

DIVERSIFIED INVESTMENT GRADE INCOME TRUST

APERÇU DU PORTEFEUILLE

AU 31 MARS 2007

APERÇU DU PORTEFEUILLE AU 31 MARS 2007

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

1. Contrat de swap totalisant 11 200 000 \$;
2. Acceptation bancaire d'une institution financière canadienne totalisant 2 782 215 \$;
3. Montant à recevoir de 8 417 785 \$ portant intérêt aux termes du contrat de swap.

Le contrat de swap procure aux porteurs de parts une position crédit dans une tranche de titres de participation d'un portefeuille comportant 99 entités de référence équipondérées. Veuillez vous reporter à l'annexe A pour une description détaillée des entités de référence. La prochaine mise à jour trimestrielle du portefeuille sera intégrée dans le rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du fonds daté du 30 juin 2007.

Le tableau qui suit présente la pondération selon la notation, à la création et au 31 mars 2007 :

PONDÉRATION SELON LA NOTATION DE MOODY'S		
Note de Moody's	Initiale	Au 31 mars 2007
Aaa	3 %	2 %
Aa1	1 %	4 %
Aa2	1 %	1 %
Aa3	3 %	2 %
A1	5 %	2 %
A2	9 %	10 %
A3	14 %	13 %
Baa1	20 %	16 %
Baa2	23 %	17 %
Baa3	20 %	14 %
Ba1	1 %	5 %
Ba2	0 %	3 %
Ba3	0 %	2 %
B1	0 %	2 %
B2	0 %	2 %
B3	0 %	3 %
Caa1	0 %	1 %
Caa2	0 %	1 %

Nom	Industrie selon Moody's	NOTE DE MOODY'S		NOTE DE S&P	
		23 septembre 2002	Au 31 mars 2007	23 septembre 2002	Au 31 mars 2007
		Initiale		Initiale	
Abitibi-Consolidated Inc.	Édition et imprimerie	Baa3	B3	BBB-	B+
ACE Ltd.	Assurance	A2	A3	A-	A-
Aetna Inc.	Assurance	Baa3	A3	BBB	A-
Agrium, Inc.	Agriculture et ferme	Baa2	Baa2	BBB	BBB
Ambac Assurance Corporation	Assurance	Aaa	Aaa	AAA	AA
American Electric Power Company, Inc.	Services publics	Baa1	Baa2	BBB+	BBB
American International Group, Inc.	Assurance	Aaa	Aa2	AAA	AA
Amgen Inc.	Produits chimiques, plastiques et caoutchouc	A2	A2	A+	A+
Anadarko Petroleum Corporation	Pétrole et gaz	Baa1	Baa3	BBB+	BBB-
ARAMARK Corporation	Services personnels, alimentaires et autres	Baa3	B3	BBB-	B+
ArvinMeritor, Inc.	Automobile	Baa3	Ba3	BBB-	BB-
AT&T Corp.	Télécommunications	Baa2	A2	BBB+	A
AT&T Inc	Télécommunications	Aa3	A2	AA-	A
Bank of America Corp.	Banque	A1	Aa1	A	AA
Bank of America Corporation	Banque	Aa2	Aa1	A+	AA
BCE Inc.	Télécommunications	Baa1	Baa2	A	A-
BellSouth Corporation	Télécommunications	Aa3	A2	A+	A
Boeing Capital Corporation	Finance	A3	A2	A+	A+
Bowater Incorporated	Édition et imprimerie	Baa3	B3	BBB	B+
Burlington Northern Santa Fe Corporation	Transport cargo	Baa2	Baa1	BBB+	BBB
Carnival Corporation	Transport cargo	A2	A3	A	A-
Caterpillar Inc.	Machinerie (non-agricole, non-construction, non-électronique)	A2	A2	A+	A
Cendant Corporation	Diversifiés/conglomérats	Baa1	Ba2	BBB	BB+
Cinergy Corp.	Services publics	Baa2	Baa2	BBB+	BBB
Cingular Wireless LLC	Télécommunications	A3	Baa1	A+	A
Citigroup Inc.	Banque	Aa1	Aa1	AA-	AA
CNA Financial Corporation	Assurance	Baa2	Baa3	BBB-	BBB-
Comcast Corporation	Communications	Baa3	Baa2	BBB	BBB+
ConAgra Foods, Inc.	Produits alimentaires, boissons et tabac	Baa1	Baa2	BBB+	BBB+
Constellation Energy Group, Inc.	Services publics	Baa1	Baa1	BBB+	BBB+
Con-way Inc.	Transport par camion	Baa3	Baa3	BBB-	BBB
Cooper Industries Ltd.	Machinerie (non-agricole, non-construction, non-électronique)	A3	A3	A-	A
Countrywide Home Loans, Inc.	Finance	A3	A3	A	A
Cox Enterprises, Inc.	Communications	Baa1	Baa3	BBB	NR
CSX Corporation	Transport cargo	Baa2	Baa2	BBB	BBB
Deere & Company	Agriculture et ferme	A3	A2	A-	A
Devon Energy Corporation	Pétrole et gaz	Baa2	Baa2	BBB	BBB

