

PROFIL DU FONDS

AU 31 JUILLET 2022

| | |
|--------------------------------------------|------------------------|
| Symbole TSX | BLOV |
| CUSIP | 11221W109 |
| Date de création | 30 avril 2020 |
| Valeur liquidative | 23.27 \$ |
| Taux de distribution¹ | 4,4 % |
| Distribution mensuelle | 0,085 \$ |
| Actif total | 3 millions \$ |
| Frais de gestion | 0,55 % p.a. |
| Style de gestion | Quantitative/active |
| Gestionnaire/GP | Brompton Funds Limited |
| Admissibilité au compte enregistré? | Oui |
| Notation du risque | Faible à moyen |

CE FNB S'ADRESSE AUX INVESTISSEURS QUI :

- Recherchent un revenu mensuel fiable
- Recherchent une exposition aux actions tout en privilégiant un rendement en fonction du risque plutôt qu'un rendement absolu
- Sont à l'aise avec le risque sur actions

COTE ESG²

B+

MATRICE DE STYLE DES TITRES

| | | | |
|--|--------|-------|-----------------------------|
| | | | CAPITALISATION BOURSIÈRE |
| | | | |
| | | | |
| | | | Grande |
| | | | Moy |
| | | | Petite |
| | Valeur | Mixte | Croissance |

APPROCHE DE PLACEMENT

Aperçu

Ce FNB procure des distributions mensuelles en espèces stables, la possibilité de plus-value du capital et une volatilité globale des rendements de portefeuille faible en investissant dans un portefeuille de titres de participation de sociétés nord-américaines à forte capitalisation sélectionnées par Brompton, auxquelles s'ajoute un programme exclusif d'options d'achat couvertes pour augmenter le revenu mensuel. En adoptant une rigoureuse analyse fondamentale, BLOV privilégie la réduction de la volatilité totale du portefeuille en investissant dans une gamme diversifiée de titres de participation d'émetteurs nord-américains qui affichent une capitalisation boursière d'au moins 5 milliards de \$. Notre équipe de gestion de portefeuille utilise une analyse quantitative combinée à une superposition active de facteurs fondamentaux pour constituer un portefeuille ayant une volatilité globale inférieure à celle du marché.

Faits saillants du placement : actions génératrices de dividendes à faible volatilité

- Sur une période de 20 ans – y compris les deux périodes de liquidations d'actions à plus forte volatilité jamais enregistrées (2008 et 2020) – les stratégies à faible volatilité ont offert une plus grande stabilité du portefeuille et des rendements ajustés au risque plus élevés que les marchés en général des actions américaines ou canadiennes³.
- Brompton est d'avis que son approche quantitative et fondamentale mixte pour la constitution de portefeuilles à faible volatilité est une stratégie plus efficace que celle adoptée par bon nombre de FNB concurrents à faible volatilité.

Portefeuille : 31 juillet 2022

| Répartition par secteur ⁴ | % de la val. liq. | Répartition géographique ⁴ | % de la val. liq. |
|--------------------------------------|-------------------|---------------------------------------|-------------------|
| Biens de consommation de base | 28,6 % | Canada | 46,5 % |
| Services publics | 19,1 % | États-Unis | 46,3 % |
| Services de communication | 18,1 % | Pays-Bas | 3,9 % |
| Soins de santé | 16,7 % | Irlande | 2,5 % |
| Matières premières | 7,1 % | Trésorerie et plac. à court terme | 1,4 % |
| Technologie de l'information | 6,4 % | Autres passifs nets | (0,6 %) |
| Biens de consommation de base | 3,1 % | | |
| Trésorerie et plac. à court terme | 1,4 % | | |
| Autres passifs nets | (0,6 %) | | |

| 10 principaux placements | % de la val. liq. |
|---------------------------------------|-------------------|
| Johnson & Johnson | 9,2 % |
| Telus Corp | 9,1 % |
| BCE Inc | 9,0 % |
| Brookfield Infrastructure Partners LP | 7,9 % |
| Nextera Energy Inc | 6,9 % |
| Procter & Gamble Co | 6,2 % |
| Loblaw Companies Ltd | 5,7 % |
| Costco Wholesale Corp | 5,1 % |
| Franco-Nevada Corp | 4,5 % |
| Coca-Cola Co | 4,4 % |
| Total | 68,0 % |



Michael Clare
B.Com. (Spéc.), CPA, CA, CFA
Vice-président principal et
gestionnaire de portefeuille principal



Varun Choyah
M. Sc, MBA
Vice-président adjoint
Gestionnaire de portefeuille associé

Fondé en 2000, Brompton est un gestionnaire de fonds de placement expérimenté qui offre des solutions de placement axées sur le revenu, notamment des fonds négociés en bourse (FNB) et d'autres fonds de placement négociés à la bourse TSX. Nos fonds sont conçus pour répondre aux besoins de trésorerie des investisseurs et leur offrir des stratégies de diversification à valeur ajoutée. Depuis sa création, Brompton a versé plus de 3,0 milliards \$ en distributions. Pour les investisseurs qui n'ont pas besoin d'un flux de trésorerie régulier, nos fonds offrent aussi des régimes de réinvestissement des distributions sans commission pour acquérir des parts additionnelles dans le fonds. Compte tenu du niveau de service fourni, nos fonds sont connus pour leurs faibles frais de gestion et leurs faibles coûts.

Rendement historique : 31 juillet 2022

| Rendements annuels composés ⁵ | Cumul annuel | 1 AN | Depuis la création |
|-----------------------------------------------------|--------------|-------|--------------------|
| Brompton North American Low Volatility Dividend ETF | (6,9 %) | 3,3 % | 10,9 % |

⁽¹⁾ Le taux de distribution est fondé sur les cours de clôture du marché au 31 juillet 2022. Source : Thomson Reuters.

⁽²⁾ Source : Thomson Reuters au 31 juillet 2022. Reflète la moyenne pondérée de la cote ESG des sociétés détenues dans le portefeuille. La cote ESG correspond à la cote totale d'une société en fonction des informations rapportées dans les piliers environnementaux, sociaux et de la gouvernance d'entreprise. Les cotes lettrées vont de D- pour la cote ESG la plus basse à A+ pour la cote la plus élevée. Voir https://www.refinitiv.com/content/dam/marketing/en_us/documents/methodology/esg-scores-methodology.pdf pour obtenir de plus amples renseignements.

⁽³⁾ Source : Flux de données Refinitiv. Basé sur les rendements mensuels pour la période du 31 décembre 2001 au 31 juillet 2022. La faible volatilité aux États-Unis représente l'indice de rendement total MSCI États-Unis faible volatilité, l'indice américain représente l'indice de rendement total MSCI États-Unis, la faible volatilité canadienne représente l'indice de rendement total MSCI Canada faible volatilité et l'indice canadien représente l'indice de rendement total MSCI Canada.

⁽⁴⁾ Les totaux peuvent ne pas être égaux à 100 % en raison des arrondis.

⁽⁵⁾ Les rendements correspondent aux périodes terminées le 31 juillet 2022 et ne sont pas audités. Date de création le 30 avril 2020. Le tableau indique les rendements composés du FNB pour chaque période indiquée. Les rendements passés ne sont pas nécessairement une indication des rendements futurs du FNB. Les renseignements présentés sont fondés sur la valeur liquidative par part et supposent que les distributions réalisées par le FNB sur ses parts au cours de la période indiquée ont été réinvesties à la valeur liquidative par part pour acquérir des parts additionnelles du FNB.

Le présent document est uniquement un document d'information et ne constitue ni une offre de vente ni un appel à acheter les titres dont il y est question. Les opinions formulées ici n'engagent que Brompton Funds Limited (« BFL ») et peuvent être modifiées sans préavis. BFL s'efforce de s'assurer que les données viennent de sources fiables et précises. Cependant, BFL ne reconnaît aucune responsabilité en cas de perte ou de dommages, directs ou indirects, découlant de l'utilisation de ces données. BFL n'est nullement obligée de tenir à jour les renseignements fournis dans le présent document. Ces renseignements ne dispensent pas leur utilisateur de faire preuve de discernement. Veuillez lire le prospectus avant d'investir.

Les fonds de placement négociables en bourse peuvent être assujettis à des commissions, des commissions de suivi, des frais de gestion et des dépenses. Les taux de rendement indiqués sont les taux de rendement totaux composés annuels historiques, compte tenu des fluctuations de la valeur des parts et du réinvestissement de toutes les distributions et ne tiennent pas compte des commissions d'achat et de rachat, des frais de distribution ni des frais optionnels ou de l'impôt sur le revenu payables par un porteur, qui auraient pour effet de réduire le rendement. Les fonds de placement négociables en bourse ne sont pas garantis, leur valeur change souvent et leur rendement passé peut ne pas se répéter.

Certains des énoncés du présent document constituent des énoncés prospectifs au sens des lois canadiennes sur les valeurs mobilières. Les énoncés prospectifs peuvent porter sur les questions abordées dans le document et sur d'autres questions traitées dans les documents publics concernant le FNB, sur les perspectives du FNB et sur les événements ou résultats attendus, y compris sur le rendement financier futur du FNB. Ces énoncés prospectifs se reconnaissent parfois à l'emploi de termes comme « pouvoir », « devoir », « prévoir », « planifier », « s'attendre à », « croire », « estimer », « prédire », « potentiel », « continuer » ou d'autres expressions similaires décrivant des questions qui ne sont pas des faits avérés. Les résultats réels peuvent différer des énoncés prospectifs. Les investisseurs ne devraient pas se fier indûment à ces déclarations prospectives. Ces déclarations prospectives sont présentées à la date du présent document, et nous ne nous engageons aucunement à les mettre à jour ou à les réviser en fonction de nouveaux faits ou de nouvelles circonstances.

Relations avec les investisseurs

TÉLÉPHONE 416.642.6000
SANS FRAIS 1.866.642.6001
TÉLÉCOPIEUR 416.642.6001
EMAIL info@bromptongroup.com

Website

www.bromptongroup.com

Address

Bay Wellington Tower,
Brookfield Place
181 Bay Street
Suite 2930, Box 793
Toronto, Ontario M5J 2T3