

GLOBAL DIVERSIFIED INVESTMENT GRADE INCOME TRUST

APERÇU DU PORTEFEUILLE

AU 30 SEPTEMBRE 2007

APERÇU DU PORTEFEUILLE AU 30 SEPTEMBRE 2007

Le portefeuille de Global Diversified Investment Grade Income Trust est formé des instruments suivants :

1. Contrats de swap A, B, C, D, E et F totalisant 1 491 116 000 \$;
2. Billet à taux variable noté AAA de Bayerische Landesbank, totalisant 1 400 000 000 \$;
3. Billet de dépôt à terme noté A de la Banque Nationale du Canada, totalisant 70 312 933 \$;
4. Montant à recevoir de 16 903 736 \$ portant intérêt aux termes des contrats de swap D, E et F.

La Fiducie procure une exposition à une tranche mezzanine de trois portefeuilles de titres adossés à des créances hypothécaires, de titres adossés à des créances mobilières et de positions structurées sur des dettes de sociétés (les « obligations de référence »). Veuillez vous reporter à l'annexe A pour une description détaillée des positions crédit dans les obligations de référence. Les swaps A, B et C sont des positions de premier rang et comprennent les mêmes obligations de référence que les swaps D, E et F, les positions mezzanines. Les swaps D, E et F bénéficient d'un montant de perte initiale représentant respectivement 0,95%, 1,60% et 0,80%. La prochaine mise à jour sera intégrée dans le Rapport de la direction sur le rendement du fonds du 31 décembre 2007.

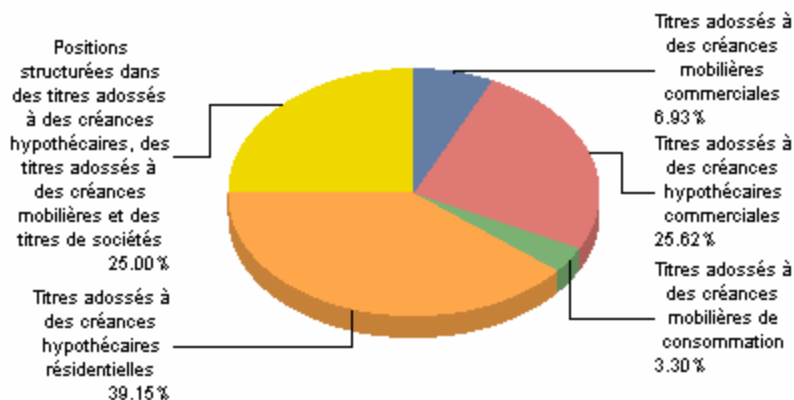
Événement subséquent

Le 13 novembre 2007, la Fiducie a annoncé qu'elle a effectué une modification à ses trois Contrats de swap sur défaillance de crédit avec MMAI-I Trust. En raison de cette modification, la Fiducie ne subira aucune perte aux termes d'un Contrat de swap sur défaillance de crédit en raison d'événements de crédit relatifs à des titres adossés à des créances hypothécaires, des titres adossés à des créances mobilières, et d'autres titres à revenu fixe compris dans le portefeuille d'obligations de référence afférant à ce Contrat de swap sur défaillance de crédit tant que les positions corporatives synthétiques de ce portefeuille ne sont pas en défaut et que leur montant nominal n'ait pas été réduit à zéro.

De plus, aux termes de la modification, le critère d'admissibilité dans chaque portefeuille des obligations de référence (à l'exception des positions corporatives synthétiques) font l'objet de restrictions, y compris une exigence voulant que toutes les obligations de référence aient une notation minimum de AA+ ou Aa1 lorsqu'elles sont ajoutées à un portefeuille.

