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, débentures, non garanties, 2,050 %, 2 juin 2031	5 000	4 361	4 382
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, non garanties, 4,150 %, 2 juin 2033	200	204	198
Province de Terre-Neuve-et-Labrador, non garanties, 4,100 %, 17 oct. 2054	5 339	4 735	4 880
Province de la Nouvelle-Écosse, non garanties, 2,000 %, 1 ^{er} sept. 2030	5 100	4 728	4 570
Province de la Nouvelle-Écosse, billets, non garantis, 2,400 %, 1 ^{er} déc. 2031	12 500	11 176	11 195
Province de la Nouvelle-Écosse, billets, non garantis, 4,050 %, 1 ^{er} juin 2033	1 108	1 120	1 096
Province de la Nouvelle-Écosse, billets à moyen terme, 5,800 %, 1 ^{er} juin 2033	300	341	335
Province d'Ontario, billets, non garantis, 1,350 %, 8 sept. 2026	6 240	5 926	5 897
Province d'Ontario, billets, non garantis, 2,050 %, 2 juin 2030	59 271	56 767	53 600
Province d'Ontario, billets, non garantis, 1,350 %, 2 déc. 2030	39 199	35 671	33 546
Province d'Ontario, billets, non garantis, 2,150 %, 2 juin 2031	19 817	18 463	17 667
Province d'Ontario, 6,200 %, 2 juin 2031	2 000	2 235	2 268
Province d'Ontario, premier rang, non garanties, 2,250 %, 2 déc. 2031	38 500	35 257	34 193
Province d'Ontario, premier rang, non garanties, 4,050 %, 2 févr. 2032	4 000	3 926	4 009
Province d'Ontario, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 3,750 %, 2 juin 2032	16 118	16 086	15 782
Province d'Ontario, billets, premier rang, non garantis, 5,770 %, 25 sept. 2028	5 321	5 302	5 315
Province d'Ontario, 5,850 %, 8 mars 2033	10 000	11 264	11 216
Province d'Ontario, premier rang, non garanties, 3,650 %, 2 juin 2033	28 880	28 224	27 826
Province d'Ontario, premier rang, non garanties, 4,150 %, 2 juin 2034	4 579	4 566	4 565

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Province d'Ontario, billets, premier rang, non garantis, 4,150 %, 2 déc. 2054	365 600	353 458	355 066
Province de l'Île-du-Prince-Édouard, premier rang, non garanties, 1,200 %, 11 févr. 2028	500	458	454
Province de Québec, non garanties, 2,500 %, 1 ^{er} sept. 2026	14 000	13 640	13 569
Province de Québec, billets, premier rang, non garantis, 1,900 %, 1 ^{er} sept. 2030	37 035	34 802	33 008
Province de Québec, premier rang, non garanties, 2,100 %, 27 mai 2031	11 000	10 026	9 792
Province de Québec, débentures, premier rang, non garanties, 1,500 %, 1 ^{er} sept. 2031	8 154	7 082	6 904
Province de Québec, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 3,650 %, 20 mai 2032	9 848	9 675	9 601
Province de Québec, 6,250 %, 1 ^{er} juin 2032	2 000	2 350	2 287
Province de Québec, billets, premier rang, non garantis, 3,250 %, 1 ^{er} sept. 2032	45 000	42 589	42 428
Province de Québec, premier rang, non garanties, 3,900 %, 22 nov. 2032	11 000	11 045	10 874
Province de Québec, billets, premier rang, non garantis, 3,600 %, 1 ^{er} sept. 2033	50 850	47 919	48 686
Province de Québec, 5,000 %, 1 ^{er} déc. 2041	10 000	10 651	10 698
Province de Québec, 4,250 %, 1 ^{er} déc. 2043	35 000	34 034	34 207
Province de Québec, non garanties, 3,500 %, 1 ^{er} déc. 2045	55 000	48 054	48 003
Province de Québec, non garanties, 3,500 %, 1 ^{er} déc. 2048	30 000	25 621	25 958
Province de Québec, non garanties, 3,100 %, 1 ^{er} déc. 2051	10 000	8 040	8 007
Province de Québec, débentures, premier rang, non garanties, 2,850 %, 1 ^{er} déc. 2053	8 430	6 099	6 350
Province de Québec, débentures, premier rang, non garanties, 4,400 %, 1 ^{er} déc. 2055	121 252	121 064	122 499
Province de la Saskatchewan, non garanties, 2,200 %, 2 juin 2030	10 508	10 003	9 579
Province de la Saskatchewan, non garanties, 2,150 %, 2 juin 2031	1 750	1 612	1 559
Province de la Saskatchewan, débentures, non garanties, 3,900 %, 2 juin 2033	1 880	1 889	1 844
Province de la Saskatchewan, non garanties, 5,800 %, 5 sept. 2033	100	110	112
Province de la Saskatchewan, non garanties, 3,300 %, 2 juin 2048	10 000	8 256	8 368
		1 384 483	1 377 403
Obligations municipales — 0,9 %			
Ville de Montréal, billets, non garantis, 3,000 %, 1 ^{er} sept. 2027	5 300	5 171	5 142
Ville de Montréal, billets, non garantis, 3,150 %, 1 ^{er} sept. 2028	5 850	5 567	5 668
Ville de Montréal, billets, non garantis, 2,300 %, 1 ^{er} sept. 2029	6 500	6 643	5 994
Ville de Montréal, billets, non garantis, 1,750 %, 1 ^{er} sept. 2030	7 500	6 575	6 561
Ville de Montréal, billets, non garantis, 2,000 %, 1 ^{er} sept. 2031	7 250	6 408	6 291
Ville de Montréal, billets, non garantis, 4,250 %, 1 ^{er} sept. 2033	1 000	1 021	993
Ville d'Ottawa, débentures, non garanties, 5,050 %, 13 août 2030	500	522	529
Ville de Toronto, billets, non garantis, 2,650 %, 9 nov. 2029	7 500	7 423	7 056
Ville de Toronto, débentures, non garanties, 1,600 %, 2 déc. 2030	3 000	2 612	2 603
Ville de Toronto, débentures, premier rang, non garanties, 2,200 %, 21 déc. 2031	3 000	2 667	2 645

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Ville de Toronto, débentures, premier rang, non garanties, 3,250 %, 20 avr. 2032	3 500	3 340	3 300
Municipal Finance Authority of British Columbia, billets, non garantis, 2,300 %, 15 avr. 2031	1 500	1 371	1 349
Municipal Finance Authority of British Columbia, billets, non garantis, 3,300 %, 8 avr. 2032	1 000	968	947
		50 288	49 078
<i>Obligations et débentures de sociétés — 54,1 %</i>			
407 International Inc., billets, premier rang, garantis, rachetables, 1,800 %, 22 mai 2025	429	431	418
407 International Inc., série 16-A2, billets à moyen terme, garantis, rachetables, 2,430 %, 4 mai 2027	750	725	715
407 International Inc., billets, premier rang, garantis, rachetables, 4,220 %, 14 févr. 2028	900	889	891
407 International Inc., série 99-A2, premier rang, garanties, 6,470 %, 27 juill. 2029	200	217	218
407 International Inc., billets à moyen terme, premier rang, garantis, rachetables, 3,140 %, 6 mars 2030	2 000	1 929	1 891
407 International Inc., billets, premier rang, garantis, rachetables, 4,450 %, 14 août 2031	2 000	1 948	1 968
407 International Inc., série 20-A3, billets à moyen terme, premier rang, garantis, rachetables, 2,590 %, 25 mai 2032	3 500	3 013	3 060
407 International Inc., série 17-A1, billets à moyen terme, garantis, rachetables, 3,430 %, 1 ^{er} juin 2033	1 940	1 726	1 784
407 International Inc., billets à moyen terme, premier rang, garantis, rachetables, 2,840 %, 7 mars 2050	5 000	3 543	3 525
Aéroports de Montréal, premier rang, garanties, fonds d'amortissement, 6,950 %, 16 avr. 2032	128	139	138
Aéroports de Montréal, série D, débentures, non garanties, 6,550 %, 11 oct. 2033	150	162	169
Aéroports de Montréal, billets, premier rang, garantis, fonds d'amortissement, 6,611 %, 11 oct. 2033	99	103	106
Aéroports de Montréal, série M, billets, garantis, rachetables, 3,918 %, 12 juin 2045	5 000	4 439	4 419
AIMCo Realty Investors LP, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,195 %, 4 nov. 2026	450	442	427
AIMCo Realty Investors LP, série 3, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,367 %, 1 ^{er} juin 2027	720	713	699
AIMCo Realty Investors LP, série 2, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,043 %, 1 ^{er} juin 2028	600	563	569
AIMCo Realty Investors LP, série 4, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,712 %, 1 ^{er} juin 2029	4 396	4 286	4 047
Alectra Inc., série A, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,488 %, 17 mai 2027	2 800	2 709	2 659
Algonquin Power Co., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,090 %, 17 févr. 2027	1 450	1 487	1 419
Algonquin Power Co., débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 4,600 %, 29 janv. 2029	2 594	2 522	2 558

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Algonquin Power Co., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,850 %, 15 juill. 2031	1 388	1 288	1 213
Alimentation Couche-Tard Inc., série 5, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,600 %, 2 juin 2025	11 500	11 383	11 359
Alimentation Couche-Tard Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,592 %, 25 sept. 2030	4 000	4 094	4 191
Allied Properties REIT, série C, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,636 %, 21 avr. 2025	1 000	1 014	983
Allied Properties REIT, série H, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,726 %, 12 févr. 2026	6 500	6 065	6 055
Allied Properties REIT, série E, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,113 %, 8 avr. 2027	3 188	2 964	2 926
Allied Properties REIT, série G, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,131 %, 15 mai 2028	1 000	903	886
Allied Properties REIT, série D, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,394 %, 15 août 2029	438	438	378
Allied Properties REIT, série F, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,117 %, 21 févr. 2030	4 692	4 387	3 919
Allied Properties REIT, série I, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,095 %, 6 févr. 2032	1 000	830	782
AltaGas Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,150 %, 6 avr. 2026	800	819	775
AltaGas Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,260 %, 5 déc. 2028	2 300	2 227	2 244
AltaGas Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,157 %, 10 juin 2025	23 000	22 378	22 392
AltaGas Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,166 %, 16 mars 2027	205	201	192
AltaGas Ltd., série 18, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,980 %, 4 oct. 2027	12 795	12 492	12 493
AltaGas Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,075 %, 30 mai 2028	600	537	543
AltaGas Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,477 %, 30 nov. 2030	100	98	86
AltaGas Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,141 %, 14 mars 2034	2 540	2 540	2 511
AltaLink, L.P., série 2016-1, billets à moyen terme, garantis, rachetables, 2,747 %, 29 mai 2026	400	409	388
AltaLink, L.P., série 20-1, billets, premier rang, garantis, rachetables, 1,509 %, 11 sept. 2030	1 818	1 752	1 541
AltaLink, L.P., billets, premier rang, garantis, rachetables, 4,692 %, 28 nov. 2032	1 000	979	1 011
AltaLink, L.P., série 2016-2, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,717 %, 3 déc. 2046	10 000	8 434	8 493
ARC Resources Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,354 %, 10 mars 2026	2 750	2 673	2 644
ARC Resources Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,465 %, 10 mars 2031	1 667	1 619	1 528

