



**COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FRR
AU 31 MARS 2017**

ENCOURS TOTAUX SOUS GESTION	35 563 146 076 €
------------------------------------	-------------------------

ACTIONS

Encours sous gestion dans la poche	10 430 200 178 €
---	-------------------------

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2017	Ratio d'emprise
NSK LTD	222 400	2 970 807 €	0,040%
21ST CENTURY SHS A	82 105	2 486 448 €	0,008%
3M	10 959	1 960 437 €	0,002%
4IMPRINT GROUP	243 355	5 081 633 €	0,866%
A2A	183 435	260 111 €	0,006%
AAC TECHNO HOLD NV	255 523	2 795 936 €	0,021%
AAREAL BANK	45 617	1 651 335 €	0,076%
AARHUSKARLSHAMN AB	50 000	3 089 248 €	0,118%
ABB LTD NOM,	39 509	864 692 €	0,002%
ABBOTT LABO,	282 965	11 749 311 €	0,016%
ABBVIE	30 251	1 842 976 €	0,002%
ABC-MART	30 600	1 671 472 €	0,037%
ABERDEEN ASSET	287 847	890 835 €	0,022%
ABERTIS INFRAES,A	686 624	10 368 022 €	0,069%
ABLYNX	150 695	1 754 843 €	0,247%
ABN AMRO GROUP	733 226	16 680 892 €	0,078%
ACADIA HEALTHCARE	140 520	5 728 271 €	0,160%
ACCENTURE PLC-CL	8 835	990 267 €	0,001%
ACCESSO TECHNOLOGY	118 002	2 269 535 €	0,528%
ACCIONA	229 625	17 251 726 €	0,401%
ACCOR	157 938	6 167 479 €	0,055%
ACCSYS BASIC E DS 17	38 546	1 156 €	0,000%
ACCSYS EXCESS DS 17	11 949 320	- €	0,000%
ACCSYS TECHNOLOGIE	1 194 932	860 351 €	1,077%
ACE NOM,	27 058	3 446 919 €	0,006%
ACERINOX	347 203	4 557 039 €	0,126%
ACKERMANS HAAREN	54 394	8 012 236 €	0,162%
ACS ACT,CONSTR,	111 252	3 548 383 €	0,035%
ACTELION LTD	6 593	1 737 933 €	0,006%
ACTIVISION	157 112	7 324 206 €	0,021%
ACUITY BRANDS	14 088	2 687 067 €	0,032%
ADDTECH B	198 973	3 094 221 €	0,306%
ADECCO NOM,	19 718	1 310 481 €	0,012%
ADIDAS NOM,	232 261	41 412 136 €	0,111%
ADIENT PLC	96 986	6 589 662 €	0,104%
ADOBE SYSTEMS	109 701	13 347 100 €	0,022%
ADP (PROMESSE)	128 403	14 875 488 €	0,130%
ADVAN	13 700	138 402 €	0,025%
ADVANCE AUTO PARTS	84 400	11 699 447 €	0,114%
AED OIL LTD	34 369	- €	0,014%
AEGON	3 547 003	16 922 751 €	0,171%
AENA	189 747	28 139 480 €	0,126%
AEON	11 900	162 255 €	0,001%
AERCAP HOLDINGS NV	255 575	10 984 791 €	0,148%
AES	147 011	1 536 705 €	0,022%
AETNA	29 827	3 557 042 €	0,009%
AF AB-B	50 000	969 710 €	0,066%

AFFILIATED MANAGER	952	145 922 €	0,002%
AFLAC	2 210	149 641 €	0,001%
AFRICA OIL	2 160 499	3 398 245 €	0,473%
AGEAS	705 035	25 832 482 €	0,326%
AGILENT TECHN,	33 247	1 643 466 €	0,010%
AGNICO EAGLE MINES	3 792	149 989 €	0,002%
AGRIUM	2 964	263 734 €	0,002%
AIA GROUP LTD	538 778	3 176 146 €	0,004%
AIR FRANCE	147 645	1 047 984 €	0,049%
AIR LIQUIDE	294 374	31 527 455 €	0,076%
AISIN SEIKI	125 300	5 750 889 €	0,043%
AJINOMOTO CO	22 800	420 206 €	0,004%
AKAMAI TECHN,	28 412	1 585 897 €	0,016%
AKKA TECHNOLOGIES	135 834	5 813 695 €	0,670%
AKZO NOBEL	210 277	16 344 831 €	0,083%
ALASKA AIR GROUP	94 755	8 170 077 €	0,077%
ALBEMARLE	2 904	286 830 €	0,003%
ALEXANDRIA REAL	2 610	269 700 €	0,003%
ALEXION PHARMA, INC	52 894	5 995 857 €	0,023%
ALFA LAVAL	151 767	2 687 520 €	0,036%
ALIBABA SPON,ADR	128 962	13 001 704 €	0,005%
ALIM,COUCHE SUB,	3 586	151 042 €	0,001%
ALLEGHANY	500	287 345 €	0,003%
ALLERGAN PLC	31 333	6 999 280 €	0,009%
ALLIANCE DATA SYS,	1 248	290 545 €	0,002%
ALLIANZ	296 976	51 569 882 €	0,065%
ALLSTATE	251 699	19 177 179 €	0,069%
ALLY FINANCIAL	9 200	174 874 €	0,002%
ALPES (COMPAGNIE)	32 807	637 440 €	0,135%
ALPHABET CL, A	56 063	44 439 448 €	0,019%
ALPHABET CL, C	50 119	38 873 094 €	0,017%
ALS LTD	87 615	383 693 €	0,017%
ALSTOM REGROUPT	1 249 331	35 000 008 €	0,569%
ALTEN	257 114	18 481 354 €	0,763%
ALTICE CL,A	312 825	6 633 454 €	0,028%
ALTICE CL,B	97 265	2 062 018 €	0,037%
ALTRAN TECHN,	1 273 230	20 091 569 €	0,724%
ALTRIA GROUP	167 420	11 179 596 €	0,009%
AMADEUS IT HOLDING	366 300	17 421 228 €	0,083%
AMAZON COM	103 470	85 765 316 €	0,022%
AMBEA AB	400 248	3 457 911 €	0,592%
AMER SPORTS OYJ	190 597	4 036 844 €	0,161%
AMERI TOWER NV	23 800	2 704 551 €	0,006%
AMERICAN AIRLINES	134 200	5 307 522 €	0,027%
AMERICAN EXPRESS	229 872	17 002 640 €	0,026%
AMERICAN INTL GRP	39 424	2 301 192 €	0,004%
AMERICAN WATER WKS	197 900	14 389 868 €	0,111%
AMERIPRISE FCIAL	83 350	10 105 959 €	0,054%
AMERISOURCEBERGEN	4 371	361 679 €	0,002%
AMERISUR RESOURCES	5 784 449	1 420 244 €	0,477%
AMGEN	13 923	2 135 802 €	0,002%
AMP	448 788	1 658 088 €	0,015%
AMPHENOL CL,A	17 855	1 188 107 €	0,006%
AMUNDI	53 991	2 986 242 €	0,002%
AMUNDI DS17	53 990	139 402 €	0,002%
ANADARKO PETROLE,	235 000	13 622 552 €	0,042%
ANALOG DEVICES	6 583	504 396 €	0,002%
ANDRITZ AG	145 850	6 838 177 €	0,140%
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €	0,000%
ANHEUSER-BUSCH INB	102 100	10 477 767 €	0,005%
ANIMA HOLDING	567 195	3 176 292 €	0,189%
ANSELL	90 750	1 557 970 €	0,062%
ANSYS	2 691	268 886 €	0,003%
ANTOFAGASTA	18 671	182 169 €	0,002%
AOI ELECTRONICS	87 500	2 503 566 €	0,729%
AON PLC	1 383	153 474 €	0,001%
APA GROUP ST,SECU,	1 004 920	6 422 084 €	0,090%