Le graphique qui suit fournit le détail des obligations de référence par catégorie d'actif :

Détail par catégorie d'actif



Pondération selon la notation équivalente de S&P au 30 septembre 2007

| | Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) | Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) | Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) | Total |
|--|--|--|--|---------|
| AAA | 68,49 % | 62,93 % | 50,45 % | 60,62 % |
| AA+ | 1,09 % | 6,13 % | 8,25 % | 5,16 % |
| AA | 15,18 % | 12,48 % | 19,92 % | 15,86 % |
| AA- | 0,78 % | 0,49 % | 6,68 % | 2,65 % |
| A+ | 3,08 % | 3,77 % | 2,19 % | 3,01 % |
| A | 11,38 % | 11,02 % | 9,02 % | 10,47 % |
| A- | 0,00 % | 2,96 % | 3,49 % | 2,15 % |
| BBB | 0,00 % | 0,22 % | 0,00 % | 0,07 % |
| Total | 100,0 % | 100,0 % | 100,0 % | 100,0 % |
| Pourcentage du portefeuille total | 33,33 % | 33,33 % | 33,33 % | 100,0 % |

ANNEXE A

| Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| Credit Select | 2004-1 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-2 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-3 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-4 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-5 C | | A* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| ACE SECURITIES CORP | 2004-FM2 | US004421GK37 | AA | A2 | 0.86% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ACE SECURITIES CORP | 2004-OP1 | US004421EX75 | AA | A2 | 1.04% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ACT 2005-RR DEPOSITOR CORP. | 2005-RR | US00503NAA90 | AAA | NR | 1.75% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| AEGIS ASSET BACKED SECURITIES TRUST | 2004-6 | US00764MCU99 | A | A2 | 0.51% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| AIRCASTLE AIRCRAFT LEASE BACKED TRUST | 2006-1 | US00505HAA05 | AAA | Aaa | 2.35% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| ALEUTIAN INVESTMENTS LLC | | US01446EAF60 | AAA | Aaa | 1.98% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| ANNINGTON FINANCE NO. 4 PLC | B3 | XS0198259813 | A | A2 | 0.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ARBOR REALTY MORTGAGE SECURITIES SERIES 2004-1, LTD | 2004-1 | US03877VAA35 | AAA | Aaa | 0.78% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ARGENT SECURITIES INC | 2004-W10 | US040104LM10 | AAA | Aaa | 0.85% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY | 2004-HE7 | US04541GLZ36 | AAA | Aaa | 0.28% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY | 2005-HE2 | US04541GQD78 | A | A2 | 0.01% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| AVIATION CAPITAL GROUP TRUST | 2003-2 | US004448AA42 | AAA | Aaa | 1.58% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-2A | US07324SBN18 | AAA | Aaa | 1.94% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST 2005-4 | 2005-4A | US07324SCR13 | AAA | Aaa | 2.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BRASCAN REAL ESTATE FINANCIAL PARTNERS LLC | 2004-1 | US10550TAA79 | AAA | Aaa | 0.78% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| CAPITAL ONE MULTI-ASSET EXECUTION TRUST | | XS0203199509 | A | A2 | 0.26% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| CAPITAL TRUST RE CDO LTD. | 2004-1A | US140574AA24 | AAA | Aaa | 2.18% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| CAPITALSOURCE COMMERCIAL LOAN TRUST | 2006-2A | US14056GAC24 | AAA | Aaa | 2.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| CHL MORTGAGE PASS-THROUGH TRUST 2004-29 | 2004-29 | US12669GJC69 | AAA | Aaa | 0.50% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | | US12667FU603 | AAA | Aaa | 2.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ASSET BACKED CERTIFICATES | 2004-AB1 | US126673HG04 | AAA | Aaa | 1.86% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| DOWNEY SAVINGS AND LOAN ASSOCIATION, FA | 2004-AR1 | US23332UAC80 | AAA | Aaa | 0.30% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| DUKE WEEKS INDUSTRIAL TRUST | 2000-DW1 | US36228CHK27 | AAA | Aaa | 2.