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
AT&T Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,100 %, 25 nov. 2048	15 408	14 140	14 377
ATCO Ltd., série 18-1, billets, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 5,500 %, 1 ^{er} nov. 2078	1 333	1 235	1 314
Athene Global Funding, série MPLE, billets, premier rang, garantis, 5,113 %, 7 mars 2029	17 007	17 007	17 135
Groupe AtkinsRéalis inc., série 7, billets, premier rang, non garantis, 7,000 %, 12 juin 2026	7 000	7 161	7 241
Groupe AtkinsRéalis inc., série 8, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,700 %, 26 mars 2029	3 756	3 756	3 804
Bank of America Corporation, série MPLE, billets, premier rang, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 1,978 %, 15 sept. 2027	5 000	4 688	4 717
Bank of America Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,615 %, 16 mars 2028	20 000	19 255	19 486
Banque de Montréal, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 4,609 %, 10 sept. 2025	2 000	2 077	1 999
Banque de Montréal, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,551 %, 28 mai 2026	3 000	2 905	2 841
Banque de Montréal, billets, premier rang, non garantis, 2,700 %, 9 déc. 2026	1 190	1 217	1 146
Banque de Montréal, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,650 %, 1 ^{er} avr. 2027	37 000	36 034	36 164
Banque de Montréal, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,309 %, 1 ^{er} juin 2027	6 000	5 933	5 960
Banque de Montréal, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,709 %, 7 déc. 2027	6 254	6 234	6 282
Banque de Montréal, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,190 %, 1 ^{er} mars 2028	9 000	8 768	8 685
Banque de Montréal, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,039 %, 29 mai 2028	1 000	995	1 017
Banque de Montréal, premier rang, non garanties, rachetables, 4,537 %, 18 déc. 2028	65 000	64 347	64 881
Banque de Montréal, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,077 %, 17 juin 2030	2 000	1 966	1 944
Banque de Montréal, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 1,928 %, 22 juill. 2031	4 000	3 930	3 770
Banque de Montréal, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 6,534 %, 27 oct. 2032	500	523	525
Banque de Montréal, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 6,034 %, 7 sept. 2033	10 000	10 353	10 400
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, premier rang, non garantis, 5,500 %, 29 déc. 2025	3 229	3 228	3 262
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, premier rang, non garantis, 5,500 %, 8 mai 2026	25 620	25 849	25 971
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 2,620 %, 2 déc. 2026	2 300	2 311	2 212
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, premier rang, non garantis, 2,950 %, 8 mars 2027	66 875	64 032	64 218

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,100 %, 2 févr. 2028	6 600	6 362	6 355
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, subalternes, rachetables, taux fixe/variable, 3,934 %, 3 mai 2032	4 250	4 083	4 142
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,679 %, 2 août 2033	27 482	27 932	28 184
La Banque de Nouvelle-Écosse, série 1, débentures, subalternes, non garanties, rachetables, taux fixe/variable, 3,700 %, 27 juill. 2081	5 705	4 512	4 682
La Banque de Nouvelle-Écosse, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 7,023 %, 27 juill. 2082	3 500	3 467	3 525
Barclays PLC, série MPE, billets, premier rang, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 2,166 %, 23 juin 2027	3 300	3 097	3 118
BC Gas Utility, Ltd., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,950 %, 21 sept. 2029	500	538	554
BCI QuadReal Realty, série 5, billets, premier rang, non garantis, 2,551 %, 24 juin 2026	500	483	482
BCI QuadReal Realty, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,747 %, 24 juill. 2030	2 791	2 722	2 384
bcIMC Realty Corporation, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,840 %, 3 juin 2025	1 460	1 478	1 435
bcIMC Realty Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,000 %, 31 mars 2027	1 027	1 032	989
Bell Canada, série M-47, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,350 %, 12 mars 2025	4 000	3 966	3 955
Bell Canada, série M-41, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,550 %, 2 mars 2026	4 961	4 961	4 870
Bell Canada, série M-43, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,900 %, 12 août 2026	940	958	908
Bell Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 1,650 %, 16 août 2027	1 223	1 156	1 129
Bell Canada, série M-46, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,600 %, 29 sept. 2027	2 900	2 777	2 816
Bell Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,150 %, 14 nov. 2028	7 950	8 074	8 100
Bell Canada, série M-50, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,900 %, 10 sept. 2029	5 280	5 022	4 858
Bell Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,550 %, 9 févr. 2030	6 000	5 781	5 949
Bell Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,500 %, 14 mai 2030	8 204	7 787	7 283
Bell Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,000 %, 17 mars 2031	8 769	8 301	7 881
Bell Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,850 %, 10 nov. 2032	7 000	7 172	7 403
Bell Canada, premier rang, non garanties, rachetables, 5,600 %, 11 août 2053	10 000	10 128	10 214
Brookfield Asset Management Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,820 %, 28 janv. 2026	2 250	2 350	2 252

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Brookfield Asset Management Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,800 %, 16 mars 2027	35 350	34 625	34 751
Brookfield Finance II Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,431 %, 14 déc. 2032	6 000	5 860	6 102
Brookfield Infrastructure Finance ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,193 %, 11 sept. 2028	2 326	2 199	2 281
Brookfield Infrastructure Finance ULC, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,410 %, 9 oct. 2029	6 200	6 096	5 808
Brookfield Infrastructure Finance ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,710 %, 27 juill. 2030	2 583	2 545	2 684
Brookfield Infrastructure Finance ULC, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,855 %, 1 ^{er} sept. 2032	2 000	1 609	1 700
Brookfield Infrastructure Finance ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,980 %, 14 févr. 2033	1 625	1 718	1 709
Brookfield Renewable Partners ULC, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,752 %, 2 juin 2025	4 200	4 178	4 155
Brookfield Renewable Partners ULC, billets à moyen terme, non garantis, rachetables, 3,630 %, 15 janv. 2027	500	502	488
Brookfield Renewable Partners ULC, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,250 %, 15 janv. 2029	1 450	1 425	1 426
Brookfield Renewable Partners ULC, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,380 %, 15 janv. 2030	3 900	3 833	3 653
Brookfield Renewable Partners ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,880 %, 9 nov. 2032	1 500	1 494	1 593
Brookfield Renewable Partners ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,292 %, 28 oct. 2033	800	758	815
Brookfield Renewable Partners ULC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,318 %, 10 janv. 2054	7 200	6 962	7 081
Bruce Power L.P., billets, premier rang, non garantis, 3,969 %, 23 juin 2026	1 500	1 559	1 482
Bruce Power L.P., série 2017-2, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,010 %, 21 juin 2029	1 895	1 922	1 851
Bruce Power L.P., série 2020-1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,000 %, 21 juin 2030	3 500	3 661	3 386
Bruce Power L.P., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,990 %, 21 déc. 2032	1 000	948	1 010
Bruce Power L.P., série 2018-1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,132 %, 21 juin 2033	915	827	865
CAE Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,541 %, 12 juin 2028	1 333	1 333	1 356
Corporation Cameco, série H, débentures-billets, premier rang, non garanties, rachetables, 2,950 %, 21 oct. 2027	1 150	1 108	1 096
Corporation Cameco, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,940 %, 24 mai 2031	2 198	2 198	2 212
La Corporation Financière Canada-Vie, série B, débentures, subalternes, non garanties, 6,400 %, 11 déc. 2028	500	526	539
Fiducie de capital Canada-Vie, série B, subalternes, non garanties, 7,529 %, 30 juin 2032	2 000	2 286	2 331

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Canadian Core Real Estate LP, série 1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,299 %, 2 mars 2027	400	400	378
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets de dépôt, non garantis, 3,300 %, 26 mai 2025	4 418	4 499	4 363
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, 1,100 %, 19 janv. 2026	3 000	2 977	2 848
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,935 %, 14 juill. 2026	500	501	500
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, 1,700 %, 15 juill. 2026	3 000	2 968	2 841
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, 5,000 %, 7 déc. 2026	20 000	20 119	20 178
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, 2,250 %, 7 janv. 2027	5 300	5 212	5 011
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,900 %, 2 avr. 2027	15 001	14 991	15 021
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,950 %, 29 juin 2027	3 000	3 000	3 032
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,050 %, 7 oct. 2027	1 470	1 468	1 491
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,500 %, 14 janv. 2028	1 000	1 004	1 029
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,010 %, 21 juill. 2030	22 000	21 234	21 319
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 1,960 %, 21 avr. 2031	4 000	3 926	3 794
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 4,200 %, 7 avr. 2032	4 980	4 863	4 889
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,330 %, 20 janv. 2033	2 000	2 021	2 024
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,350 %, 20 avr. 2033	16 000	16 070	16 204
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,300 %, 16 janv. 2034	34 047	34 226	34 448
Banque Canadienne Impériale de Commerce, subalternes, non garanties, rachetables, 4,900 %, 12 juin 2034	7 735	7 723	7 693
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 4,000 %, 28 janv. 2082	3 800	3 254	3 342
Banque Canadienne Impériale de Commerce, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 7,150 %, 28 juill. 2082	3 000	2 992	3 029
Banque Canadienne Impériale de Commerce, subalternes, non garanties, rachetables, 6,987 %, 28 juill. 2084	7 000	7 000	7 001
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,800 %, 22 sept. 2025	600	609	586
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,200 %, 31 juill. 2028	500	489	481
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,000 %, 8 févr. 2029	1 872	1 806	1 773

