

Fonds alternatif d'obligations à rendement absolu CI Marret

Sommaire du Portefeuille de placement au 31 mars 2021

| 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. | 54,4 | Obligations d'État canadiennes et obligations garanties | 14,5 | Trésorerie et équivalents de trésorerie | 5,3 |
| Canada | 25,8 | Services de communication | 12,4 | Gouvernement du Canada, 0,5 %, 01/09/2025 | 4,0 |
| Autres actifs nets (passifs) | 7,4 | Soins de santé | 8,1 | Gouvernement du Canada, 0,5 %, 1er décembre 2030 | 3,5 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 5,3 | Biens de consommation discrétionnaire | 8,0 | Obligation du Trésor américain, 1,125 %, 15 février 2031 | 2,9 |
| Fonds négocié(s) en bourse | 4,2 | Énergie | 7,5 | Tenet Healthcare Corp., rachetables, 4,625 % 07/15/2024 | 2,7 |
| Placement(s) à court terme | 2,9 | Autres actifs nets (passifs) | 7,4 | Gouvernement du Canada, 1,5 %, 01/09/2024 | 2,0 |
| R.-U. | 0,8 | Produits industriels | 6,1 | iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF | 2,0 |
| Pays-Bas | 0,7 | Obligations fédérales américaines et obligations garanties | 5,8 | iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF | 1,9 |
| Irlande | 0,5 | Biens de consommation de base | 5,7 | Gouvernement du Canada, 2 %, 01/12/2051 | 1,9 |
| Contrat(s) de change à terme | 0,4 | Trésorerie et équivalents de trésorerie | 5,3 | Gouvernement du Canada, 1,25 %, 01/03/2025 | 1,7 |
| Jersey | 0,3 | Services financiers | 4,5 | United States Obligation du Trésor, 1,625 %, 15 novembre 2050 | 1,6 |
| Luxembourg | 0,3 | Fonds négocié(s) en bourse | 4,2 | T-Mobile USA Inc., rachetable, 6,5 % 15 janvier 2026 | 1,2 |
| Bermudes | 0,3 | Technologies de l'information | 4,1 | Ford Motor Credit Co, LLC, taux flottant, 12/10/2021 | 1,1 |
| France | 0,2 | Matériaux | 3,5 | CSC Holdings LLC, rachetable, 4,125 %, 01/12/2030 | 1,0 |
| Allemagne | 0,1 | Placement(s) à court terme | 2,9 | WPX Energy Inc., rachetable, 5,75 1er juin % 2026 | 1,0 |
| Îles Caïmans | 0,1 | Immobilier | 2,0 | CommScope Finance LLC, rachetables, 5,5 % 03/01/2024 | 0,9 |
| Australie | 0,0 | Services publics | 1,1 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., rachetable, 4,25 %, 01/02/2031 | 0,9 |
| Mexique | 0,0 | Contrat(s) de change à terme | 0,4 | DCP Midstream LLC, rachetable, 4,75 %, 30 septembre 2021 | 0,8 |
| Îles Marshall | 0,0 | Obligations provinciales et obligations garanties | 0,2 | Ford Motor Credit Co. LLC, taux flottant, 5 avril 2021 | 0,8 |
| Total des positions acheteur | 103,7 | Total des positions acheteur | 103,7 | Itron Inc., rachetable, 5 % 15 janvier 2026 | 0,8 |
| Positions vendeur | | Positions vendeur | | 1011778 B.C. ULC / New Red Finance Inc., rachetable, 4,25 %, 15/05/2024 | 0,7 |
| Canada | (0,5) | Énergie | (0,1) | DaVita Inc., rachetable, 4,625 %, 1er juin 2030 | 0,7 |
| Contrat(s) à terme standardisé(s) | (0,9) | Produits industriels | (0,1) | Cablevision Lightpath LLC, rachetable, 3,875 %, 15 septembre 2027 | 0,7 |
| É.-U. | (2,3) | Obligations d'État canadiennes et obligations garanties | (0,5) | MEG Energy Corp., rachetable, 6,5 % 15 janvier 2025 | 0,6 |
| Total des positions vendeur | (3,7) | Contrat(s) à terme standardisé(s) | (0,9) | Obligation du Trésor américain, 1,875 %, 15 février 2051 | 0,6 |
| | | Obligations fédérales américaines et obligations garanties | (2,1) | Total de l'actif net (en milliers de dollars) | 825 992 \$ |
| | | Total des positions vendeur | (3,7) | | |

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.