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| FIXED-LINK FINANCE BV | G2-X | XS0125468230 | AAA | Aaa | 0.82% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| FRANS 2003 PLC | | XS0171588055 | NR | Aaa | 1.09% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| FREMONT HOME LOAN TRUST | 2004-D | US35729PGF18 | A+ | A1 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| FREMONT HOME LOAN TRUST | 2004-D | US35729PGG90 | A | A2 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GALP INVESTMENT PLC | 1 | XS0171061475 | NR | Aaa | 1.53% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| GSA TRUST | 2004-11 | US36242DQF32 | AAA | Aaa | 0.45% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HERTZ VEHICLE FINANCING LLC | 2005-2A | US42805RAS85 | AAA | Aaa | 2.26% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-AR8 | US45660N2L88 | AAA | Aaa | 0.73% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INTERMODAL CHASSIS ISSUANCE, LLC | 2003-1 | US45881WAA62 | AAA | Aaa | 0.70% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| JETBLUE AIRWAYS CORP | 2004-2 | US47714NAA54 | AAA | Aaa | 1.51% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| KAZKOMMERTS DPR COMPANY | 2006-B | XS0256195016 | AAA | Aaa | 2.24% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| LNR CDO LTD. | 2006-1A | US53944MAD11 | A | A2 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS, INC. | 2004-WMC5 | US59020UMJ15 | AA | A1 | 0.98% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS, INC. | 2004-WMC5 | US59020UMK87 | AA | A2 | 0.86% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-HE6 | US61744CFE12 | A | A2 | 0.84% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-HE7 | US61744CGG50 | A | A2 | 0.78% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-HE8 | US61744CHD11 | A+ | A1 | 1.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-HE9 | US61744CJW73 | A+ | A1 | 0.69% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-NC1 | US61744CAX48 | A | A2 | 0.52% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY DEAN WITTER CAPITAL I INC | 2003-NC4 | US61746WF544 | AA+ | Aaa | 1.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2004-3 | 2004-3 | US64352VHY02 | AA- | A1 | 0.78% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2004-3 | 2004-3 | US64352VHZ76 | A | A2 | 0.70% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| OPTION ONE MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-2 | US68389FFH29 | AA | A2 | 1.43% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| PAN-EUROPEAN INDUSTRIAL PROPERTIES | 2 | XS0148289746 | AAA | Aaa | 2.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PAN-EUROPEAN INDUSTRIAL PROPERTIES | 3 | XS0163580458 | AAA | Aaa | 1.35% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PAN-EUROPEAN INDUSTRIAL PROPERTIES | 3 | XS0163580615 | AAA | Aa2 | 0.52% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PARK PLACE SECURITIES INC | 2004-WCW1 | US70069FAA57 | AAA | Aaa | 0.02% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| PUMA MASTERFUND P9 | P9 | AU300PUMA029 | AAA | Aaa | 1.01% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| RAIT CRE CDO LTD. | 2006-1A | US751020AE81 | A | A2 | 0.29% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| RASPRO TRUST | 2005-1 | US75405RAA14 | AAA | Aaa | 1.81% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 1 (Positions crédit A et D) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| RESIDENTIAL ASSET SECURITIES TRUST | 2005-A5 | US45660LJX82 | AAA | Aaa | 2.15% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC | 2004-OP1 | US81375WAC01 | A | A2 | 1.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SLM STUDENT LOAN TRUST | 2003-C | US78443CAZ77 | AAA | Aaa | 1.92% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| SMART HOME REINSURANCE LIMITED | 2006-1X | US83170GAE44 | A+ | A1 | 1.04% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SOUTHERN PACIFIC SECURITIES D PLC | GX | XS0170183700 | AAA | Aaa | 0.28% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| STRUCTURED ADJUSTABLE RATE MORTGAGE LOAN TRUST | | US863579WU83 | AAA | Aaa | 0.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| TERWIN MORTGAGE TRUST | 2004-9HE | US881561JW56 | AAA | Aaa | 2.