APPLE	441 678	59 325 381 €	0,008%
APPLEGREEN	602 190	2 830 293 €	0,745%
APPLIED MATERIALS	158 761	5 774 207 €	0,015%
APPLUS SERVICES	538 122	6 061 944 €	0,414%
ARCELORMITTAL	304 435	2 400 774 €	0,010%
ARIAKE JAPAN	4 300	252 920 €	0,013%
ARISTOCRAT LEISURE	189 971	2 434 848 €	0,030%
ARIX BIOSCIENCE PLC	834 514	1 927 002 €	0,868%
ARKEMA	300 836	27 821 313 €	0,397%
AROWNTOWN PROP	940 581	4 138 556 €	0,127%
ASAHI BREWERIES	28 300	999 215 €	0,006%
ASAHI GLASS	275 000	2 081 306 €	0,023%
ASAHI INTEC	61 700	2 399 559 €	0,096%
ASAHI KASEI	1 002 000	9 080 047 €	0,071%
ASCENDAS REAL EST	697 403	1 175 949 €	0,024%
ASCENTIAL PLC	1 989 654	7 455 678 €	0,497%
ASCOM HOLDING	344 445	5 694 901 €	0,957%
ASHTREAD GROUP	578 241	11 175 405 €	0,116%
ASM PACIFIC TECHN,	179 861	2 287 212 €	0,044%
ASML HOLDING	87 844	10 927 794 €	0,020%
ASML HOLDING	32 200	3 998 093 €	0,007%
ASOS PLC	51 231	3 620 851 €	0,061%
ASSICURAZ,GEN,ORD,	428 305	6 381 745 €	0,027%
ASSURANT	1 678	150 095 €	0,003%
ASSYSTEM	140 183	4 596 601 €	0,631%
ASTELLAS PHARMACEUTI	133 700	1 644 606 €	0,006%
ASTRAZENECA	103 442	5 941 293 €	0,008%
ASX	3 976	143 154 €	0,002%
AT AND T	788 819	30 644 130 €	0,013%
AT-GROUP	43 000	955 034 €	0,122%
ATLANTIA	364 324	8 816 641 €	0,044%
ATLAS COPCO AB	31 763	1 052 086 €	0,004%
ATLAS COPCO S,B	27 922	832 755 €	0,003%
ATOS ORIGIN	334 497	38 784 927 €	0,318%
AUCKLAND INTL ARPT	705 892	3 118 843 €	0,059%
AUMANN AG	22 677	1 229 093 €	0,344%
AURELIUS	165 614	6 742 146 €	0,531%
AURIZON HLDGS LTD	347 334	1 300 598 €	0,017%
AUS,NZL BKG GROUP	399 046	9 056 484 €	0,014%
AUSNET SERVICES	427 756	514 082 €	0,012%
AUTO TRADER GR	909 240	4 170 406 €	0,093%
AUTODESK INC	4 136	334 384 €	0,002%
AUTOGRILL	110 000	1 024 100 €	0,043%
AUTOLIV SWED,DEPOS	57 089	5 488 148 €	0,065%
AVACTA	607 429	433 218 €	0,888%
AVALONBAY COMMUN,	2 492	427 779 €	0,002%
AVANZA HOLDING BK	269 816	9 519 178 €	0,904%
AVERY DENNISON	3 625	273 176 €	0,004%
AVEVA GROUP PLC	228 893	5 218 536 €	0,358%
AVIVA	460 310	2 863 147 €	0,011%
AXA	2 769 195	67 166 825 €	0,114%
AXEL SPRINGER	122 802	6 357 460 €	0,114%
BAKER HUGHES ORD,	7 374	412 428 €	0,002%
BAKKAFROST	80 000	2 313 022 €	0,164%
BALL	3 838	266 476 €	0,002%
BALOISE HOLDING	13 942	1 793 296 €	0,028%
BANCA GENERALI	181 988	4 458 706 €	0,012%
BANCA POP,EMILIA	123 295	577 021 €	0,026%
BANCO BILBAO VIZC,	3 523 749	25 617 655 €	0,053%
BANCO BPM S,P,A	1 128 864	3 135 984 €	0,075%
BANCO POP,ESPAÑOL	5 895 057	5 364 502 €	0,140%
BANCO SABADELL	4 826 159	8 291 341 €	0,086%
BANDO CHEM,IND,	95 000	787 548 €	0,201%
BANK AMERICA	1 748 986	38 575 644 €	0,017%
BANK IRELAND	29 008 341	6 816 960 €	0,090%
BANK N,Y, MELLON	46 497	2 053 250 €	0,004%
BANK OF EAST ASIA	270 521	1 046 349 €	0,010%