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,150 %, 10 mai 2030	2 714	2 623	2 684
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,400 %, 10 mai 2033	2 714	2 718	2 688
Canadian Natural Resources Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,420 %, 1 ^{er} déc. 2026	1 900	1 940	1 854
Canadian Natural Resources Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,500 %, 17 janv. 2028	2 500	2 362	2 335
Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,540 %, 28 févr. 2028	2 633	2 459	2 474
Compagnie de chemin de fer Canadien Pacifique, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,150 %, 13 mars 2029	2 400	2 494	2 276
La Société Canadian Tire Limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,500 %, 13 avr. 2028	180	190	189
La Société Canadian Tire Limitée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,372 %, 16 sept. 2030	3 000	3 005	3 079
Banque canadienne de l'Ouest, billets de dépôt, premier rang, non garantis, rachetables, 1,926 %, 16 avr. 2026	80	80	76
Banque canadienne de l'Ouest, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 5,146 %, 2 sept. 2027	1 000	1 003	1 018
Banque canadienne de l'Ouest, billets de dépôt, premier rang, non garantis, rachetables, 1,818 %, 16 déc. 2027	1 300	1 170	1 194
Capital Power Corporation, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,986 %, 23 janv. 2026	333	348	333
Capital Power Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,424 %, 8 févr. 2030	2 527	2 489	2 448
Capital Power Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,147 %, 1 ^{er} oct. 2032	1 000	821	854
Capital Power Corporation, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,973 %, 25 janv. 2034	6 744	6 853	6 958
Capital Power Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 8,125 %, 5 juin 2054	4 621	4 621	4 715
CCL Industries, Inc., série 1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,864 %, 13 avr. 2028	3 050	2 946	2 943
Cenovus Energy Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,600 %, 10 mars 2027	4 250	4 281	4 148
Cenovus Energy Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,500 %, 7 févr. 2028	7 622	7 350	7 348
Central 1 Credit Union, billets, premier rang, non garantis, 5,417 %, 29 sept. 2025	5 500	5 506	5 520
Central 1 Credit Union, billets, premier rang, non garantis, 1,323 %, 29 janv. 2026	7 890	7 473	7 464
Chartwell, résidences pour retraités, série B, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 4,211 %, 28 avr. 2025	506	513	501
CHIP Mortgage Trust, billets, premier rang, garantis, rachetables, 6,069 %, 14 nov. 2028	450	451	465
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série F, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,055 %, 24 nov. 2025	623	641	616

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série Q, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,456 %, 30 nov. 2026	656	627	624
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série P, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,848 %, 21 mai 2027	1 400	1 341	1 333
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série L, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 4,178 %, 8 mars 2028	11 800	11 552	11 597
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série M, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,532 %, 11 juin 2029	2 330	2 221	2 201
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série N, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,981 %, 4 mars 2030	2 618	2 514	2 379
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,030 %, 28 févr. 2031	5 771	5 770	5 800
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, série R, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 6,003 %, 24 juin 2032	3 680	3 650	3 883
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,400 %, 1 ^{er} mars 2033	1 000	947	1 013
Cineplex Inc., série 144A, billets, premier rang, garantis, rachetables, 7,625 %, 31 mars 2029	6 625	6 625	6 757
Citigroup Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,070 %, 29 avr. 2028	11 154	11 154	11 281
CNH Industriel Capital Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, 4,800 %, 25 mars 2027	9 111	9 100	9 132
Coast Capital Savings Credit Union, série 2, billets, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 5,250 %, 29 oct. 2030	933	1 008	916
Coastal Gaslink Pipeline LP, série A, premier rang, garanties, 4,673 %, 30 juin 2027	3 880	3 880	3 909
Coastal Gaslink Pipeline LP, série B, billets, premier rang, garantis, 4,691 %, 30 sept. 2029	5 044	5 044	5 091
Coastal Gaslink Pipeline LP, série D, billets, premier rang, garantis, 5,187 %, 30 sept. 2034	4 756	4 756	4 843
Coastal Gaslink Pipeline LP, série H, billets, premier rang, garantis, 5,607 %, 30 juin 2044	4 471	4 471	4 684
Coastal Gaslink Pipeline LP, série J, billets, premier rang, garantis, 5,857 %, 30 mars 2049	1 489	1 489	1 592
Coastal Gaslink Pipeline LP, série K, premier rang, garanties, 5,857 %, 30 juin 2049	1 489	1 489	1 584
Cogeco Communications inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 6,125 %, 27 févr. 2029	9 859	9 859	9 978
Cogeco Communications inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,991 %, 22 sept. 2031	3 375	2 918	2 945
Cooper Equipment Rentals Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 7,450 %, 4 juill. 2029	9 358	9 358	9 358
Co-operators Financial Services Limited, débentures-billets, premier rang, non garanties, rachetables, 3,327 %, 13 mai 2030	2 285	2 160	2 054

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Fonds de placement immobilier Crombie, série F, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,677 %, 26 août 2026	500	516	488
Fonds de placement immobilier Crombie, série G, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,917 %, 21 juin 2027	400	383	390
Fonds de placement immobilier Crombie, série H, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,686 %, 31 mars 2028	1 700	1 554	1 571
Fonds de placement immobilier Crombie, série I, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,211 %, 9 oct. 2030	3 000	3 009	2 691
CT Real Estate Investment Trust, série B, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,527 %, 9 juin 2025	525	517	518
CT Real Estate Investment Trust, série D, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,289 %, 1 ^{er} juin 2026	400	409	388
CT Real Estate Investment Trust, série E, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,469 %, 16 juin 2027	480	469	462
CT Real Estate Investment Trust, série F, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,865 %, 7 déc. 2027	350	344	338
CT Real Estate Investment Trust, série H, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,029 %, 5 févr. 2029	336	336	309
CU Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 5,563 %, 26 mai 2028	1 000	1 036	1 036
CU Inc., billets, premier rang, non garantis, 3,805 %, 10 sept. 2042	10 000	8 684	8 713
Société Financière Daimler Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 1,650 %, 22 sept. 2025	1 486	1 467	1 432
Daimler Truck Finance Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 4,460 %, 27 sept. 2027	6 924	6 922	6 891
Daimler Truck Finance Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 5,770 %, 25 sept. 2028	5 000	5 194	5 213
Daimler Truck Finance Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,460 %, 15 déc. 2026	2 125	2 083	2 018
Dollarama Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,084 %, 27 oct. 2025	140	140	141
Dollarama Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,871 %, 8 juill. 2026	5 027	4 810	4 772
Dollarama Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,505 %, 20 sept. 2027	1 200	1 089	1 096
Dollarama Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,443 %, 9 juill. 2029	3 598	3 330	3 269
Dollarama Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,165 %, 26 avr. 2030	1 572	1 598	1 616
Fiducie de placement immobilier industriel Dream, série A, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,662 %, 22 déc. 2025	1 560	1 539	1 489
Fiducie de placement immobilier industriel Dream, série E, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,968 %, 13 avr. 2026	5 000	4 923	4 919
Fiducie de placement immobilier industriel Dream, série D, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,539 %, 7 déc. 2026	57	57	54

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Fiducie de placement immobilier industriel Dream, série C, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,057 %, 17 juin 2027	1 660	1 568	1 530
Dream Summit Industrial LP, série A, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,150 %, 17 sept. 2025	500	479	483
Dream Summit Industrial LP, série B, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 1,820 %, 1 ^{er} avr. 2026	500	492	474
Dream Summit Industrial LP, série C, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,250 %, 12 janv. 2027	913	902	855
Dream Summit Industrial LP, série D, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,440 %, 14 juill. 2028	2 940	2 581	2 675
Dream Summit Industrial LP, série E, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,111 %, 12 févr. 2029	13 214	13 203	13 289
Emera Incorporated, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,838 %, 2 mai 2030	1 500	1 423	1 489
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, débentures-billets, subalternes, non garanties, rachetables, 2,024 %, 24 sept. 2031	756	756	705
Enbridge Gas Distribution Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,310 %, 11 sept. 2025	26 000	25 578	25 544
Enbridge Gas Distribution Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,500 %, 5 août 2026	500	510	480
Enbridge Gas Distribution Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,650 %, 3 nov. 2027	500	533	530
Enbridge Gas Distribution Inc., billets à moyen terme, non garantis, rachetables, 6,900 %, 15 nov. 2032	700	801	798
Enbridge Gas Distribution Inc., billets à moyen terme, non garantis, rachetables, 6,160 %, 16 déc. 2033	200	224	219
Enbridge Gas Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,370 %, 9 août 2029	5 630	5 610	5 128
Enbridge Gas Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,900 %, 1 ^{er} avr. 2030	4 750	4 652	4 388
Enbridge Gas Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,350 %, 15 sept. 2031	1 250	1 162	1 086
Enbridge Gas Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,150 %, 17 août 2032	500	476	484
Enbridge Gas Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,700 %, 6 oct. 2033	500	506	536
Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,440 %, 2 juin 2025	5 780	5 649	5 651
Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,200 %, 8 juin 2027	1 700	1 679	1 637
Enbridge Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,700 %, 9 nov. 2027	360	360	372
Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,990 %, 3 oct. 2029	9 980	9 689	9 226
Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 7,200 %, 18 juin 2032	1 000	1 069	1 104
Enbridge Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 6,100 %, 9 nov. 2032	4 380	4 413	4 697

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Enbridge Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,360 %, 26 mai 2033	2 644	2 643	2 709
Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,100 %, 21 sept. 2033	4 000	3 185	3 444
Enbridge Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,760 %, 26 mai 2053	5 000	5 077	5 201
Enbridge Inc., billets, subalternes, rachetables, taux fixe/variable, 5,375 %, 27 sept. 2077	6 990	6 420	6 808
Enbridge Inc., série C, billets, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 6,625 %, 12 avr. 2078	4 750	4 801	4 826
Enbridge Inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,000 %, 19 janv. 2082	3 550	2 894	3 185
Pipelines Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,450 %, 29 sept. 2025	1 000	1 022	983
Pipelines Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,000 %, 10 août 2026	1 025	1 010	992
Pipelines Enbridge Inc., billets à moyen terme, non garantis, rachetables, 3,520 %, 22 févr. 2029	3 182	3 082	3 037
Pipelines Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,820 %, 12 mai 2031	2 645	2 410	2 352
Pipelines Enbridge Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,820 %, 17 août 2053	5 000	5 161	5 265
Énergir, s.e.c., série 22-1, premier rang, garanties, rachetables, 3,040 %, 9 févr. 2032	3 793	3 714	3 415
Énergir, s.e.c., série 2022, premier rang, garanties, rachetables, 4,670 %, 27 sept. 2032	500	496	501
Énergir Inc., série V, premier rang, garanties, rachetables, 2,100 %, 16 avr. 2027	470	452	442
Énergir inc., billets à moyen terme, premier rang, garantis, 6,300 %, 31 oct. 2033	200	213	221
ENMAX Corporation, série 6, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,331 %, 2 juin 2025	273	277	268
ENMAX Corporation, série 4, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,836 %, 5 juin 2028	3 013	2 869	2 899
ENMAX Corporation, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,876 %, 18 oct. 2029	383	383	363
EPCOR Utilities Inc., débentures, premier rang, non garanties, 6,800 %, 28 juin 2029	700	760	769
EPCOR Utilities Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,411 %, 30 juin 2031	2 000	1 944	1 755
EPCOR Utilities Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 5,750 %, 24 nov. 2039	5 000	5 445	5 462
Banque Équitable, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 1,939 %, 10 mars 2025	10	10	10
Banque Équitable, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 1,876 %, 26 nov. 2025	830	827	794
Banque Équitable, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,362 %, 2 mars 2026	757	757	736