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| TERWIN MORTGAGE TRUST | 2004-HE11 | US881561SA36 | AAA | Aaa | 0.21% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| TERWIN MORTGAGE TRUST 2003-8, LLC | 2003-8HE | US881561CX03 | AAA | Aaa | 0.11% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| THE SUPERANNUATION MEMBERS HOME LOAN PROGRNO | 2003-2 | AU300SF40035 | AAA | Aaa | 1.72% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WASHINGTON MUTUAL | | US92922FZV39 | AAA | Aaa | 0.62% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WASHINGTON MUTUAL | 2005-AR8 | US92922FS583 | AAA | Aaa | 2.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WRIGHTWOOD CAPITAL REAL ESTATE CDO LTD | 2005-1A | US982512AA32 | AAA | Aaa | 2.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| Credit Select | 2004-1 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-2 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-3 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-4 C | | A* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-5 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| ABACUS LTD | 2006-NS1 | US002573AA19 | AAA | Aaa | 1.58% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ABACUS LTD | 2006-NS1 | US002573AC74 | AA | Aa2 | 0.88% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ABACUS LTD | 2006-NS1 | US002573AD57 | AA- | Aa3 | 0.27% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ACCREDITED MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-3 | US004375BP58 | AAA | Aaa | 0.22% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ACE SECURITIES CORP. | 2005-HE1 | US004421KY84 | A | A2 | 0.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ALEUTIAN INVESTMENTS LLC | | US01446EAF60 | AAA | Aaa | 1.10% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| ANNINGTON FINANCE NO. 4 PLC | B3 | XS0198259813 | A | A2 | 0.78% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ANSONIA CDO LTD. | 2006-1A | US036510AA39 | AAA | Aaa | 0.86% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ANTHRACITE CDO, LTD. | 2006-HY3A | US03703FAG54 | A | A2 | 0.28% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ARBOR REALTY MORTGAGE SECURITIES SERIES 2004-1, LTD | 2004-1 | US03877VAA35 | AAA | Aaa | 2.07% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| ARBOR REALTY MORTGAGE SECURITIES SERIES 2005-1, LTD | 2005-1A | US038927AA73 | AAA | Aaa | 1.98% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ARGENT SECURITIES INC. | 2006-W1 | US040104RM55 | A+ | A2 | 0.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| BAMBURGH FINANCE PLC | 1 | XS0159966257 | AAA | NR | 0.35% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-1 | US07324SBF83 | NR | Aaa | 0.25% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-2A | US07324SBN18 | AAA | Aaa | 0.64% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-2A | US07324SBP65 | NR | Aaa | 1.97% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-3A | US07324SCB60 | AAA | Aaa | 0.86% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST 2005-4 | 2005-4A | US07324SCR13 | AAA | Aaa | 0.99% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES INC. | 2005-T18 | US07383F5M69 | NR | Aaa | 1.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BRASCAN REAL ESTATE FINANCIAL PARTNERS LLC | 2004-1 | US10550TAA79 | AAA | Aaa | 1.32% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BRASCAN REAL ESTATE FINANCIAL PARTNERS LLC | 2004-1 | US10550TAB52 | AA | Aa2 | 0.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BRASCAN REAL ESTATE FINANCIAL PARTNERS LLC | 2004-1 | US10550TAC36 | A- | A3 | 0.