BANK OF MONTREAL	11 699	814 681 €	0,002%
BANKIA	6 185 457	6 593 697 €	0,054%
BANKINTER	909 521	7 158 840 €	0,101%
BARCLAYS	1 533 301	4 035 380 €	0,009%
BARD (C,R,)	1 773	412 006 €	0,002%
BARRATT DEV,	443 399	2 833 129 €	0,044%
BARRICK GOLD	121 526	2 156 486 €	0,010%
BARRY CALLEBAUT N,	104	127 165 €	0,002%
BASF SE	428 340	39 801 353 €	0,047%
BASIC-FIT	376 632	6 152 284 €	0,689%
BASWARE	114 839	3 881 558 €	0,797%
BAXTER INTL	32 494	1 575 559 €	0,006%
BAYER	219 667	23 735 019 €	0,027%
BAYER,MOTO,PRIV,	35 448	2 616 771 €	0,006%
BB AND T	374 676	15 658 938 €	0,046%
BBA AVIATION	1 651 582	5 879 887 €	0,160%
BCA MARKETPLACE	1 727 936	3 676 889 €	0,221%
BCA MEDIOLANUM	576 614	3 958 455 €	0,078%
BCA MPS GROUP AOR	59 770	- €	0,204%
BCO ESPIRITO SANTO	3 323 765	- €	0,059%
BCO SANT,CENT,HISP	12 059 638	69 282 620 €	0,083%
BE AEROSPACE	3 588	215 069 €	0,002%
BE SEMICONDUCTOR	95 438	3 649 072 €	0,238%
BECTON DICKINSON	39 101	6 706 267 €	0,018%
BEIERSDORF NOM,	130 174	11 550 339 €	0,052%
BELC	60 000	2 179 896 €	0,288%
BELGACOM	418 451	12 308 736 €	0,124%
BELIMO HOLDING	4 098	13 397 786 €	0,666%
BELVEDERE	165 000	2 608 650 €	0,582%
BEND,AND ADEL,BANK	11 199	96 969 €	0,002%
BENETEAU	295 691	3 639 956 €	0,357%
BERENDSEN PLC	223 877	1 918 647 €	0,130%
BERKELEY UNIT	61 906	2 321 204 €	0,045%
BERKSHIRE HATHAWAY B	75 307	11 735 936 €	0,006%
BERTRANDT	40 000	3 645 200 €	0,394%
BEST BUY	50 324	2 312 584 €	0,016%
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €	0,000%
BHP BILLITON	129 935	2 227 907 €	0,004%
BIC	200 410	23 407 888 €	0,421%
BIG YELLOW	869 734	7 428 279 €	0,551%
BILFINGER BERGER	47 416	1 711 243 €	0,107%
BIOGEN IDEC	26 335	6 732 285 €	0,012%
BIOMARIN PHARM,	36 920	3 030 095 €	0,021%
BIOMERIEUX	154 437	24 501 430 €	0,391%
BLACKBERRY	11 719	84 623 €	0,002%
BLACKROCK	2 212	793 160 €	0,001%
BMW	280 210	23 960 757 €	0,047%
BNP PARIBAS	1 059 660	66 154 574 €	0,085%
BOC AVIATION LTD	420 000	2 094 442 €	0,061%
BOC HKG HOLD,	506 420	1 934 412 €	0,005%
BOEING	89 514	14 801 969 €	0,015%
BOIRON	51 660	4 427 262 €	0,266%
BOLIDEN	63 377	1 772 041 €	0,023%
BOLLORE INVEST,	3 450 426	12 538 848 €	0,119%
BOLLORE NV 17	12 011	42 759 €	0,182%
BONDUELLE	179 938	5 308 171 €	0,562%
BONGRAIN	8 050	628 222 €	0,057%
BOOKER GRP PLC	4 065 986	9 289 064 €	0,228%
BORG WARNER	66 386	2 593 867 €	0,031%
BOSHIWA INTL	122 000	- €	0,006%
BOSSARD HOLDING AG	19 627	3 285 375 €	0,295%
BOSTON PROPERTIES	4 617	571 583 €	0,003%
BOSTON SCIENTIFIC	386 061	8 976 988 €	0,028%
BOUYGUES	427 663	16 317 482 €	0,120%
BP	801 320	4 286 729 €	0,004%
BP PLC SPONSORED	499 348	16 116 585 €	0,003%
BRAMBLES	425 263	2 835 997 €	0,027%

BREMBO	223 565	15 504 233 €	0,335%
BRENNTAG	278 085	14 613 367 €	0,180%
BRIDGESTONE	75 900	2 867 744 €	0,009%
BRIGHTOIL PETRO HLD	508 000	136 290 €	0,005%
BRISTOL MYERS ORD,	32 013	1 627 663 €	0,002%
BRITISH LAND	192 601	1 373 630 €	0,019%
BRITISH SKY BROAD,	99 399	1 134 262 €	0,006%
BROADCOM	68 240	13 970 203 €	0,017%
BROCADE COMM SYST	70 348	820 853 €	0,017%
BROOKFIELD ASSET	4 427	150 370 €	0,000%
BROTHER INDUSTRIES	276 400	5 392 096 €	0,100%
BRUNSWICK	22 440	1 284 024 €	0,025%
BT GROUP	576 345	2 144 195 €	0,006%
BUNGE	2 444	181 115 €	0,002%
BUNZL	24 918	675 900 €	0,007%
BURBERRY GROUP	214 981	4 333 301 €	0,049%
BURCKHARDT COMPRES	3 859	977 772 €	0,114%
BUREAU VERITAS	1 910 714	37 784 369 €	0,432%
BURFORD CAPITAL	465 985	4 195 118 €	0,224%
BURLINGTON STORES	41 910	3 812 280 €	0,060%
C, UYEMURA & CO	93 900	4 774 576 €	0,951%
CA	4 955	146 952 €	0,001%
CADENCE DESIGN SYS	7 373	216 458 €	0,003%
CAFE DE CORAL HOLD	524 137	1 604 823 €	0,090%
CAIRN ENERGY	658 401	1 574 220 €	0,113%
CAIRN HOMES LTD	1 434 218	2 108 300 €	0,208%
CALTEX AUSTRALIA	178 651	3 757 653 €	0,068%
CAMECO	40 883	421 900 €	0,010%
CAMPBELL SOUP	25 185	1 347 847 €	0,008%
CAN,NAT,RAILWAY	32 386	2 228 694 €	0,004%
CANADIAN IMBK COMM	8 872	713 231 €	0,002%
CANADIAN PACIFIC	11 209	1 535 108 €	0,008%
CANCOM SE	115 358	6 105 899 €	0,705%
CANON	19 300	562 093 €	0,001%
CAP GEMINI	548 354	47 465 522 €	0,324%
CAPITACOMM,REIT	1 030 521	1 065 343 €	0,035%
CAPITAL ONE FCIAL	47 000	3 808 162 €	0,010%
CAPITALAND	1 196 000	2 904 972 €	0,028%
CAPITAMALL TRST FD	2 142 652	2 824 372 €	0,060%
CARD FACTORY	610 743	2 035 096 €	0,179%
CARDINAL HEALTH	152 130	11 599 459 €	0,048%
CARGOTEC B	66 898	3 104 067 €	0,121%
CARL ZEISS MEDITEC	60 000	2 398 800 €	0,067%
CARNIVAL	12 445	666 120 €	0,007%
CARREFOUR	948 480	20 961 408 €	0,125%
CASINO GUICHARD	319 305	16 741 161 €	0,654%
CATERPILLAR	10 594	918 797 €	0,002%
CBRE GP A	7 990	259 896 €	0,002%
CBS CL,B	31 848	2 065 333 €	0,009%
CDK GLOBAL	17 850	1 084 969 €	0,012%
CELANESE SER,A	95 157	7 993 882 €	0,068%
CELGENE	118 286	13 761 233 €	0,015%
CELLECTIS	52 571	1 181 796 €	0,149%
CELLNEX TELECOM	458 916	7 101 725 €	0,198%
CENTENE	61 800	4 117 496 €	0,036%
CENTERPOINT ENERGY	15 937	410 811 €	0,004%
CENTRAL JAP,RAILW,	28 000	4 261 789 €	0,014%
CENTRICA	391 188	992 491 €	0,007%
CENTURY LEAS, SYS,	220 900	7 024 761 €	0,207%
CENTURYTEL	9 913	218 456 €	0,002%
CERNER	5 984	329 258 €	0,002%
CERV INFO SOL	1 308 922	11 865 378 €	0,671%
CFG LTD	223 873	- €	0,006%
CHALLENGER FCIAL	56 172	502 806 €	0,010%
CHAMPION REIT	2 950 318	1 689 547 €	0,435%
CHARGEURS	158 410	3 383 638 €	0,690%
CHARTER CIONS CL A	3 930	1 202 719 €	0,001%