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Fair Hydro Trust, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,357 %, 15 mai 2033	120	114	112
Fairfax Financial Holdings Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,700 %, 16 déc. 2026	2 000	2 091	1 992
Fairfax Financial Holdings Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,250 %, 6 déc. 2027	5 400	5 240	5 311
Fairfax Financial Holdings Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,230 %, 14 juin 2029	2 625	2 578	2 557
Fairfax Financial Holdings Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,950 %, 3 mars 2031	4 500	4 134	4 242
Federated Co-Operatives Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,917 %, 17 juin 2025	500	494	494
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, premier rang, non garantis, 5,200 %, 1 ^{er} oct. 2025	31 800	31 861	31 925
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, premier rang, non garantis, 1,093 %, 21 janv. 2026	3 000	2 929	2 847
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, premier rang, non garantis, 1,587 %, 10 sept. 2026	1 841	1 809	1 734
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, premier rang, non garantis, 4,407 %, 19 mai 2027	1 000	1 001	996
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,467 %, 17 nov. 2028	1 000	1 030	1 034
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,856 %, 26 mai 2030	5 000	5 137	4 902
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 1,992 %, 28 mai 2031	4 700	4 463	4 450
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,035 %, 23 août 2032	1 000	986	1 003
Fédération des caisses Desjardins du Québec, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,279 %, 15 mai 2034	10 882	10 882	11 000
Finning International Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,626 %, 14 août 2026	550	557	528
Finning International Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,445 %, 16 mai 2028	650	650	646
Finning International Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,778 %, 13 févr. 2029	15 791	15 791	15 887
Fonds de placement immobilier First Capital, série S, débentures, premier rang, non garanties, 4,323 %, 31 juill. 2025	1 000	1 022	991
Fonds de placement immobilier First Capital, série T, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,604 %, 6 mai 2026	958	976	934
Fonds de placement immobilier First Capital, série U, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,753 %, 12 juill. 2027	440	413	425
Fonds de placement immobilier First Capital, série A, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,447 %, 1 ^{er} mars 2028	450	408	426
First Capital Realty Inc., série V, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,456 %, 22 janv. 2027	2 125	2 140	2 047
Société financière First National, série 3, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,961 %, 17 nov. 2025	200	194	193

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Société financière First National, billets, premier rang, non garantis, 6,261 %, 1 ^{er} nov. 2027	3 692	3 691	3 746
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, 6,777 %, 15 sept. 2025	5 500	5 580	5 600
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, 7,000 %, 10 févr. 2026	500	504	514
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, 7,375 %, 12 mai 2026	500	507	519
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, 2,961 %, 16 sept. 2026	1 500	1 414	1 435
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, non garantis, 5,581 %, 22 févr. 2027	22 385	22 385	22 654
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,242 %, 23 mai 2028	6 940	6 940	6 976
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 6,382 %, 10 nov. 2028	10 000	10 313	10 475
Compagnie Crédit Ford du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,441 %, 9 févr. 2029	1 000	1 001	1 011
Fortified Trust, série A, billets, premier rang, garantis, 3,760 %, 23 juin 2025	3 000	2 969	2 967
Fortified Trust, série A, billets, garantis, 1,964 %, 23 oct. 2026	1 500	1 467	1 414
Fortified Trust, série A, billets, premier rang, garantis, 4,419 %, 23 déc. 2027	625	619	622
Fortis Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,180 %, 15 mai 2028	2 963	2 739	2 738
Fortis Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,431 %, 31 mai 2029	2 500	2 414	2 495
Fortis Inc., premier rang, non garanties, rachetables, 5,677 %, 8 nov. 2033	2 533	2 580	2 682
FortisBC Energy Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,420 %, 18 juill. 2031	2 500	2 486	2 191
Gaz Métro Inc., série I, obligations hypothécaires, premier rang, garanties, 7,050 %, 30 oct. 2030	1 000	1 097	1 124
Financière General Motors du Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, 1,700 %, 9 juill. 2025	500	499	484
Financière General Motors du Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,750 %, 15 avr. 2026	8 000	7 717	7 577
Financière General Motors du Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,150 %, 8 févr. 2027	1 333	1 333	1 279
Financière General Motors du Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, 5,100 %, 14 juill. 2028	6 694	6 680	6 757
Financière General Motors du Canada Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,000 %, 9 févr. 2029	20 820	20 779	20 910
Genworth MI Canada Inc., débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,955 %, 1 ^{er} mars 2027	387	385	363
George Weston limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 7,100 %, 5 févr. 2032	200	222	220
George Weston limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,690 %, 1 ^{er} mars 2033	180	190	194

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Gibson Energy Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,850 %, 14 juill. 2027	11 470	10 856	10 877
Gibson Energy Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,600 %, 17 sept. 2029	3 500	3 438	3 312
Goldman Sachs Group, Inc., The, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,599 %, 30 nov. 2027	20 000	18 881	19 049
Société en commandite Holding FPI Granite, série 4, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,062 %, 4 juin 2027	1 340	1 273	1 278
Société en commandite Holding FPI Granite, série 6, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,194 %, 30 août 2028	400	348	360
Société en commandite Holding FPI Granite, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,378 %, 18 déc. 2030	4 000	3 742	3 420
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 1997-3, obligations-recettes, 6,450 %, 3 déc. 2027	1 450	1 547	1 541
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2019-1, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,730 %, 3 avr. 2029	7 980	8 135	7 496
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 1999-1, obligations-recettes, premier rang, garanties, fonds d'amortissement, 6,450 %, 30 juill. 2029	389	412	407
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2000-1, billets à moyen terme, premier rang, garantis, 7,050 %, 12 juin 2030	2 500	2 776	2 815
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2001-1, billets à moyen terme, garantis, 7,100 %, 4 juin 2031	700	777	800
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, série 2002-3, billets à moyen terme, garantis, 6,980 %, 15 oct. 2032	3 100	3 451	3 577
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, billets à moyen terme, premier rang, garantis, 5,630 %, 7 juin 2040	8 000	8 766	8 752
Great-West Lifeco Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,337 %, 28 févr. 2028	6 400	6 095	6 199
Great-West Lifeco Inc., débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,379 %, 14 mai 2030	2 600	2 459	2 349
Great-West Lifeco Inc., billets, premier rang, non garantis, 6,740 %, 24 nov. 2031	1 500	1 586	1 683
Great-West Lifeco Inc., billets, premier rang, non garantis, 6,670 %, 21 mars 2033	1 200	1 283	1 355
Great-West Lifeco Inc., série 1, billets, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 3,600 %, 31 déc. 2081	2 000	1 983	1 672
Fonds de placement immobilier H&R, série S, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,633 %, 19 févr. 2027	1 500	1 399	1 406
HCN Canadian Holdings-1 LP, premier rang, non garanties, rachetables, 2,950 %, 15 janv. 2027	770	750	731
Banque HomeEquity, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 6,552 %, 18 oct. 2027	3 830	3 830	3 886
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 3,444 %, 23 mai 2025	3 045	3 087	3 008
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,337 %, 17 mars 2026	960	955	909
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,711 %, 28 sept. 2026	205	205	193

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,646 %, 25 févr. 2028	1 768	1 581	1 602
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 4,899 %, 21 févr. 2029	17 000	17 000	17 227
Honda Canada Finance Inc., billets, premier rang, non garantis, 4,900 %, 4 juin 2029	7 202	7 202	7 297
Banque HSBC Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 3,403 %, 24 mars 2025	2 000	1 998	1 980
Banque HSBC Canada, billets, premier rang, non garantis, 1,782 %, 20 mai 2026	4 500	4 488	4 285
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,970 %, 26 juin 2025	29 750	29 261	29 266
Hydro One Inc., série 35, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,770 %, 24 févr. 2026	1 200	1 224	1 168
Hydro One Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,910 %, 27 janv. 2028	500	513	510
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,020 %, 5 avr. 2029	2 746	2 715	2 605
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,930 %, 30 nov. 2029	2 000	1 996	1 969
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 1,690 %, 16 janv. 2031	5 500	4 964	4 694
Hydro One Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,230 %, 17 sept. 2031	4 575	4 010	3 976
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,930 %, 1 ^{er} juin 2032	500	572	574
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,160 %, 27 janv. 2033	1 000	925	976
Hydro One Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,850 %, 30 nov. 2054	3 900	3 921	3 918
Hydro One Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,410 %, 15 oct. 2027	954	899	873
Hyundai Capital Canada Inc., série A, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,008 %, 12 mai 2026	1 409	1 368	1 340
Hyundai Capital Canada Inc., premier rang, non garanties, 4,813 %, 1 ^{er} févr. 2027	17 000	17 000	17 041
Hyundai Capital Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,196 %, 16 févr. 2027	1 547	1 547	1 492
Hyundai Capital Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,895 %, 31 janv. 2029	10 000	10 000	10 062
iA Société financière inc., débentures-billets, premier rang, subalternes, non garanties, rachetables, 3,072 %, 24 sept. 2031	1 555	1 532	1 495
iA Société financière inc., débentures-billets, subalternes, non garanties, rachetables, 3,187 %, 25 févr. 2032	1 060	1 059	1 016
iA Société financière inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,685 %, 20 juin 2033	70	70	72
iA Société financière inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 6,921 %, 30 sept. 2084	6 586	6 586	6 568