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BRASCAN STRUCTURED NOTES 2005-2 LTD | 2005-2A | US10550YAA64 | AAA | Aaa | 1.98% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| CAPMARK VII-CRE LTD | 2006-7 | US14068XAB38 | AAA | Aaa | 0.77% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| CHL MORTGAGE PASS-THROUGH TRUST 2004-25 | 2004-25 | US12669GKJ93 | AAA | Aaa | 0.84% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2005-51 | US12668ADE29 | A | A2 | 0.71% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2005-J2 | US12667F6A87 | AAA | NR | 1.39% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2006-OA12 | US23243AAP12 | BBB | A3 | 0.22% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ASSET BACKED CERTIFICATES | 2004-11 | US126673LV25 | A+ | NR | 1.00% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ASSET BACKED CERTIFICATES | 2004-5 | US1266716H42 | AAA | Aaa | 0.24% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES | 2006-8 | US045427AJ09 | A | A2 | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE HOME LOANS | 2004-4 | US12669GUS82 | AAA | Aaa | 0.85% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE HOME LOANS | 2005-1 | US12669GRN33 | AAA | Aaa | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE HOME LOANS | 2005-3 | US12669GTT84 | AAA | Aaa | 0.24% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| DOWNEY SAVINGS AND LOAN ASSOCIATION, FA | 2004-AR1 | US23332UAA25 | AAA | Aaa | 1.23% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| DOWNEY SAVINGS AND LOAN ASSOCIATION, FA | 2004-AR1 | US23332UAB08 | AAA | Aaa | 0.72% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| DSLA MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-AR4 | US23332UBW36 | AAA | Aaa | 0.43% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| DSLA MORTGAGE LOAN TRUST | 2005-AR1 | US23332UCN28 | AAA | Aaa | 0.96% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR5 | US39538AAN63 | AA+ | Aaa | 1.32% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR5 | US39538AAV89 | NR | A3 | 0.66% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-Ar4 | US39539FAU84 | NR | A1 | 0.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2007-AR1 | US39539KAJ25 | AA+ | Aaa | 0.56% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2007-AR2 | US39539LAR24 | NR | A2 | 0.22% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR3 | 2006-AR3 | US39538WHM38 | AA- | Aa2 | 0.22% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR3 | 2006-AR3 | US39538WHP68 | A | Aa3 | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MTA TRUST 2005-AR2 | 2006-AR6 | US39538BAK08 | AA+ | Aaa | 0.66% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MTA TRUST 2006-AR6 | 2006-AR6 | US39538BAQ77 | NR | A2 | 0.40% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GSAMP TRUST | | US362334PR94 | A | A3 | 0.35% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBOR SPC 2006-2 | 2006-2 | US41154JAA43 | AAA | Aaa | 1.32% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST SERIES 2006-9 | 2006-9 | US41161XAJ54 | A- | A1 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HOME EQUITY ASSET TRUST | 2004-7 | US437084FW18 | A+ | A2 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HOME EQUITY ASSET TRUST | 2006-4 | US437084VV50 | A+ | A2 | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-AR14 | US45660LAD10 | AAA | Aaa | 1.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-AR8 | US45660N2L88 | AAA | Aaa | 0.40% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2005-AR2 | US45660LCM90 | AAA | Aaa | 0.66% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| JETBLUE AIRWAYS CORP | 2004-2 | US47714NAB38 | AAA | Aaa | 0.48% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| JETBLUE AIRWAYS PTC 2004-1 | 2004-1 | US47714RAA68 | AAA | Aaa | 0.50% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| JETBLUE AIRWAYS PTC 2004-2 | 2004-1 | US47714RAB42 | AAA | Aaa | 0.53% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP | | US46626LJW19 | A- | A3 | 0.31% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| LEHMAN XS TRUST | 2005-9N | US525221GN14 | AAA | Aaa | 1.13% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| LEHMAN XS TRUST | 2006-10N | US525229AF79 | AAA | Aaa | 0.66% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| LEHMAN XS TRUST | 2006-GP3 | US525228AV47 | A- | Aa3 | 1.06% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MASTR ASSET BACKED SECURITIES TRUST | 2006-NC1 | US57643LNL61 | A+ | A2 | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|------------------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| ML AJ CMBS PORTFOLIO | | AJ_CMBSPORT_C992167M_C | AAA | Aaa | 0.35% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ML AJ CMBS PORTFOLIO | | AJ_CMBSPORT | AAA | Aaa | 0.88% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2003-NC5 | US61746RBC43 | AA+ | Aaa | 0.81% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-HE9 | US61744CJY30 | A- | A3 | 0.35% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-NC6 | US61744CEV46 | A | A2 | 0.84% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2006-WMC2 | US61749KAL70 | A | A2 | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY DEAN WITTER CAPITAL I INC | 2003-NC3 | US61745MPN73 | A | Aa3 | 0.07% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| N-STAR REAL ESTATE CDO LTD | | US62939WAA36 | AAA | Aaa | 1.91% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| NEWCASTLE CDO IV, LIMITED | 2004-4A | US65105YAA01 | AAA | Aaa | 2.18% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PAN-EUROPEAN INDUSTRIAL PROPERTIES | 3 | XS0163580458 | AAA | Aaa | 0.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PETRA CRE CDO LTD | 2007-1A | US716424AA49 | AAA | Aaa | 0.44% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| RELIANCE RAIL FINANCE PT | 3 | AU3FN0001491 | AAA | Aaa | 1.32% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |
| RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORPORATION | 2004-KS4 | US76110WXW18 | AAA | Aaa | 0.92% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORPORATION | 2004-KS9 | US76110WF272 | AAA | Aaa | 0.44% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| RESIDENTIAL ASSET SECURITIES TRUST | 2005-A5 | US45660LJX82 | AAA | Aaa | 1.63% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SEAWALL SPC | 2006-4A | US81273YAB11 | AAA | Aaa | 2.06% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC | 2004-OP2 | US81375WBP05 | A+ | A2 | 0.79% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SLM PRIVATE CREDIT STUDENT LOAN TRUST 2003-12 | 2003-12 | US78442GKD78 | AA+ | Aa1 | 1.36% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| SLM STUDENT LOAN TRUST | 2003-C | US78443CAZ77 | AAA | Aaa | 1.30% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| SLM STUDENT LOAN TRUST 2002-4 | 2003-1 | US78442GFJ04 | AA+ | Aa1 | 0.88% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| SLM STUDENT LOAN TRUST 2003-7 | 2003-7 | US78442GHK58 | AA | Aa1 | 1.14% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| STRUCTURED ADJUSTABLE RATE MORTGAGE LOAN TRUST | 2005-19XS | US863579YT92 | AAA | Aaa | 0.25% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS II INC | 2006-AR7 | US86361HAU86 | AA+ | Aaa | 0.54% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC | 2006-AR1 | US86359LTK51 | AAA | Aaa | 0.34% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS, INC | 2005-AR7 | US86359LPZ66 | AAA | Aaa | 0.59% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| TERWIN MORTGAGE TRUST | 2004-9HE | US881561JW56 | AAA | Aaa | 0.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| TITAN EUROPE 2006-3 PLC | 2006-3A | XS0257769769 | A | A3 | 0.21% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| TORRENS TRUST | 2004-1 | AU300PTT4026 | AAA | Aaa | 1.09% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| UNITED CAPITAL AVIATION TRUST | | US90264FAE88 | AAA | Aaa | 2.08% | Titres adossés à des créances mobilières commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 2 (Positions crédit B et E) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| WASHINGTON MUTUAL | | US92922FZV39 | AAA | Aaa | 1.33% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WASHINGTON MUTUAL | 2005-AR11 | US92922F2P29 | AAA | Aaa | 0.63% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| Credit Select | 2004-1 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-2 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-3 C | | A* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-4 B | | AA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| Credit Select | 2004-5 A | | AAA* | NR | 5.00% | Positions structurées sur des dettes de sociétés |