Nom	Industrie selon Moody's	NOTE DE MOODY'S		NOTE DE S&P	
		23 septembre 2002	Au 31 mars 2007	23 septembre 2002	Au 31 mars 2007
		Initiale		Initiale	
Domtar Inc.	Édition et imprimerie	Baa3	B2	BBB-	BB-
Dow Chemical Company (The)	Produits chimiques, plastiques et caoutchouc	A3	A3	A	A-
Eastman Kodak Company	Santé, éducation et services de garde	Baa1	B2	BBB+	B+
Electronic Data Systems Corporation	Électronique	A1	Ba1	A	BBB-
ERAC USA Finance Company	Transport personnel	Baa1	Baa1	A	NR
Federated Department Stores, Inc.	Distribution au détail	Baa2	Baa2	BBB	BBB
FedEx Corporation	Transport cargo	Baa1	Baa2	BBB+	BBB
Ford Motor Credit Company	Finance	A3	B1	BBB+	B
General Electric Capital Corporation	Finance	Aaa	Aaa	AAA	AAA
GMAC LLC	Finance	A2	Ba1	BBB+	BB+
Goodrich Corporation	Aéronautique et défense	Baa1	Baa3	BBB+	BBB
Harrah's Entertainment, Inc.	Hôtels, motels, auberges et jeux	Baa3	Baa3	BBB-	BB
Hertz Corporation (The)	Automobile	Baa2	Ba1	BBB	BB-
Hess Corporation	Pétrole et gaz	Baa2	Baa3	BBB	BBB-
Hewlett-Packard Company	Électronique	A3	A2	A-	A
HSBC Financial Corporation Limited	Finance	A3	Aa3	A	AA-
Inco Ltd.	Mines, acier, fer et métaux non précieux	Baa3	Baa3	BBB-	BBB
Ingersoll-Rand Company	Machinerie (non-agricole, non-construction, non-électronique)	A3	A3	BBB+	A-
International Business Machines Corporation	Électronique	A1	A1	A+	A+
International Lease Finance Corporation	Diversifiés/conglomérats	A1	A1	AA-	AA-
International Paper Company	Machinerie (non-agricole, non-construction, non-électronique)	Baa2	Baa3	BBB	BBB
Interpublic Group of Cos. Inc.	Électronique	Baa1	Ba3	BBB+	B
Jones Apparel Group, Inc.	Diversifiés/conglomérats	Baa2	Baa3	BBB	BBB-
Lockheed Martin Corporation	Aéronautique et défense	Baa2	Baa1	BBB	BBB+
Marriott International, Inc.	Hôtels, motels, auberges et jeux	Baa2	Baa2	BBB+	BBB+
MBNA Corporation	Banque	Baa2	Aa1	BBB	NR
McKesson Corporation	Santé, éducation et services de garde	Baa2	Baa3	BBB	BBB
Merrill Lynch & Co., Inc.	Finance	Aa3	Aa3	AA-	AA-
MetLife, Inc.	Assurance	A2	A2	A	A
Motorola, Inc.	Électronique	Baa2	Baa1	BBB	A-
Nabors Industries Inc.	Pétrole et gaz	A3	A3	A-	NR
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp	Services publics	A2	A2	NR	A
Newmont Mining Corporation	Mines, acier, fer et métaux non précieux	Baa3	Baa1	BBB	BBB+
News America Incorporated	Communications	Baa3	Baa2	BBB-	BBB

Nom	Industrie selon Moody's	NOTE DE MOODY'S		NOTE DE S&P	
		23 septembre 2002	Au 31 mars 2007	23 septembre 2002	Au 31 mars 2007
		Initiale		Initiale	
Nordstrom, Inc.	Distribution au détail	Baa1	Baa1	A-	A
Norfolk Southern Corporation	Transport cargo	Baa1	Baa1	BBB	BBB+
Raytheon Company	Aéronautique et défense	Baa3	Baa1	BBB-	BBB+
Reebok International Ltd.	Textile et cuir	Baa3	Baa2	BBB-	NR
Ryder System, Inc.	Transport personnel	Baa1	Baa1	BBB	BBB+
Sabre Holdings Corporation	Électronique	Baa2	Baa3	BBB+	BB
Safeway Inc.	Distribution alimentaire	Baa2	Baa2	BBB	BBB-
Sears Roebuck Acceptance Corp.	Finance	Baa1	Ba2	A-	BB+
Sempra Energy	Services publics	A2	Baa1	A-	BBB+
Shaw Communications Inc.	Communications	Baa3	Ba1	BBB	BB+
Sherwin-Williams Company (The)	Produits chimiques, plastiques et caoutchouc	A2	A3	A	A-
Simon Property Group, L.P.	Immobilier	Baa1	A3	BBB+	A-
Southwest Airlines Co.	Transport personnel	Baa1	Baa1	A	A
SUPERVALU, INC.	Distribution alimentaire	Baa3	B1	BBB	BB-
TELUS Corporation	Télécommunications	Ba1	Baa1	BBB	BBB+
Temple-Inland Inc.	Édition et imprimerie	Baa3	Baa3	BBB	BBB
Textron Inc.	Diversifiés/conglomérats	A3	A3	A	A-
Time Warner Inc.	Divertissement et films	Baa1	Baa2	BBB+	BBB+
Toys 'R' US, Inc.	Distribution au détail	Baa3	Caa1	BBB	B-
Transocean Inc.	Pétrole et gaz	Baa2	Baa1	A-	A-
TXU Corp.	Services publics	Baa3	Ba1	BBB+	BB
Tyson Foods, Inc.	Produits alimentaires, boissons et tabac	Baa3	Ba2	BBB	BBB-
Verizon Global Funding Corp.	Télécommunications	A1	A3	A+	A
Viacom Inc.	Communications	A3	Baa3	A-	BBB
Visteon Corporation	Automobile	Baa2	Caa2	BBB	B
Walt Disney Company (The)	Communications	A3	A3	A-	A-
Weatherford International, Inc.	Pétrole et gaz	Baa1	Baa1	BBB+	BBB+
Weyerhaeuser Company	Ressources naturelles, métaux précieux et minéraux	Baa2	Baa2	BBB	BBB