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Société financière IGM Inc., débetures, rachetables, 7,110 %, 7 mars 2033	1 500	1 617	1 714
Société financière IGM Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,440 %, 26 janv. 2027	2 000	2 039	1 946
Société financière IGM Inc., série 1997, débetures, premier rang, non garanties, 6,650 %, 13 déc. 2027	2 900	3 059	3 071
Société financière IGM Inc., billets, premier rang, non garantis, 7,000 %, 31 déc. 2032	644	695	733
L'Ordre Indépendant des Forestiers, série 20-1, subalternes, non garanties, rachetables, 2,885 %, 15 oct. 2035	500	433	429
InPower BC General Partnership, billets, premier rang, garantis, fonds d'amortissement, 4,471 %, 31 mars 2033	208	204	202
Intact Corporation financière, série 6, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,770 %, 2 mars 2026	1 250	1 291	1 234
Intact Corporation financière, série 7, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,850 %, 7 juin 2027	1 500	1 431	1 438
Intact Corporation financière, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,179 %, 18 mai 2028	1 767	1 688	1 635
Intact Corporation financière, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 1,928 %, 16 déc. 2030	200	187	174
Intact Corporation financière, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 4,653 %, 16 mai 2034	5 593	5 593	5 630
Intact Corporation financière, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,276 %, 14 sept. 2054	10 000	10 540	10 672
Inter Pipeline Ltd., série 7, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,173 %, 24 mars 2025	855	861	843
Inter Pipeline Ltd., série 9, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,484 %, 16 déc. 2026	175	170	169
Inter Pipeline Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,760 %, 17 févr. 2028	1 097	1 127	1 121
Inter Pipeline Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,710 %, 29 mai 2030	2 500	2 426	2 541
Inter Pipeline Ltd., série 12, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,983 %, 25 nov. 2031	6 798	6 779	6 142
Inter Pipeline Ltd., série 14, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,849 %, 18 mai 2032	4 000	4 008	4 033
Inter Pipeline Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 6,380 %, 17 févr. 2033	6 200	6 330	6 435
Ivanhoé Cambridge II Inc., série 3, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,994 %, 2 juin 2028	1 143	1 143	1 164
John Deere Financial Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,310 %, 20 juin 2025	500	489	488
John Deere Financial Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,630 %, 9 avr. 2026	1 250	1 251	1 189
John Deere Financial Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 2,580 %, 16 oct. 2026	1 879	1 906	1 802
John Deere Financial Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,340 %, 8 sept. 2027	300	285	274

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
John Deere Financial Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,810 %, 19 janv. 2029	1 450	1 350	1 355
Keyera Corp., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,934 %, 21 juin 2028	389	380	378
Keyera Corp., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,959 %, 29 mai 2030	3 000	2 821	2 865
Keyera Corp., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,022 %, 28 mars 2032	1 000	1 000	994
Keyera Corp., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,663 %, 4 janv. 2054	8 000	7 772	8 087
Keyera Corp., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 6,875 %, 13 juin 2079	2 000	1 938	2 003
Banque Laurentienne du Canada, série CBL1, obligations couvertes, premier rang, garanties, 1,603 %, 6 mai 2026	1 000	947	948
Banque Laurentienne du Canada, premier rang, garanties, 3,545 %, 20 avr. 2027	2 000	1 961	1 951
Les Compagnies Loblaw limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,650 %, 8 nov. 2027	200	206	211
Les Compagnies Loblaw limitée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,488 %, 11 déc. 2028	3 400	3 385	3 402
Les Compagnies Loblaw limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,500 %, 22 janv. 2029	800	829	854
Les Compagnies Loblaw limitée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,008 %, 13 sept. 2032	1 500	1 516	1 525
Les Compagnies Loblaw limitée, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,540 %, 17 févr. 2033	145	159	159
Les Compagnies Loblaw limitée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,115 %, 4 mars 2054	5 431	5 431	5 400
Lower Mattagami Energy LP, série 2021-1, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,433 %, 14 mai 2031	1 795	1 642	1 592
Lower Mattagami Energy LP, premier rang, garanties, rachetables, 4,854 %, 31 oct. 2033	150	145	153
Magna International Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,950 %, 31 janv. 2031	2 000	1 923	2 023
Banque Manuvie du Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 1,504 %, 25 juin 2025	1 000	1 001	970
Banque Manuvie du Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 1,337 %, 26 févr. 2026	1 333	1 321	1 266
Banque Manuvie du Canada, billets, premier rang, non garantis, 1,536 %, 14 sept. 2026	667	667	627
Banque Manuvie du Canada, billets, premier rang, non garantis, 2,864 %, 16 févr. 2027	1 000	981	961
Société Financière Manuvie, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,409 %, 10 mars 2033	1 920	1 920	1 957
Société Financière Manuvie, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,054 %, 23 févr. 2034	47 853	47 853	48 242
Société Financière Manuvie, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,818 %, 13 mai 2035	7 000	6 765	6 281

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Société Financière Manuvie, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 7,117 %, 19 juin 2082	4 000	4 010	4 045
Mattamy Group Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,625 %, 1 ^{er} mars 2028	625	587	595
Mattr Corp., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 7,250 %, 2 avr. 2031	2 734	2 734	2 791
MCAP Commercial LP, billets, premier rang, garantis, 3,743 %, 25 août 2025	400	405	391
MCAP Commercial LP, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,384 %, 26 nov. 2027	800	768	743
Metro inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,390 %, 6 déc. 2027	800	773	774
Metro inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,657 %, 7 févr. 2033	500	484	496
Mondelēz International, Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,625 %, 3 juill. 2031	8 103	8 052	8 057
Banque Nationale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 5,296 %, 3 nov. 2025	2 000	2 023	2 011
Banque Nationale du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,573 %, 18 août 2026	37 036	35 607	35 708
Banque Nationale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 2,237 %, 4 nov. 2026	2 000	1 937	1 898
Banque Nationale du Canada, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,982 %, 18 mars 2027	7 015	7 015	7 031
Banque Nationale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 5,219 %, 14 juin 2028	1 500	1 490	1 534
Banque Nationale du Canada, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 5,023 %, 1 ^{er} févr. 2029	26 000	26 293	26 440
Banque Nationale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,426 %, 16 août 2032	2 800	2 773	2 838
Banque Nationale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,279 %, 15 févr. 2034	12 000	11 999	12 128
Banque Nationale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 4,050 %, 15 août 2081	6 482	5 130	5 433
NAV Canada, billets, non garantis, rachetables, 2,063 %, 29 mai 2030	3 500	3 379	3 100
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., premier rang, non garanties, rachetables, 4,850 %, 30 avr. 2031	5 656	5 642	5 686
Nissan Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,103 %, 22 sept. 2025	500	479	482
North Battleford Power LP, série A, premier rang, garanties, fonds d'amortissement, 4,958 %, 31 déc. 2032	2 113	2 105	2 089
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd., série A, billets, garantis, rachetables, 3,200 %, 24 avr. 2026	1 000	1 024	977
North West Redwater Partnership/NWR Financing Company Ltd., série M, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,000 %, 1 ^{er} déc. 2026	1 000	995	944
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co. Ltd., série J, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,800 %, 1 ^{er} juin 2027	920	900	880

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
North West Redwater Partnership/NWR Financing Company Ltd., série N, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,800 %, 1 ^{er} juin 2031	8 313	7 819	7 412
North West Redwater Partnership/NWR Financing Company Ltd., série O, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,750 %, 1 ^{er} juin 2051	10 000	8 074	8 111
North West Redwater Partnership/NWR Financing Company Ltd., série H, billets, garantis, rachetables, 4,150 %, 1 ^{er} juin 2033	2 398	2 169	2 291
Northland Power Inc., billets, premier rang, subalternes, non garantis, rachetables, 9,250 %, 30 juin 2083	2 000	2 083	2 124
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série D, billets, premier rang, garantis, fonds d'amortissement, 3,742 %, 31 déc. 2032	64	59	60
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc., série C, billets, premier rang, garantis, fonds d'amortissement, 3,750 %, 31 mars 2033	487	459	454
Nova Scotia Power Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,951 %, 15 nov. 2032	1 000	942	996
Nova Scotia Power Inc., série S, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,950 %, 25 août 2033	50	54	56
NRM Cabin Intermediate #1 LP, premier rang, garanties, 5,583 %, 31 juill. 2033	3 702	3 702	3 680
NRM Cabin Intermediate #2 LP, premier rang, garanties, 6,630 %, 31 juill. 2033	3 174	3 174	3 166
OMERS Realty Corporation, série 10, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,331 %, 5 juin 2025	272	277	268
OMERS Realty Corporation, série 9, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,244 %, 4 oct. 2027	1 500	1 441	1 446
OMERS Realty Corporation, premier rang, non garanties, rachetables, 5,381 %, 14 nov. 2028	1 650	1 660	1 704
OMERS Realty Corporation, premier rang, non garanties, rachetables, 4,539 %, 9 avr. 2029	1 500	1 467	1 502
OMERS Realty Corporation, série 11, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,628 %, 5 juin 2030	4 800	5 190	4 568
Ontario Power Generation Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,315 %, 4 oct. 2027	1 750	1 683	1 694
Ontario Power Generation Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,977 %, 13 sept. 2029	2 500	2 295	2 338
Ontario Power Generation Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,215 %, 8 avr. 2030	4 500	4 677	4 216
Ontario Power Generation Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,922 %, 19 juill. 2032	800	783	814
Ontario Power Generation Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,947 %, 21 févr. 2051	5 000	3 583	3 483
Ontario Power Generation Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,990 %, 28 juin 2054	3 686	3 648	3 653
Original Wempi Inc., premier rang, garanties, 7,791 %, 4 oct. 2027	2 743	2 743	2 918
Parkland Corp., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,375 %, 26 mars 2029	7 000	6 471	6 549
Pembina Pipeline Corporation, série 7, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,710 %, 11 août 2026	5 000	5 170	4 906

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Pembina Pipeline Corporation, série 6, billets à moyen terme, non garantis, rachetables, 4,240 %, 15 juin 2027	12 000	11 863	11 874
Pembina Pipeline Corporation, série 10, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,020 %, 27 mars 2028	9 950	9 693	9 739
Pembina Pipeline Corporation, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,620 %, 3 avr. 2029	5 032	5 170	4 802
Pembina Pipeline Corporation, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,310 %, 1 ^{er} févr. 2030	4 195	4 293	3 901
Pembina Pipeline Corporation, billets, non garantis, rachetables, 3,530 %, 10 déc. 2031	500	500	455
Pembina Pipeline Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,220 %, 28 juin 2033	9 231	9 227	9 236
Pembina Pipeline Corporation, série 4, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,810 %, 25 mars 2044	5 000	4 421	4 524
Corporation Financière Power, débentures, non garanties, 6,900 %, 11 mars 2033	240	277	269
Fiducie de placement immobilier Primaris, série B, billets, premier rang, non garantis, 4,267 %, 30 mars 2025	500	494	497
Prologis, L.P., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,700 %, 1 ^{er} mars 2029	31 687	31 629	31 747
Reliance LP, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,750 %, 15 mars 2026	919	944	903
Reliance LP, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,680 %, 1 ^{er} déc. 2027	1 800	1 699	1 679
Reliance LP, billets, premier rang, garantis, rachetables, 2,670 %, 1 ^{er} août 2028	1 138	1 011	1 044
Fonds de placement immobilier RioCan, série AD, premier rang, non garanties, rachetables, 1,974 %, 15 juin 2026	1 000	996	946
Fonds de placement immobilier RioCan, série AC, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,361 %, 10 mars 2027	833	820	779
Fonds de placement immobilier RioCan, série AE, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,829 %, 8 nov. 2028	1 753	1 529	1 596
Fonds de placement immobilier RioCan, série AF, premier rang, non garanties, rachetables, 4,628 %, 1 ^{er} mai 2029	2 500	2 410	2 442
Fonds de placement immobilier RioCan, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,962 %, 1 ^{er} oct. 2029	2 200	2 173	2 274
Rogers Communications Inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,000 %, 17 déc. 2081	5 000	4 756	4 844
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, 3,100 %, 15 avr. 2025	1 143	1 143	1 126
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, 5,650 %, 21 sept. 2026	10 728	10 918	10 928
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,800 %, 1 ^{er} mars 2027	1 700	1 734	1 662
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,650 %, 31 mars 2027	34 910	34 136	33 985
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,700 %, 21 sept. 2028	450	449	467