| ABACUS LTD | 2006-10 | US00257AAB35 | NR | Aa1 | 0.73% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ABACUS LTD | 2006-10 | US00257AAD90 | NR | Aa3 | 0.87% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ABACUS LTD | 2006-17A | US002578AB88 | AAA | Aaa | 5.04% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| ACE SECURITIES CORP | 2004-HE4 | US004421JH70 | AA+ | Aa1 | 0.41% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ACE SECURITIES CORP | 2005-RM2 | US004421NY57 | A | A3 | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC. | 2004-R10 | US03072SVQ55 | AAA | Aaa | 0.07% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC. | 2004-R10 | US03072SVS12 | AA | Aa2 | 1.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ARMS II | XIII | AU300ARML032 | AAA | Aaa | 2.38% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY | 2004-HE1 | US04541GHL95 | AA | Aa2 | 1.65% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | | US07324SAX09 | AAA | Aaa | 0.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2004-2 | US07324SAR31 | AAA | Aaa | 1.22% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-1 | US07324SBF83 | NR | Aaa | 0.62% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST | 2005-3A | US07324SCB60 | AAA | Aaa | 4.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES, INC. | | US073879X453 | AA | NR | 1.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| CBRE REALTY FINANCE CDO, LTD. | 2007-1A | US1248MLAE37 | AAA | Aaa | 1.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| CC MORTGAGE FUNDING CORPORATION | 2003-3A | US16678RAB33 | AAA | Aaa | 0.27% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| CC MORTGAGE FUNDING CORPORATION | 2003-4 | US16678RAK32 | AAA | Aaa | 0.39% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | | US02146QAM50 | AA | Aa1 | 1.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2005-56 | US12668ALY90 | AA+ | Aa1 | 1.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2005-56 | US12668AMB88 | A+ | A1 | 0.52% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST | 2006-OA2 | US126694S743 | AA+ | Aa1 | 1.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| COUNTRYWIDE ASSET BACKED CERTIFICATES | 2004-10 | US126673JX19 | AA- | A2 | 0.52% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| CREST 2002-1 LTD | 2002-IG | USG2550JAA90 | AAA | Aaa | 1.89% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| DOWNEY SAVINGS AND LOAN ASSOCIATION, FA | 2004-AR1 | US23332UAB08 | AAA | Aaa | 0.55% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| ENCORE CREDIT RECEIVABLES TRUST 2005-2 | 2005-2 | US126673J522 | AA- | A2 | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| FBR SECURITIZATION TRUST 2005-4 | 2005-4 | US30246QCA94 | AA- | A3 | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GRAPHITE MORTGAGES PLC | 2006-1 | GRAPH_LSS | AAA | NR | 2.20% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2005-AR4 | US39538WCN65 | A+ | A3 | 0.38% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR1 | US39538WFM55 | AAA | Aaa | 0.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR4 | US39539FAT12 | A- | Aa3 | 0.87% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR5 | US39538AAN63 | AA+ | Aaa | 1.70% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST | 2006-AR5 | US39538AAQ94 | NR | Aa1 | 1.84% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| GSAMP TRUST | 2005-NC1 | US36242DUH42 | A | A2 | 0.68% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST | 2005-1 | US41161PLE15 | AAA | Aaa | 1.14% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST SERIES 2006-12 | 2006-12 | US41162DAN93 | A- | A2 | 0.58% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST SERIES 2006-7 | 2006-7 | US41161VAH33 | AA | Aa3 | 1.