CHEVRONTXACO	206 525	20 732 635 €	0,011%
CHIBA BANK	350 000	2 099 765 €	0,040%
CHINA HIGH PRECIS,	152 000	- €	0,015%
CHINA MENGNIU	594 437	1 151 400 €	0,015%
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	- €	0,000%
CHINA MILK PROD TP	239 000	- €	0,000%
CHINA OCEANWIDE HLDG	5 115 087	473 847 €	0,032%
CHINA TRAVEL INTL	6 826 000	1 929 872 €	0,125%
CHNA ANIM HLTH CRE	167 770	- €	0,009%
CHOCOL,LINDT SPRUN	5	310 705 €	0,004%
CHOCOLAD,LINDT BP	16	84 891 €	0,012%
CHOW TAI FOOK JEWL	3 242 820	2 945 535 €	0,032%
CHR, HANSEN HOLD,	193 689	11 658 378 €	0,147%
CHRISTIAN DIOR	85 760	18 678 528 €	0,048%
CHUO MITSUI TRUST	107 400	3 478 470 €	0,028%
CHURCH AND DWIGHT	3 208	149 580 €	0,001%
CI FINANCIAL	8 100	150 086 €	0,003%
CIE AUTOMOTIVE	218 203	4 032 391 €	0,169%
CIGNA	159 706	21 873 996 €	0,062%
CIMAREX ENERGY	1 725	192 717 €	0,002%
CIMIC GROUP LTD	58 685	1 503 906 €	0,018%
CINCINNATI FCIAL	4 086	276 093 €	0,002%
CINEWORLD GROUP	400 000	3 098 328 €	0,149%
CINTAS	1 512	178 887 €	0,001%
CISCO SYSTEMS	663 937	20 981 787 €	0,013%
CITIGROUP	363 286	20 318 609 €	0,013%
CITIZENS FINL GRP	73 300	2 367 832 €	0,014%
CITRIX SYSTEMS	2 025	157 884 €	0,001%
CITY DEVELOPMENTS	319 098	2 177 852 €	0,035%
CK HUTCHISON	287 335	3 304 767 €	0,007%
CK PROPERTY HOLDINGS	137 634	866 836 €	0,004%
CKD	60 000	708 844 €	0,087%
CLARIANT NOM,	152 989	2 700 941 €	0,046%
CLARKSON	100 000	3 039 869 €	0,331%
CLEAN HARBORS	20 700	1 076 466 €	0,036%
CLOETTA	817 927	3 032 135 €	0,289%
CLOROX	3 337	420 670 €	0,003%
CLOSE BROTHERS GRP	170 737	3 070 192 €	0,114%
CME GROUP	35 955	3 993 693 €	0,011%
CNA HONGXING SPRT	449 000	- €	0,016%
CNH INDUSTRIAL NV	1 274 702	11 523 306 €	0,094%
CNP ASSURANCES	864 731	16 499 067 €	0,126%
COBHAM	165 446	257 270 €	0,010%
COCA COLA EUR	63 236	2 225 004 €	0,013%
COCA-COLA	523 434	20 769 986 €	0,012%
COCA-COLA AMATIL	517 404	3 992 947 €	0,068%
COCA-COLA HBC	111 156	2 678 505 €	0,031%
COCHLEAR	33 558	3 236 724 €	0,058%
COCOKARA FINE INC	25 000	1 012 125 €	0,098%
COGNIZANT TECHN,A	43 177	2 402 782 €	0,007%
COLGATE PALMOLIVE	36 902	2 525 228 €	0,004%
COLRUYT	364 791	16 787 682 €	0,244%
COM HEM HOLDING	404 453	4 349 800 €	0,220%
COMCAST CL,A	802 192	28 193 537 €	0,017%
COMERICA	21 095	1 352 620 €	0,012%
COMFORTDELGRO	1 395 908	2 391 117 €	0,065%
COMMERZBANK NV	1 480 083	12 548 144 €	0,118%
COMPASS GROUP	111 689	1 966 604 €	0,007%
COMPUGROUP MEDICAL	105 338	4 394 701 €	0,198%
COMPUTER SCIENCES	34 345	2 216 024 €	0,012%
COMPUTERSHARE	226 270	2 269 075 €	0,041%
COMSYS HOLDINGS	40 000	667 562 €	0,028%
COMW,BK AUSTRALIA	171 208	10 490 695 €	0,010%
CONAGRA FOODS	38 598	1 455 793 €	0,009%
CONCHO RESOURCES	36 807	4 416 634 €	0,025%
CONCORDIA FIN GRP	185 000	800 042 €	0,014%
CONOCOPHILLIPS	574 537	26 788 986 €	0,046%

CONSOL,EDISON	5 521	400 880 €	0,002%
CONSORT MEDICAL	582 392	7 054 345 €	1,183%
CONSTELLAT SFTWRE	378	173 179 €	0,002%
CONSTELLATION CL,A	44 107	6 683 579 €	0,026%
CONTACT ENERGY	66 699	220 586 €	0,009%
CONTINENTAL	53 910	11 078 505 €	0,027%
COOPER NV	970	181 285 €	0,002%
COSMOS PHARMA,	4 800	875 583 €	0,024%
COSTAR GROUP	10 570	2 047 885 €	0,032%
COSTCO WHOLESALE	34 352	5 385 898 €	0,008%
COTY CL A	14 178	240 332 €	0,002%
COVESTRO AG	159 639	11 506 779 €	0,019%
CRANEWARE	133 414	1 914 716 €	0,495%
CREATE SD HOLDINGS	115 900	2 575 123 €	0,173%
CREDIT AGRICOLE	2 138 776	27 162 455 €	0,075%
CREDIT SUISSE GRP	123 374	1 717 129 €	0,006%
CREST NICHOLSON HG	390 174	2 477 078 €	0,153%
CRH	43 969	1 454 055 €	0,005%
CRH PLC	28 278	929 865 €	0,003%
CRITERIA CAIXACORP	3 554 700	14 321 886 €	0,059%
CRODA INTERNATIO PLC	10 356	431 530 €	0,008%
CROWN	122 150	1 028 916 €	0,017%
CROWN CASTLE INTER	105 820	9 344 770 €	0,029%
CSL	52 618	4 703 551 €	0,012%
CSR	484 775	1 559 385 €	0,096%
CSX	63 281	2 754 178 €	0,007%
CTS EVENTIM	461 247	16 734 041 €	0,480%
CUMMINS	11 518	1 628 275 €	0,007%
CVS CAREMARK	36 965	2 713 059 €	0,004%
CVS GROUP	150 459	2 008 935 €	0,236%
CYBERAGENT	29 000	801 770 €	0,023%
CYBERDYNE INC	73 300	982 828 €	0,053%
DAH SING BANKING	345 861	637 463 €	0,103%
DAH SING FINANCIAL	96 858	689 845 €	0,029%
DAICEL CHEM,IND,	150 000	1 687 783 €	0,043%
DAIDO METAL	190 300	1 561 616 €	0,423%
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	43 800	733 736 €	0,004%
DAIKIN INDUSTRIES	17 700	1 661 139 €	0,006%
DAIKYONISHIKAWA	55 000	673 309 €	0,074%
DAIMLERCHRYSLER	548 865	37 981 458 €	0,051%
DAINIPPON PHARM,	75 100	1 158 196 €	0,005%
DAISEKI	52 300	996 149 €	0,116%
DAIWA HOUSE IND,	53 700	1 440 050 €	0,008%
DAIWA SECU,GRP	1 136 000	6 461 608 €	0,067%
DALATA HOTEL GROUP	728 711	3 257 338 €	0,398%
DANAHER	307 458	24 586 866 €	0,044%
DANSKE BANK	44 967	1 436 153 €	0,005%
DARDEN RESTAURANTS	19 304	1 510 136 €	0,016%
DASSAULT AVIATION	5 446	6 491 087 €	0,066%
DASSAULT SYSTEMES	622 682	50 524 417 €	0,241%
DAVIDE CAMPARI	1 113 677	12 105 669 €	0,466%
DAVITA	28 066	1 783 597 €	0,014%
DBS GROUP HOLDINGS	243 544	3 161 428 €	0,010%
DBV TECHNOLOGIES	20 645	1 347 293 €	0,084%
DCC	21 197	1 741 014 €	0,024%
DE LONGHI	246 736	6 726 023 €	0,165%
DECHRA PHARMACEUT	100 000	1 957 208 €	0,107%
DEERE	4 843	492 926 €	0,002%
DELL TECHNOLOGIE INC	4 855	290 878 €	0,002%
DELPHI AUTOMOTIVE	15 912	1 197 473 €	0,006%
DELTA AIR LINES	213 682	9 182 203 €	0,029%
DELTA LLOYD NV	487 107	2 602 126 €	0,106%
DELTA PLUS GROUP	3 427	248 081 €	0,093%
DENA	61 100	1 158 121 €	0,041%
DENSO	100 000	4 108 911 €	0,013%
DENTSPLY INTER INC	4 673	272 808 €	0,002%
DERWENT LONDON	86 357	2 839 190 €	0,078%

DESCENTE LTD	113 800	1 261 368 €	0,148%
DEU,LUFTHANSA NOM,	548 796	8 341 699 €	0,117%
DEUTSCHE BANK Dts17	454 257	1 017 536 €	0,022%
DEUTSCHE BANK NOM,	974 901	15 744 651 €	0,047%
DEUTSCHE BORSE AG	162 402	13 951 956 €	0,084%
DEUTSCHE POST NOM,	506 698	16 267 539 €	0,041%
DEUTSCHE TELEKOM	1 449 385	23 806 149 €	0,031%
DEUTSCHE WOHN,POR,	371 145	11 455 390 €	0,105%
DEUTZ	74 074	479 185 €	0,061%
DEVOTEAM	4 511	287 802 €	0,055%
DEXCOM	18 845	1 492 905 €	0,022%
DEXUS PTY,UNIT	720 017	5 017 343 €	0,074%
DIA	1 616 540	8 763 263 €	0,260%
DIAGEO	249 994	6 674 398 €	0,010%
DIALOG SEMICOND,	60 644	2 918 978 €	0,078%
DIAMONDBACK ENERGY	16 222	1 573 059 €	0,018%
DIASORIN	48 680	3 081 444 €	0,087%
DICK S SPORTING	1 316	59 872 €	0,001%
DIGITAL REALTY TRUST	2 890	287 473 €	0,002%
DIGNITY PLC	394 103	10 961 897 €	0,789%
DIRECT ENERGIE	37 154	1 386 773 €	0,089%
DIRECT LINE INSU GRP	357 910	1 453 735 €	0,026%
DISCOVER FINANCIAL	87 615	5 602 347 €	0,023%
DISCOVERY COM CL A	3 700	100 634 €	0,002%
DISCOVERY COM CL C	3 147	83 298 €	0,002%
DISH NETWORK CORP	2 579	153 093 €	0,001%
DISNEY WALT-DISNEY	37 251	3 949 222 €	0,002%
DNA LTD	100 023	1 135 261 €	0,076%
DOLLAR GENERAL	103 600	6 754 269 €	0,038%
DOLLAR TREE	69 999	5 134 983 €	0,030%
DOMETIC GROUP	410 321	2 863 879 €	0,139%
DOMINO'S PIZZA INC	1 605	276 566 €	0,003%
DOMINO'S PIZZA UK	1 800 000	6 498 772 €	0,366%
DOW CHEMICAL	188 268	11 184 656 €	0,015%
DOWA HOLDINGS	534 000	3 593 455 €	0,172%
DOWNER DS 17	118 427	1 014 €	0,020%
DOWNER EDI	296 068	1 222 662 €	0,050%
DSV	12 411	602 500 €	0,007%
DTS	138 900	3 237 659 €	0,551%
DU PONT DE NEMOURS	187 355	14 071 551 €	0,022%
DUERR	56 673	4 742 397 €	0,164%
DUET	3 635 330	7 234 101 €	0,147%
DUKE REALTY	10 980	269 688 €	0,003%
DULUX GROUP	709 085	3 302 539 €	0,182%
DUNELM GROUP	490 333	3 654 709 €	0,243%
E TRADE FINANCIAL	7 800	254 445 €	0,003%
E,ON	2 877 743	21 442 063 €	0,131%
EAGLE INDUSTRY	238 700	3 026 311 €	0,480%
EATON CORP	273 613	18 969 103 €	0,061%
EBAY	219 977	6 904 425 €	0,020%
ECHO ENTERTAINMENT	400 873	1 563 978 €	0,049%
ECOLAB	84 943	9 954 425 €	0,029%
EDENRED	1 138 518	25 218 174 €	0,487%
EDF	1 736 067	13 701 041 €	0,063%
EDGEWELL PERS CARE	1 877	128 357 €	0,003%
EDISON INTL	21 945	1 633 436 €	0,007%
EDP ENER,PORTUGAL	3 929 198	12 475 204 €	0,107%
EDP RENOVAVEIS	177 264	1 228 617 €	0,005%
EDWARDS LIFESCIEN,	27 995	2 462 241 €	0,013%
EI TOWERS	80 963	4 266 750 €	0,286%
EIFFAGE	171 488	12 590 649 €	0,180%
ELECTRIC POWER	60 000	1 311 462 €	0,033%
ELECTROLUX B	25 460	664 145 €	0,008%
ELECTRONIC ARTS A	93 933	7 862 075 €	0,030%
ELEKTA S,B	800 000	7 342 985 €	0,217%
ELI LILLY ORD	132 747	10 439 297 €	0,012%
ELIOR	392 632	8 349 319 €	0,227%

ELIS	832 216	15 329 419 €	0,594%
ELISA CORP,S,A	16 524	547 771 €	0,010%
EMERSON ELECTRIC	11 674	653 364 €	0,002%
EMS CHEMIE HOL,NOM	387	210 933 €	0,002%
ENAGAS	1 116 473	27 186 118 €	0,468%
ENBRIDGE	34 854	1 361 271 €	0,002%
ENEL ENERG,ELET,	5 270 011	23 261 829 €	0,052%
ENERGEN CORP	21 202	1 079 180 €	0,022%
ENERGIZER HLDG INC	317 500	16 549 600 €	0,514%
ENI	213 330	3 274 616 €	0,006%
ENTERGY	233 752	16 601 189 €	0,130%
ENTERTAINMENT ONE	850 000	2 430 843 €	0,198%
EOG RESOURCES	188 117	17 157 509 €	0,033%
EQUIFAX	2 166	276 919 €	0,002%
EQUINITY GROUP PLC	944 922	2 165 377 €	0,315%
EQUINIX INC	6 333	2 370 664 €	0,008%
EQUITABLE CORP	18 705	1 068 557 €	0,011%
EQUITY RESIDENTIAL	2 535	147 471 €	0,001%
ERSTE BANK OSTERR,	357 846	10 923 249 €	0,083%
ESI GROUP	33 758	1 701 066 €	0,563%
ESPRIT HOLDINGS	944 941	740 083 €	0,049%
ESSENTRA PLC	638 683	3 920 362 €	0,243%
ESSILOR INTL	240 120	27 349 668 €	0,110%
EULER HERMES	99 470	8 568 346 €	0,052%
EUR,AERO,DEFENCE	521 479	37 197 097 €	0,067%
EURAZEO	145 075	8 955 480 €	0,208%
EUROFINS SCIENT,	46 665	19 032 320 €	0,275%
EURONEXT	64 370	2 633 055 €	0,092%
EUROPCAR GROUP	638 407	6 363 003 €	0,437%
EUTELSAT COMM,PROM	846 769	17 722 875 €	0,364%
EVEREST REINS,GRP	1 094	239 155 €	0,003%
EVONIK INDUSTRIES	601 169	18 374 731 €	0,129%
EXEDY	59 100	1 576 926 €	0,122%
EXELON	51 571	1 734 865 €	0,006%
EXOR NV	102 154	4 952 426 €	0,042%
EXPEDIA	2 820	332 663 €	0,002%
EXPEDITORS INTL	8 378	442 498 €	0,005%
EXPERIAN	123 546	2 351 606 €	0,013%
EXPRESS SCRIPTS	12 710	783 242 €	0,002%
EXTRA SPACE STORAGE	2 019	140 427 €	0,002%
EXTRACTION OIL REG	5 868	101 773 €	0,003%
EXXON MOBIL	59 459	4 559 144 €	0,001%
FACEBOOK CL A	433 930	57 631 487 €	0,018%
FAROE PETROLEUM	792 728	926 842 €	0,216%
FASTENAL	9 823	472 988 €	0,003%
FAURECIA	786 599	35 070 516 €	0,570%
FE NEW N,V,	51 700	3 596 657 €	0,027%
FEDEX	23 954	4 370 645 €	0,009%
FERMENTALG	45 966	113 076 €	0,380%
FERROVIAL	543 927	10 204 071 €	0,074%
FIAT CHRYSLER	3 639 717	37 307 099 €	0,237%
FIDELITY NAT FIN	7 400	269 418 €	0,003%
FIDELITY NATIONAL	6 939	516 557 €	0,002%
FIELMANN	93 675	6 785 817 €	0,112%
FIFTH THIRD BCP	603 351	14 328 564 €	0,080%
FIGEAC AERO	42 500	877 200 €	0,134%
FINANCIERE ODET	5 073	3 982 305 €	0,077%
FINCOBANK	888 450	5 668 311 €	0,146%
FINMECCANICA	427 331	5 679 229 €	0,074%
FIRESTONE DIAMONDS	3 857 866	1 973 362 €	1,217%
FIRST CAPITAL	2 430	34 123 €	0,001%
FIRST PACIFIC	1 622 366	1 100 835 €	0,038%
FIRST REPUBLIC BK	41 461	3 636 535 €	0,026%
FISERV	5 078	547 468 €	0,002%
FISHER PAYKEL HEA,	339 831	2 154 484 €	0,060%
FISHER PLC	250 000	4 667 953 €	0,498%
FLEETCOR TECHN	16 970	2 402 662 €	0,018%