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,400 %, 2 nov. 2028	2 429	2 296	2 400
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,750 %, 15 avr. 2029	3 450	3 218	3 306
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,300 %, 10 déc. 2029	6 509	6 349	6 057
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,800 %, 21 sept. 2030	5 776	5 981	6 064
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,900 %, 9 déc. 2030	2 500	2 308	2 232
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,250 %, 15 avr. 2032	6 450	5 963	6 133
Rogers Communications Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,900 %, 21 sept. 2033	8 128	8 296	8 586
Banque Royale du Canada, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 4,930 %, 16 juill. 2025	1 000	1 038	1 002
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 3,369 %, 29 sept. 2025	29 000	28 507	28 491
Banque Royale du Canada, premier rang, couvertes, garanties, 4,109 %, 22 déc. 2025	4 000	3 960	3 977
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 1,589 %, 4 mai 2026	3 750	3 677	3 563
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 5,341 %, 23 juin 2026	7 400	7 424	7 494
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 5,235 %, 2 nov. 2026	33 205	33 594	33 684
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 2,328 %, 28 janv. 2027	24 900	23 818	23 597
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 4,612 %, 26 juill. 2027	3 700	3 718	3 712
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 4,642 %, 17 janv. 2028	1 500	1 517	1 508
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 4,632 %, 1 ^{er} mai 2028	5 292	5 292	5 315
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 1,833 %, 31 juill. 2028	1 100	993	1 002
Banque Royale du Canada, billets, premier rang, non garantis, 5,228 %, 24 juin 2030	8 307	8 375	8 599
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,088 %, 30 juin 2030	2 500	2 526	2 429
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,140 %, 3 nov. 2031	5 929	5 823	5 576
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,940 %, 3 mai 2032	8 000	7 683	7 603
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 1,670 %, 28 janv. 2033	3 700	3 223	3 335
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 5,096 %, 3 avr. 2034	8 613	8 613	8 663

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Banque Royale du Canada, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 3,650 %, 24 nov. 2081	19 543	15 610	16 259
Royal Office Finance LP, série A, obligations, premier rang, garanties, prêts publics, fonds d'amortissement, 5,209 %, 12 nov. 2032	4 542	4 773	4 721
Sagen MI Canada Inc., débetures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,261 %, 5 mars 2031	2 296	2 165	1 976
Sagicor Financial Company Ltd., premier rang, non garanties, rachetables, 6,359 %, 20 juin 2029	11 781	11 781	11 706
Saputo inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,603 %, 14 août 2025	10 833	10 684	10 671
Saputo inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,415 %, 19 juin 2026	1 013	1 004	952
Saputo inc., billets, non garantis, rachetables, 2,242 %, 16 juin 2027	11 847	11 001	11 090
Saputo inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,297 %, 22 juin 2028	300	269	275
Saputo inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,250 %, 29 nov. 2029	2 500	2 570	2 565
SEC LP and Arci Ltd, billets à moyen terme, premier rang, garantis, 5,188 %, 29 août 2033	134	125	128
Sirius XM Radio, Inc., série 144A, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,500 %, 1 ^{er} juill. 2029	5 000	6 458	6 396
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série P, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,444 %, 28 août 2026	750	772	726
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série V, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,192 %, 11 juin 2027	500	471	475
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série S, débetures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,834 %, 21 déc. 2027	900	861	863
SmartCentres Real Estate Investment Trust, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,354 %, 29 mai 2028	320	320	322
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série Y, débetures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,307 %, 18 déc. 2028	1 950	1 716	1 727
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série U, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,526 %, 20 déc. 2029	3 295	3 403	3 026
SmartCentres Real Estate Investment Trust, série W, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,648 %, 11 déc. 2030	2 000	2 070	1 812
Stantec Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,048 %, 8 oct. 2027	400	360	369
Stantec Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,393 %, 27 juin 2030	1 682	1 654	1 716
Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie, série 2, subalternes, non garanties, 6,300 %, 15 mai 2028	300	314	316
Financière Sun Life inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,460 %, 18 nov. 2031	700	700	665
Financière Sun Life inc., billets à moyen terme, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 2,580 %, 10 mai 2032	2 969	2 771	2 804
Financière Sun Life inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 2,800 %, 21 nov. 2033	5 015	4 555	4 638
Financière Sun Life inc., subalternes, rachetables, taux fixe/variable, 4,780 %, 10 août 2034	3 200	3 198	3 204

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Financière Sun Life inc., débentures-billets à moyen terme, subalternes, non garanties, rachetables, taux fixe/variable, 2,060 %, 1 ^{er} oct. 2035	6 643	5 989	5 658
Financière Sun Life inc., billets, subalternes, non garantis, rachetables, 3,150 %, 18 nov. 2036	3 125	3 104	2 779
Suncor Énergie Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,950 %, 4 mars 2051	5 000	3 930	4 048
Superior Plus LP, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,250 %, 18 mai 2028	5 000	4 732	4 712
Sysco Canada, Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,650 %, 25 avr. 2025	1 267	1 286	1 254
TELUS Corporation, série CV, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,750 %, 10 mars 2026	625	645	615
TELUS Corporation, série CZ, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,750 %, 8 juill. 2026	800	814	771
TELUS Corporation, série CAC, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,350 %, 27 janv. 2028	2 000	1 865	1 854
TELUS Corporation, série CX, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,625 %, 1 ^{er} mars 2028	2 380	2 274	2 302
TELUS Corporation, série CY, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,300 %, 2 mai 2029	750	736	707
TELUS Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,000 %, 13 sept. 2029	3 250	3 302	3 297
TELUS Corporation, série CAA, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,150 %, 19 févr. 2030	5 200	5 255	4 793
TELUS Corporation, premier rang, non garanties, rachetables, 5,600 %, 9 sept. 2030	667	666	694
TELUS Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,050 %, 7 oct. 2030	2 703	2 532	2 316
TELUS Corporation, série CAF, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,850 %, 13 nov. 2031	3 800	3 256	3 322
TELUS Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,250 %, 15 nov. 2032	5 100	4 955	5 188
TELUS Corporation, série CAJ, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,950 %, 28 mars 2033	2 482	2 481	2 467
TELUS Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,750 %, 8 sept. 2033	3 500	3 484	3 672
TELUS Corporation, série CU, billets, non garantis, rachetables, 4,400 %, 29 janv. 2046	1 500	1 293	1 286
TELUS Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,650 %, 13 sept. 2052	3 500	3 527	3 567
Teranet Holdings LP, série 2020, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,544 %, 11 juin 2025	980	986	964
Teranet Holdings LP, billets, premier rang, garantis, rachetables, 3,719 %, 23 févr. 2029	3 133	3 027	2 926
Thomson Reuters Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,239 %, 14 mai 2025	3 850	3 867	3 761
Groupe TMX Limitée, série E, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 3,779 %, 5 juin 2028	1 830	1 806	1 789

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Groupe TMX Limitée, série F, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,016 %, 12 févr. 2031	1 153	1 097	991
Toromont Industries Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,710 %, 30 sept. 2025	1 250	1 276	1 230
Toromont Industries Ltd., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,842 %, 27 oct. 2027	1 950	1 865	1 907
Toronto Hydro Corporation, série 12, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,520 %, 25 août 2026	500	491	480
Toronto Hydro Corporation, série 14, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 2,430 %, 11 déc. 2029	950	916	868
Toronto Hydro Corporation, série 16, débentures, premier rang, non garanties, rachetables, 1,500 %, 15 oct. 2030	2 500	2 264	2 121
Toronto Hydro Corporation, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,470 %, 20 oct. 2031	2 475	2 262	2 183
Toronto Hydro Corporation, débentures-billets, premier rang, non garanties, rachetables, 4,610 %, 14 juin 2033	500	494	504
Toronto Hydro Corporation, série 6, débentures, non garanties, 5,540 %, 21 mai 2040	5 000	5 380	5 404
La Banque Toronto-Dominion, débentures, subalternes, non garanties, 9,150 %, 26 mai 2025	1 000	1 038	1 033
La Banque Toronto-Dominion, billets de dépôt, premier rang, non garantis, 2,667 %, 9 sept. 2025	27 800	27 069	27 101
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 4,344 %, 27 janv. 2026	45 000	44 724	44 716
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 5,423 %, 10 juill. 2026	22 500	22 762	22 822
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 2,260 %, 7 janv. 2027	3 700	3 547	3 502
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 4,210 %, 1 ^{er} juin 2027	6 000	5 917	5 946
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 5,376 %, 21 oct. 2027	4 300	4 327	4 407
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 4,477 %, 18 janv. 2028	3 000	3 009	2 996
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 1,888 %, 8 mars 2028	4 050	3 852	3 717
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 5,491 %, 8 sept. 2028	789	789	816
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 1,896 %, 11 sept. 2028	3 515	3 161	3 193
La Banque Toronto-Dominion, billets, premier rang, non garantis, 4,680 %, 8 janv. 2029	6 000	5 997	6 028
La Banque Toronto-Dominion, billets à moyen terme, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 3,105 %, 22 avr. 2030	5 700	5 799	5 606
La Banque Toronto-Dominion, billets à moyen terme, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 4,859 %, 4 mars 2031	4 500	4 935	4 493
La Banque Toronto-Dominion, billets à moyen terme, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 3,060 %, 26 janv. 2032	5 967	6 010	5 706