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST SERIES 2006-9 | 2006-9 | US41161XAG16 | AA- | Aa1 | 1.81% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST SERIES 2006-9 | 2006-9 | US41161XAJ54 | A- | A1 | 0.19% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST, SERIES 2004-11 | 2004-11 | US41161PJZ71 | AAA | Aaa | 0.98% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HOME EQUITY ASSET TRUST | 2003-3 | US22541N3S63 | AA | Aa1 | 0.94% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| HOME EQUITY ASSET TRUST | 2004-7 | US437084FL52 | AAA | Aaa | 0.17% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| IMPAC CMB TRUST | 2004-9 | US45254NKY21 | AAA | Aaa | 0.19% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-AR14 | US45660LAD10 | AAA | Aaa | 0.95% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2006-AR2 | US45661EAL83 | AA- | A1 | 0.34% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST | 2006-Ar4 | US45661EAZ79 | AA+ | Aa1 | 0.87% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| LAGONDA 2006-2 | 2006-2 | LAGONDA062A | AAA | Aaa | 0.63% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| LEHMAN XS TRUST | 2006-GP3 | US525228AV47 | A- | Aa3 | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| LONG BEACH MORTGAGE LOAN TRUST | 2004-4 | US542514HY37 | A+ | A3 | 0.34% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MASTER ADJUSTABLE RATE MORTGAGES TRUST | 2004-WMC2 | US57643LDK98 | A | A2 | 0.26% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS, INC. | 2005-WMC2 | US59020UWN17 | A | A3 | 0.58% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MESA WEST CAPITAL CDO LTD | 2007-1A | US59066XAA28 | AAA | Aaa | 1.65% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I | 2004-NC1 | US61744CAX48 | A | A2 | 0.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| MORGAN STANLEY HOME EQUITY LOANS 2005-1 | 2005-1 | US61744CLJ35 | A | A2 | 0.61% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| N-STAR REAL ESTATE CDO 2006-8 | 2006-8A | US62940FAC32 | NR | Aaa | 3.49% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| NATIONAL COLLEGIATE STUDENT LOAN TRUST | 2005-2 | US63543PBT21 | AAA | Aaa | 0.78% | Titres adossés à des créances mobilières de consommation |
| NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2004-3 | 2004-3 | US64352VJA08 | A- | A3 | 0.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| NOMURA CRE CDO LTD | 2007-2A | US65537HAE71 | AA- | Aa3 | 1.01% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |
| PARK PLACE SECURITIES INC | 2004-WHQ2 | US70069FEK93 | AA- | Aa3 | 1.16% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| PEOPLE'S CHOICE HOME LOAN SECURITIES TRUST | 2005-4 | US71085PDK66 | AA | A1 | 0.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| PUMA MASTERFUND P9 | P9 | AU300PUMA029 | AAA | Aaa | 1.97% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| RMAC | 2003-NS3X | XS0177532743 | AAA | Aaa | 2.03% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SAXON ASSET SECURITIES TRUST | 2005-1 | US805564RS25 | A- | A3 | 0.53% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SEAWALL SPC | 2006-4A | US81273YAB11 | AAA | Aaa | 1.00% | Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales |

ANNEXE A

| Portefeuille 3 (Positions crédit C et F) - Émetteur | Série | ISIN | Note de S&P | Note de Moody's | Concentration | Catégorie d'actif |
|---|-----------|--------------|-------------|-----------------|---------------|--|
| SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC | 2004-OP1 | US81375WAC01 | A | A2 | 0.34% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC | 2004-OP2 | US81375WBP05 | A+ | A2 | 0.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SG MORTGAGE SECURITIES TRUST | 2006-FRE1 | US81879MBC29 | A | A3 | 0.57% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SMHL GLOBAL FUND NO. 3 | 3 | AU000GLO3017 | AA | Aa2 | 0.00% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST | 2006-WF2 | US83612MAL19 | NR | A3 | 0.29% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS II INC | 2006-AR3 | US86360KAL26 | AA | Aa1 | 1.46% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| THE SUPERANNUATION MEMBERS HOME LOAN PROGRNO | 2003-2 | AU300SF40035 | AAA | Aaa | 3.39% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WASHINGTON MUTUAL | 2005-AR19 | US92925CBQ42 | A+ | A2 | 0.48% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |
| WASHINGTON MUTUAL | 2005-AR2 | US92922FD700 | AAA | Aaa | 0.44% | Titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles |