

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret (auparavant le Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu Marret)

Sommaire du Portefeuille de placement au 31 mars 2020

Catégorie	% de l'actif net	Catégorie	% de l'actif net	Les 25 titres	% de l'actif net
Répartition par pays		Répartition par secteur			
Positions acheteur		Positions acheteur			
É.-U.	52,8	Obligations d'État étrangères	34,2	Trésorerie et équivalents de trésorerie	14,7
Canada	29,4	Obligations de sociétés	25,5	Gouvernement du Canada, 2,25 %, 01/06/2029	10,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	14,7	Obligations d'État canadiennes	22,8	Billets/obligations du Trésor américain, 1,125 % %, 28/02/2025	7,2
Autres actifs (passifs) nets	2,3	Trésorerie et équivalents de trésorerie	14,7	Gouvernement du Canada, 1,5 %, 01/09/2024	7,0
Placements à court terme	1,5	Autres actifs (passifs) nets	2,3	Billets/obligations du Trésor américain, 1,375 % %, 31/01/2025	5,1
Île de Jersey	0,2	Placements à court terme	1,5	Billets/obligations du Trésor américain, 1,75 % 31/12/2024	5,1
Mexique	0,1	Contrat(s) de change à terme	(0,9)	Billets/obligations du Trésor américain, 1,5 % 30/09/2024	5,0
Contrat(s) de change à terme	(0,9)	Total des positions acheteur	100,1	Gouvernement du Canada, 2,75 %, 01/12/2048	3,8
Total des positions acheteur	100,1	Positions vendeur		CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 5,25 % %, 30/09/2022	2,5
Positions vendeur		Contrat(s) à terme standardisé(s)	(0,1)	Valeant Pharmaceuticals International Inc., 6,5 % 15/03/2022	2,1
Contrat(s) à terme standardisé(s)	(0,1)	Total des positions vendeur	(0,1)	Billets/obligations du Trésor américain, 1,5 % 15/02/2030	1,8
Total des positions vendeur	(0,1)			Billets/obligations du Trésor américain, 0,5 % 31/03/2025	1,8
				Billets/obligations du Trésor américain, 1,875 % %, 30/06/2026	1,7
				Billets/obligations du Trésor américain, 2,125 % %, 31/03/2024	1,6
				Placements à court terme	1,5
				Equinix Inc., 5,875 %, 15/01/2026	1,4
				T-Mobile USA Inc., 6 %, 01/03/2023	1,2
				Billets/obligations du Trésor américain, 1,625 % %, 30/06/2021	1,2
				Reynolds Group Issuer Inc./Reynolds Group Issuer LLC, 5,33125 %, 15/07/2021	1,1
				Billets/obligations du Trésor américain, 2,5 % 31/12/2020	1,0
				DISH DBS Corp., 5,125 %, 01/05/2020	1,0
				Valeant Pharmaceuticals International Inc., 7 % 15/03/2024	1,0
				Tenet Healthcare Corp., 4,625 %, 15/07/2024	1,0
				Gouvernement du Canada, 1 %, 01/06/2027	0,9
				Billets/obligations du Trésor américain, 1,75 % 30/06/2024	0,8
				Total de l'actif net (en milliers de dollars)	205 762 \$

L'aperçu du portefeuille peut changer par suite des opérations effectuées dans le Fonds. Des mises à jour sont publiées chaque trimestre.

Le prospectus et d'autres renseignements par rapport au Fonds sont disponibles sur Internet au www.ci.com.