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
La Banque Toronto-Dominion, billets à moyen terme, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 5,177 %, 9 avr. 2034	19 938	19 938	20 101
La Banque Toronto-Dominion, série 1, billets, subalternes, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 3,600 %, 31 oct. 2081	14 785	11 785	12 317
Tourmaline Oil Corp., série 1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,077 %, 25 janv. 2028	500	461	460
Tourmaline Oil Corp., série 2, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,529 %, 12 févr. 2029	1 592	1 510	1 458
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 2,730 %, 25 août 2025	1 375	1 375	1 345
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 1,180 %, 23 févr. 2026	1 250	1 242	1 184
Toyota Crédit Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 5,290 %, 13 juill. 2026	500	501	506
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 1,660 %, 20 juill. 2026	536	536	506
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 4,420 %, 28 juin 2027	15 000	14 997	14 971
Toyota Crédit Canada Inc., billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 4,330 %, 24 janv. 2028	375	376	373
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,300 %, 17 juill. 2025	700	712	689
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 8,290 %, 5 févr. 2026	1 875	2 047	1 954
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,419 %, 10 mars 2023	29 500	29 497	29 490
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,350 %, 12 mai 2026	500	496	497
TransCanada PipeLines Limited, débentures-billets, premier rang, non garanties, rachetables, 3,800 %, 5 avr. 2027	12 500	12 284	12 272
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 7,900 %, 15 avr. 2027	1 857	2 026	1 986
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,390 %, 15 mars 2028	473	464	455
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, 6,890 %, 7 août 2028	1 000	1 044	1 068
TransCanada PipeLines Limited, débentures-billets, premier rang, non garanties, rachetables, 3,000 %, 18 sept. 2029	2 041	2 022	1 903
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,277 %, 15 juill. 2030	4 750	4 784	4 886
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,970 %, 9 juin 2031	6 400	6 074	5 807
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 5,330 %, 12 mai 2032	6 000	6 015	6 155
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,350 %, 6 juin 2046	5 000	4 164	4 318
TransCanada PipeLines Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 4,330 %, 16 sept. 2047	2 000	1 651	1 714

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
TransCanada Trust, série 2017-A, billets, second rang, subalternes, rachetables, taux fixe/variable, 4,650 %, 18 mai 2077	9 740	9 138	9 336
TransCanada Trust, billets, subalternes, non garantis, rachetables, 4,200 %, 4 mars 2081	1 200	1 010	1 048
Trillium Windpower LP, premier rang, garanties, fonds d'amortissement, 5,803 %, 15 févr. 2033	111	114	112
Union Gas Limited, série 13, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,190 %, 17 sept. 2025	500	510	490
Union Gas Limited, série 14, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,810 %, 1 ^{er} juin 2026	1 400	1 431	1 354
Union Gas Limited, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 2,880 %, 22 nov. 2027	950	905	905
Administration de l'aéroport international de Vancouver, série B, billets, premier rang, non garantis, coupons multiples, 7,425 %, 7 déc. 2026	985	1 114	1 046
Administration de l'aéroport international de Vancouver, série I, premier rang, non garanties, rachetables, 1,760 %, 20 sept. 2030	1 187	1 085	1 023
Vancouver Airport Fuel Facilities Corporation, série I, garanties, rachetables, 2,168 %, 23 juin 2025	500	498	487
Ventas Canada Finance Limited, série G, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,450 %, 4 janv. 2027	650	650	613
Ventas Canada Finance Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,398 %, 21 avr. 2028	562	562	572
Ventas Canada Finance Limited, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,100 %, 5 mars 2029	19 128	19 112	19 263
Ventas Canada Finance Limited, série H, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,300 %, 1 ^{er} déc. 2031	675	673	600
Veren Inc., premier rang, non garanties, rachetables, 4,968 %, 21 juin 2029	3 110	3 110	3 096
Verizon Communications Inc., série MPLE, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,050 %, 22 mars 2051	5 000	4 113	4 085
Vidéotron Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,625 %, 15 juin 2028	5 000	4 691	4 793
Vidéotron Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,650 %, 15 juill. 2029	5 793	5 790	5 747
Vidéotron Ltée, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 4,500 %, 15 janv. 2030	5 000	4 818	4 904
Vistra Operations Company LLC, série 144A, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 7,750 %, 15 oct. 2031	5 000	6 965	7 122
Crédit VW Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,500 %, 23 sept. 2025	1 350	1 337	1 297
Crédit VW Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 5,800 %, 17 nov. 2025	10 000	10 078	10 116
Crédit VW Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 5,750 %, 21 sept. 2026	25 000	25 473	25 512
Crédit VW Canada Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,450 %, 10 déc. 2026	1 222	1 221	1 158
Waste Management of Canada Corporation, premier rang, non garanties, rachetables, 2,600 %, 23 sept. 2026	925	937	888

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

Titres	Valeur nominale (en milliers)	Coût (\$)	Juste valeur (\$)
Wells Fargo & Company, série MPLE, billets, premier rang, non garantis, rachetables, taux fixe/variable, 2,568 %, 1 ^{er} mai 2026	10 000	9 730	9 794
Wells Fargo & Company, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 5,083 %, 26 avr. 2028	32 371	32 371	32 728
Westcoast Energy Inc., série 16, billets à moyen terme, premier rang, non garantis, rachetables, 3,770 %, 8 déc. 2025	1 500	1 542	1 478
Westcoast Energy Inc., série 8, billets à moyen terme, 7,150 %, 20 mars 2031	1 000	1 046	1 107
Groupe WSP Global Inc., billets, premier rang, non garantis, rachetables, 2,408 %, 19 avr. 2028	2 388	2 186	2 201
		2 843 617	2 839 164
<i>Titres adossés à des créances mobilières — 0,2 %</i>			
CNH Capital Canada Receivables Trust, série 2024-1 A2, titres adossés à des créances mobilières, 5,063 %, 15 août 2031	5 515	5 515	5 540
Glacier Credit Card Trust, série 2020-1, billets adossés à des créances sur cartes de crédit, premier rang, 1,388 %, 22 sept. 2025	3 500	3 371	3 361
Glacier Credit Card Trust, série 2023-1, billets adossés à des créances sur cartes de crédit, premier rang, 5,681 %, 20 sept. 2028	2 000	2 003	2 083
		10 889	10 984
<i>Obligations supranationales — 0,2 %</i>			
Banque internationale pour la reconstruction et le développement, billets, premier rang, non garantis, 1,950 %, 20 sept. 2029	8 290	8 096	7 566
		8 096	7 566
Total des obligations et débentures — 99,4 %		5 222 226	5 213 154
Total du portefeuille de placements — 99,5 %		5 224 500	5 215 433
Gain total latent sur le contrat de change à terme — 0,0 %			0
Perte totale latente sur les contrats de change à terme — (0,0) %			(156)
Contrats de swap sur défaillance — (0,2) %			(8 276)
Autres actifs, moins les passifs — 0,7 %			37 178
ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE PARTS RACHETABLES — 100,0 %			5 244 179

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

GAIN LATENT SUR LE CONTRAT DE CHANGE À TERME

Date de règlement	Devise acquise	Position (en milliers)	Devise vendue	Position (en milliers)	Taux contractuels	Contrepartie	Notation**	Gain latent
3 juill. 24	USD	1 000	CAD	(1 368)	0,7310	Toronto Dominion Bank, The – New York	A-1+	0
Gain total latent sur le contrat de change à terme								0

PERTE LATENTE SUR LES CONTRATS DE CHANGE À TERME

Date de règlement	Devise acquise	Position (en milliers)	Devise vendue	Position (en milliers)	Taux contractuels	Contrepartie	Notation**	Perte latente
3 juill. 24	CAD	32 684	USD	(24 000)	1,3618	Toronto Dominion Bank, The – New York	A-1+	(149)
3 juill. 24	USD	960	CAD	(1 316)	0,7297	Toronto Dominion Bank, The – New York	A-1+	(2)
3 juill. 24	USD	1 300	CAD	(1 783)	0,7290	Toronto Dominion Bank, The – New York	A-1+	(5)
Perte totale latente sur les contrats de change à terme								(156)

CONTRATS DE SWAP SUR DÉFAILLANCE

Protection achat/vente	Entité de référence	Taux fixe reçu/ (versé)	Échéance	Contrepartie	Notation**	Montant notionnel	Juste valeur (passif)
Achat	Markit CDX North America Investment Grade Index, série 42, version 1	1,000 %	20 juin 29	Bank of America, N.A.	A-1	256 002	(7 205)
Achat	Markit CDX North America High Yield Index, série 42, version 1	5,000 %	20 juin 29	Bank of America, N.A.	A-1	12 480	(1 071)
Total des contrats de swap sur défaillance à la juste valeur							(8 276)

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

INVENTAIRE DU PORTEFEUILLE (suite)

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

CONTRATS À TERME NORMALISÉS

Pays	Contrat	Échéance	Nombre de contrats	Taux contractuel	Montant notionnel (\$)	Gain (perte) latent (\$)
États-Unis	Contrats à terme normalisés sur obligations du Trésor des États-Unis à 10 ans	Sept. 2024	(683)	109,4063	(102 645)	(102 767)
États-Unis	Contrats à terme normalisés sur obligations à très long terme des États-Unis	Sept. 2024	(228)	124,7813	(39 081)	(39 097)
Total des contrats à terme normalisés					(141 726)	(141 864)

** Notation de Standard & Poor's.

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes (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 Portefeilles 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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (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 28 juin 2000.

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	474 278	443 462
Émises contre trésorerie	70 597	69 905
Émises au réinvestissement de distributions	7 485	6 033
Rachetées durant la période	(40 415)	(32 063)
Parts émises et en circulation à la clôture de la période	511 945	487 337

Changement de dénomination du Portefeuille

À la fermeture des bureaux le 26 janvier 2024, le Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes est devenu le Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes.

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	51 201	59 856
Nombre moyen pondéré de parts en circulation au cours de la période (en milliers de parts)	491 418	483 089
Augmentation de l'actif net attribuable aux porteurs de parts rachetables, par part	0,10	0,12

d) Impôts sur le revenu

À la fin de l'année d'imposition terminée le 15 décembre 2023, les pertes en capital et autres qu'en capital dont disposait le Portefeuille à des fins fiscales s'établissaient comme suit :

Total des pertes en capital (\$)	Total des pertes autres qu'en capital (\$)	Pertes autres qu'en capital échéant en		
		2029 (\$)	2030 (\$)	2031 et par la suite (\$)
381 812	—	—	—	—

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 (\$)	141	141

Commissions de courtage et accords de paiement indirect

Les commissions de courtage (excluant les coûts de transactions) versées sur les opérations sur titres et les sommes versées à des parties liées du gestionnaire relativement à des services de courtage offerts au Portefeuille pour les périodes considérées sont les suivantes :

Périodes closes les	30 juin 2024	30 juin 2023
Total des commissions de courtage versées (\$)	26	—
Total des commissions de courtage versées aux parties liées (\$)	—	—

f) Risques liés aux instruments financiers

Le Portefeuille a pour objectif de produire un rendement supérieur par une combinaison de revenu d'intérêts et de croissance du capital tout en préservant le capital, en investissant surtout dans des titres à revenu fixe de grande qualité comme les obligations et les débentures assorties d'une échéance supérieure à un an émises par des autorités gouvernementales et des sociétés canadiennes.

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.

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

Notes annexes (suite)

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

30 juin 2024

Risque de change

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

Risque de taux d'intérêt

Le tableau suivant présente l'exposition du Portefeuille au risque de taux d'intérêt selon le terme à courir.

Nombre d'années	Exposition aux taux d'intérêt aux	
	30 juin 2024	31 déc. 2023
Moins de un an	107 692	337 639
De un à trois ans	982 862	1 000 812
De trois à cinq ans	730 997	817 076
De cinq à dix ans	2 016 117	2 639 103
Plus de dix ans	1 377 765	44 427
Total	5 215 433	4 839 057

Au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, si les taux d'intérêt en vigueur avaient augmenté ou diminué de 1 %, la courbe des taux évoluant en parallèle et toutes les autres variables restant constantes, l'actif net du Portefeuille aurait pu diminuer ou augmenter d'environ 363 083 \$ (225 589 \$ au 31 décembre 2023). La sensibilité du Portefeuille aux taux d'intérêt a été évaluée selon la durée pondérée du portefeuille. Dans la pratique, les résultats réels peuvent différer de cette analyse de sensibilité et l'écart pourrait être important.

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.

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	—	6,9
AAA	18,3	47,9
AA	15,5	11,6
A	35,2	20,7
BBB	28,4	11,8
BB	1,9	—
B	0,0	—
Total	99,3	98,9

Prêt de titres

Une partie de l'actif du Portefeuille était consacrée à des opérations de prêt de titres au 30 juin 2024 et au 31 décembre 2023, comme suit :

	Valeur globale des titres prêtés (\$)	Valeur globale de la garantie de prêt (\$)
30 juin 2024	335 216	352 693
31 décembre 2023	804 789	845 792

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	294	100,0	336	100,0
Retenues d'impôts	6	1,9	1	0,2
	288	98,1	335	99,8
Paiement aux agents chargés du prêt de titres	87	29,6	100	29,9
Revenu net tiré du prêt de titres*	201	68,5	235	69,9

* Le montant comptabilisé à l'état du résultat global comprend les retenues d'impôts, lesquelles s'établissaient à 6 \$ (1 \$ au 30 juin 2023).

Risque de concentration

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

Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023
Obligations et débetures		
Obligations fédérales	17,7 %	46,9 %
Obligations provinciales	26,3 %	20,7 %
Obligations municipales	0,9 %	1,3 %
Obligations et débetures de sociétés	54,1 %	22,7 %
Titres adossés à des créances mobilières	0,2 %	0,1 %
Obligations supranationales	0,2 %	0,3 %
Titres du marché monétaire		
Fédéral	— %	6,9 %
Provincial	0,1 %	— %
Swaps sur défaillance		
Swaps	(0,2) %	— %
Autres actifs, moins les passifs	0,7 %	1,1 %
	100,0 %	100,0 %

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

Notes annexes (suite)

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

30 juin 2024

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	5 213 154	2 279	—	5 215 433
Dérivés	—	0	—	0
Total	5 213 154	2 279	—	5 215 433
Passifs financiers				
Dérivés	—	(8 432)	—	(8 432)

Au 31 déc. 2023

Actifs financiers	Niveau 1	Niveau 2	Niveau 3	Total
Titres de créance	4 501 418	337 639	—	4 839 057

Transferts entre les niveaux

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

h) Compensation des actifs financiers et des passifs financiers

Les tableaux ci-après présentent les montants qui ont fait l'objet d'une compensation dans l'état de la situation financière. Les montants qui font l'objet d'une compensation dans l'état de la situation financière découlent de transactions à l'égard desquelles le Fonds a un droit juridiquement exécutoire d'opérer compensation et l'intention de procéder au règlement des positions sur la base du solde net.

Au 30 juin 2024	Actif	Passif
Montants bruts des actifs (passifs) financiers comptabilisés	0	(8 432)
Montants compensés à l'état de la situation financière	(0)	0
Montants nets présentés à l'état de la situation financière	—	(8 432)
Montants connexes non compensés à l'état de la situation financière		
Instrument financier	—	—
Garantie en trésorerie reçue (cédée)	—	—
Montant net	—	(8 432)

i) 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	Valeur comptable
	30 juin 2024	31 déc. 2023
BCI QuadReal Realty, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,680 %, 3 mars 2025	—	723
BCI QuadReal Realty, série 5, billets, premier rang, non garantis, 2,551 %, 24 juin 2026	482	479
BCI QuadReal Realty, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 1,747 %, 24 juill. 2030	2 384	2 358
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 62, obligations hypothécaires, garanties, 2,550 %, 15 mars 2025	—	11 554
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 93, obligations hypothécaires, garanties, 0,950 %, 15 juin 2025	—	25 782

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

Notes annexes (suite)

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

30 juin 2024

	Valeur comptable	Valeur comptable		Valeur comptable	Valeur comptable
Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023	Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 67, obligations hypothécaires, garanties, 1,950 %, 15 déc. 2025	—	27 914	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 88, obligations hypothécaires, garanties, 2,100 %, 15 sept. 2029	—	33 601
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 70, obligations hypothécaires, garanties, 2,250 %, 15 déc. 2025	—	12 770	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 92, obligations hypothécaires, garanties, 1,750 %, 15 juin 2030	60 040	69 684
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 73, obligations hypothécaires, garanties, 1,900 %, 15 sept. 2026	—	16 216	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 95, obligations hypothécaires, garanties, 1,100 %, 15 mars 2031	—	37 076
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 102, obligations hypothécaires, garanties, 1,100 %, 15 déc. 2026	—	18 496	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 97, obligations hypothécaires, garanties, 1,400 %, 15 mars 2031	8 620	17 426
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 77, obligations hypothécaires, garanties, 2,350 %, 15 juin 2027	—	40 851	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 100, obligations hypothécaires, garanties, 1,900 %, 15 mars 2031	—	14 899
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 109, obligations hypothécaires, garanties, 3,800 %, 15 juin 2027	—	16 836	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 101, obligations hypothécaires, garanties, 1,600 %, 15 déc. 2031	18 296	13 341
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 110, obligations hypothécaires, garanties, 3,600 %, 15 déc. 2027	—	25 112	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 104, obligations hypothécaires, garanties, 2,150 %, 15 déc. 2031	18 966	17 470
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 80, obligations hypothécaires, garanties, 2,350 %, 15 mars 2028	—	8 619	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 106, obligations hypothécaires, garanties, 2,450 %, 15 déc. 2031	—	12 563
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 82, obligations hypothécaires, garanties, 2,650 %, 15 mars 2028	—	8 239	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 107, obligations hypothécaires, garanties, 3,550 %, 15 sept. 2032	66 094	67 837
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 113, obligations hypothécaires, garanties, 3,100 %, 15 juin 2028	—	8 880	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 112, obligations hypothécaires, garanties, 3,650 %, 15 juin 2033	39 214	40 392
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 115, obligations hypothécaires, garanties, 3,950 %, 15 juin 2028	—	10 521	Fiducie du Canada pour l'habitation, série 116, obligations hypothécaires, garanties, 4,150 %, 15 juin 2033	19 895	17 361
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 85, obligations hypothécaires, garanties, 2,650 %, 15 déc. 2028	—	16 426	Canadian Core Real Estate LP, série 1, billets, premier rang, non garantis, rachetables, 3,299 %, 2 mars 2027	378	375
Fiducie du Canada pour l'habitation, série 117, obligations hypothécaires, garanties, 4,250 %, 15 déc. 2028	—	34 266	CHIP Mortgage Trust, billets, premier rang, garantis, rachetables, 6,069 %, 14 nov. 2028	465	466

Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes

(auparavant, Portefeuille BMO privé d'obligations canadiennes à court et moyen termes) (non audité)

Notes annexes (suite)

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

30 juin 2024

	Valeur comptable	Valeur comptable		Valeur comptable	Valeur comptable
Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023	Aux	30 juin 2024	31 déc. 2023
CNH Capital Canada Receivables Trust, série 2024-1 A2, titres adossés à des créances mobilières, 5,063 %, 15 août 2031	5 540	—	PSP Capital Inc., série 11, billets, premier rang, non garantis, 3,000 %, 5 nov. 2025	—	4 412
CPPIB Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,850 %, 1 ^{er} juin 2027	—	1 950	PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 0,900 %, 15 juin 2026	1 881	1 862
CPPIB Capital Inc., eurobillets à moyen terme, premier rang, non garantis, 3,000 %, 15 juin 2028	5 423	5 477	PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,500 %, 15 mars 2028	2 756	2 761
CPPIB Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 1,950 %, 30 sept. 2029	2 366	2 387	PSP Capital Inc., série 12, billets, premier rang, non garantis, 2,050 %, 15 janv. 2030	1 818	1 833
CPPIB Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,250 %, 1 ^{er} déc. 2031	1 774	1 803	PSP Capital Inc., billets, premier rang, non garantis, 2,600 %, 1 ^{er} mars 2032	2 516	2 564
Fortified Trust, série A, billets, premier rang, garantis, 3,760 %, 23 juin 2025	2 967	2 945	PSP Capital Inc., non garanties, 4,150 %, 1 ^{er} juin 2033	4 431	4 558
Fortified Trust, série A, billets, garantis, 1,964 %, 23 oct. 2026	1 414	1 396	Total	285 021	675 919
Fortified Trust, série A, billets, premier rang, garantis, 4,419 %, 23 déc. 2027	622	—	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.		
Glacier Credit Card Trust, série 2020-1, billets adossés à des créances sur cartes de crédit, premier rang, 1,388 %, 22 sept. 2025	3 361	3 305	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.		
Glacier Credit Card Trust, série 2023-1, billets adossés à des créances sur cartes de crédit, premier rang, 5,681 %, 20 sept. 2028	2 083	2 093			
Labrador-Island Link Funding Trust, série A, billets, premier rang, non garantis, 3,760 %, 1 ^{er} juin 2033	4 389	4 515			
Muskkrat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust, série A, billets, premier rang, non garantis, 3,630 %, 1 ^{er} juin 2029	—	3 525			
NRM Cabin Intermediate #1 LP, premier rang, garanties, 5,583 %, 31 juill. 2033	3 680	—			
NRM Cabin Intermediate #2 LP, premier rang, garanties, 6,630 %, 31 juill. 2033	3 166	—			

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