FLETCHER BUILDING	247 681	1 346 867 €	0,036%
FLEXTRONICS INTL	187 800	2 949 876 €	0,035%
FLIGHT CENTRE	9 294	191 442 €	0,009%
FLIR SYSTEMS	5 562	188 668 €	0,004%
FMC	24 620	1 601 894 €	0,018%
FONC,DES REGIONS	169 141	13 245 432 €	0,229%
FONC,FIN,PARTICIP,	63 060	5 675 400 €	0,252%
FONDIARIA SAI	254 108	525 495 €	0,035%
FOOT LOCKER	3 200	223 825 €	0,002%
FORD MOTOR	78 429	853 549 €	0,002%
FORTESCUE METALS	678 685	3 015 732 €	0,022%
FORTIS	7 219	223 038 €	0,002%
FORTIVE	81 661	4 597 845 €	0,024%
FORTUNE BRANDS	5 234	297 778 €	0,003%
FOSTER ELECTRIC	138 800	2 222 104 €	0,515%
FP	20 000	869 273 €	0,045%
FRANCO NEVADA	4 957	302 758 €	0,003%
FRAPORT AG	128 470	8 521 415 €	0,139%
FREENET AG	15 791	481 468 €	0,012%
FRESENIUS	427 141	32 176 532 €	0,077%
FRESENIUS MED,CARE	156 747	12 390 850 €	0,051%
FRESNILLO PLC	10 467	190 420 €	0,003%
FUCHS PETR,ORD,DEM	35 751	1 422 354 €	0,051%
FUGRO	171 783	2 508 891 €	0,203%
FUJI HEAVY IND,	96 200	3 295 726 €	0,013%
FUJI MACHINE MFG	215 900	2 641 233 €	0,221%
FUJIFILM HOLDINGS	7 900	288 213 €	0,002%
FUJIKURA	125 000	840 116 €	0,042%
FUJITEC	86 400	885 894 €	0,092%
FUJITSU	878 000	5 016 196 €	0,042%
FUKUOKA FIN,GRP,	328 000	1 326 531 €	0,038%
FURUKAWA ELECTRIC	25 000	839 067 €	0,035%
GALAXY	885 698	4 533 981 €	0,021%
GALENICA NOM,	184	181 499 €	0,003%
GALIFORM	1 034 445	5 245 397 €	0,164%
GALLIFORD TRY	145 000	2 495 499 €	0,175%
GALP ENERGIA CL,B	531 798	7 564 827 €	0,064%
GAMESA CORPORACION	199 096	4 415 949 €	0,023%
GAP	263 759	5 990 095 €	0,066%
GARMIN	26 842	1 282 684 €	0,014%
GAS NATURAL SDG	688 534	14 142 488 €	0,069%
GAZTRANSPORT TECHN	46 641	1 643 862 €	0,126%
GEA GROUP	164 018	6 534 477 €	0,085%
GEBERIT NOM,	5 424	2 187 738 €	0,015%
GECCINA NOM,	204 296	25 986 451 €	0,322%
GEMALTO	160 024	8 382 057 €	0,177%
GEN,PROPERTY TRUST	893 132	3 280 646 €	0,050%
GENERAL ELECTRIC	119 613	3 332 680 €	0,001%
GENERAL MILLS	10 870	599 728 €	0,002%
GENERAL MOTORS	25 347	837 988 €	0,002%
GENFIT	19 516	575 722 €	0,063%
GENMAB	12 280	2 217 775 €	0,020%
GENTING SINGAPORE	2 249 300	1 535 153 €	0,019%
GENUINE PARTS	3 999	345 517 €	0,003%
GENUS PLC	298 908	6 028 485 €	0,489%
GEORGE WESTON	929	75 569 €	0,001%
GESTEVISION TELEC,	231 293	2 795 176 €	0,069%
GETINGE B	22 568	371 515 €	0,010%
GGP INC	10 420	225 829 €	0,001%
GILEAD SCIENCES	245 280	15 576 100 €	0,019%
GIVAUDAN NOM,	437	736 395 €	0,005%
GJENSIDIGE FORSIKR	85 989	1 224 369 €	0,017%
GL EVENTS	15 029	327 782 €	0,064%
GLANBIA	398 474	7 214 372 €	0,135%
GLAXOSMITHKLINE	379 546	7 364 160 €	0,008%
GLOBAL PAYMENTS	13 399	1 010 735 €	0,009%
GLORY LTD	55 500	1 699 740 €	0,081%

GOLDMAN SACHS	43 313	9 302 849 €	0,011%
GOODMAN GRP UNIT	27 546	152 067 €	0,002%
GOODYEAR TIRE RUB,	41 240	1 388 098 €	0,016%
GPE EUROTUN,REGPT	1 043 450	9 841 820 €	0,190%
GRAFTON UNIT	460 500	3 849 614 €	0,195%
GRAINGER (W,W,)	6 198	1 348 835 €	0,011%
GRAND CITY PROP,	210 125	3 621 504 €	0,137%
GRANDVISION NV	338 360	7 767 054 €	0,133%
GREAT EAGLE HOLD,	278 742	1 225 700 €	0,041%
GREAT-WEST LIFECO	9 451	244 160 €	0,001%
GREEN REIT PLC	1 941 165	2 639 984 €	0,281%
GREGGS PLC	367 913	4 486 534 €	0,364%
GRENKELEASING AG	21 808	3 607 043 €	0,148%
GRIFOLS CL,B	511 779	9 007 310 €	0,120%
GRIFOLS CL A	1 127 488	25 920 949 €	0,265%
GROUPE DANONE	523 607	33 385 182 €	0,080%
GROUPE FNAC	112 700	7 620 774 €	0,427%
GROUPE GORGE	13 500	298 620 €	0,100%
GROUPE GUILLIN	7 919	264 336 €	0,043%
GUERBET	68 989	5 483 936 €	0,551%
GULFPORT ENERGY	30 851	495 843 €	0,019%
GUOTAI JUNAN INTER	1 093 002	331 372 €	0,016%
GVC HOLDINGS	600 652	5 151 154 €	0,203%
GYM GROUP PLC	825 864	1 786 330 €	0,644%
HAITONG INTERNATIO	470 898	258 903 €	0,009%
HAKUTO	146 100	1 263 879 €	0,605%
HALLIBURTON	39 540	1 819 236 €	0,005%
HALMA	613 991	7 350 950 €	0,162%
HAMAMATSU	127 800	3 436 810 €	0,076%
HANESBRANDS	6 864	133 230 €	0,002%
HANG LUNG GROUP	233 000	929 253 €	0,017%
HANG LUNG PROPERT,	491 073	1 193 416 €	0,036%
HANG SENG BANK	102 750	1 948 195 €	0,005%
HANGAR 8 PLC	278 606	685 684 €	0,633%
HANNOVER RUCK,NOM,	97 257	10 518 345 €	0,038%
HANWA	233 000	1 546 426 €	0,110%
HARLEY-DAVIDSON	25 921	1 466 243 €	0,015%
HARMONIC DRIVE SYS	20 800	611 713 €	0,022%
HARRIS	36 914	3 840 326 €	0,030%
HARTFORD FINANCIAL	33 163	1 490 482 €	0,009%
HARVEY NORMAN	17 578	56 794 €	0,002%
HASBRO	1 651	154 086 €	0,001%
HASEKO	556 800	5 624 997 €	0,185%
HAVAS ADVERTISING	2 257 514	18 850 242 €	0,078%
HCP	47 476	1 388 480 €	0,010%
HEALTHSCOPE LTD	933 318	1 511 096 €	0,054%
HEIDELBERGCEMENT	19 049	1 671 740 €	0,010%
HEINEKEN	183 411	14 636 198 €	0,064%
HEINEKEN HOLDING	235 254	17 542 891 €	0,082%
HEIWA	35 000	812 888 €	0,035%
HEIWADO CO LTD	30 000	680 148 €	0,051%
HELMERICH PAYNE	10 978	683 283 €	0,010%
HENDERSON LAND	267 763	1 551 105 €	0,007%
HENKEL PF	283 448	34 042 105 €	0,159%
HENKEL POR	272 595	28 390 769 €	0,153%
HENNES MAURITZ S,B	3 546	85 036 €	0,000%
HERA	3 297 770	8 600 584 €	0,221%
HERMES INTL	46 020	20 437 482 €	0,044%
HERSHEY FOODS	14 433	1 474 270 €	0,009%
HESS	5 172	233 128 €	0,002%
HEWLETT PACKARD	104 646	1 749 400 €	0,006%
HEWLETT PACKARD ENT	230 127	5 099 350 €	0,014%
HEXAGON B	18 027	679 605 €	0,005%
HI LEX	160 300	3 971 857 €	0,419%
HIKMA PHARMACEUT,	3 512	81 343 €	0,001%
HILL & SMITH HLDGS	271 807	4 042 307 €	0,346%
HILTON WORLDWIDE	92 481	5 054 873 €	0,028%

HINO MOTORS	130 000	1 469 290 €	0,004%
HITACHI	1 635 000	8 265 544 €	0,034%
HITACHI CAPITAL	35 000	790 569 €	0,001%
HITACHI METALS	150 000	1 965 934 €	0,003%
HITACHI TRANSPORT	21 200	411 442 €	0,000%
HKG AND CHINA GAS	3 372 074	6 304 383 €	0,027%
HKG EXCHANGES	109 851	2 585 040 €	0,009%
HKG LAND HOLD,	128 400	923 188 €	0,012%
HOCHTIEF	46 422	7 193 089 €	0,015%
HOLOGIC	5 900	234 720 €	0,002%
HOME DEPOT	212 604	29 186 710 €	0,018%
HONDA MOTOR	83 900	2 359 028 €	0,005%
HONEYWELL INTL	278 510	32 516 052 €	0,037%
HOPEWELL HOLDINGS	502 000	1 763 523 €	0,058%
HOPEWELLE HIGHWAY	3 900 509	1 966 209 €	0,127%
HORIBA	21 300	1 066 966 €	0,050%
HOSHIZAKI ELECTRIC	34 000	2 499 077 €	0,047%
HOST HOTELS	13 474	235 075 €	0,002%
HOYA	11 700	525 803 €	0,003%
HSBC HOLDINGS	1 313 870	9 998 807 €	0,007%
HUABAO INTERNATIONAL	3 534 624	1 930 606 €	0,114%
HUFVUDSTADEN LIB,A	275 000	3 824 384 €	0,135%
HUGO BOSS	88 831	6 076 929 €	0,126%
HUHTAMAKI	157 233	5 243 721 €	0,146%
HUMANA	51 850	9 993 323 €	0,036%
HUMMINGBIRD RESOUR	2 553 478	768 760 €	0,744%
HUTCHINSON TELEC	2 652 194	737 075 €	0,055%
HYDRO ONE	3 231	54 930 €	0,001%
HYSAN DEVELOPMENT	493 685	2 093 647 €	0,047%
IBERDROLA	4 906 041	32 895 005 €	0,076%
IBM	83 763	13 637 968 €	0,009%
IBSTOCK PLC	620 148	1 505 235 €	0,153%
ICADE	229 364	15 752 720 €	0,309%
ID LOGISTICS	29 677	3 952 976 €	0,531%
IG GROUP HOLDINGS	611 822	3 557 338 €	0,167%
IGM FINANCIAL	7 318	203 472 €	0,001%
IHI	1 367 000	4 025 986 €	0,088%
IHS MARKIT	51 535	2 021 311 €	0,013%
IIDA GROUP HOLDING	126 300	1 810 039 €	0,043%
ILIAD	130 614	27 383 225 €	0,222%
ILLINOIS TOOL WRK	9 290	1 150 621 €	0,003%
ILLUMINA	14 988	2 391 241 €	0,010%
ILUKA RESOURCES	173 843	944 819 €	0,042%
IMA INDUSTRIA	193 410	14 757 183 €	0,493%
IMCD	195 210	8 995 277 €	0,371%
IMERYS	124 883	9 936 940 €	0,156%
IMMOAEST NV	1 227 354	- €	0,000%
IMMOFINANZ	116 638	208 899 €	0,011%
IMMOFINANZ DA10	720 883	- €	0,000%
IMPLENIA	55 726	3 659 369 €	0,302%
IMS INTL METAL SCE	53 467	1 207 285 €	0,223%
INABA DENKISANGYO	58 200	1 943 581 €	0,209%
INABATA	169 500	1 929 951 €	0,267%
INCITEC PIVOT	105 766	283 642 €	0,006%
INCYTE	52 167	6 519 717 €	0,025%
INDITEX	177 464	5 863 411 €	0,006%
INDUSTRIVARDEN S,C	3 642	74 028 €	0,001%
INFINEON TECHN,	1 633 991	31 282 758 €	0,144%
INFORMA	137 500	1 048 170 €	0,017%
ING GROEP	893 930	12 666 988 €	0,023%
INGENICO	271 311	24 000 171 €	0,441%
INGERSOLL-RAND	20 793	1 580 933 €	0,008%
INNATE PHARMA	27 598	322 069 €	0,051%
INNOGY SE	6 740	238 495 €	0,001%
INPEX HOLDINGS	217 200	1 994 675 €	0,015%
INSUR,AUSTRAL,GRP	724 906	3 128 049 €	0,031%
INTACT FINANCIAL	3 590	238 041 €	0,003%

INTAGE HOLDINGS IN	9 800	164 457 €	0,049%
INTEL	120 973	4 079 750 €	0,003%
INTER PARFUMS	57 500	1 787 675 €	0,162%
INTERCONTINENTALEX	181 485	10 158 952 €	0,031%
INTERPUBLIC GROUP	83 929	1 928 040 €	0,021%
INTERTEK GROUP	22 000	1 011 902 €	0,014%
INTERTRUST	200 000	3 596 000 €	0,217%
INTESA SA,EPAR,NCV	4 053 415	9 663 341 €	0,026%
INTESA SANPAOLO	3 176 565	8 087 534 €	0,020%
INTL FLAVORS	2 427	300 734 €	0,003%
INTRUM JUSTITIA	48 338	1 693 228 €	0,067%
INTUIT	52 274	5 668 983 €	0,020%
INTUITIVE SURGICAL	29 962	21 471 623 €	0,081%
INVESCO	9 259	265 161 €	0,002%
INVESTEC	20 412	129 827 €	0,003%
INVESTOR SIE B	4 022	158 871 €	0,001%
INWIT	1 122 053	5 545 186 €	0,007%
ION BEAM APPLICAT,	200 859	10 302 058 €	0,673%
IPSEN PROMESSE	190 775	17 887 064 €	0,228%
IPSOS	109 112	3 175 159 €	0,246%
IRISH CONTINENTAL	530 605	2 626 495 €	0,282%
IRISO ELECTR	8 400	503 239 €	0,068%
ISS AS TEMP	18 920	670 926 €	0,010%
ISUZU MOTORS	240 000	2 965 263 €	0,028%
ITOCHU	990 800	13 135 291 €	0,060%
ITV	99 328	254 214 €	0,002%
IWG PLC	1 199 892	4 475 220 €	0,131%
J,HARD,CHESS UNITS	188 981	2 772 611 €	0,043%
JACANA MINERALS LMTD	8 609	- €	0,000%
JACQUES BOGART	27 615	358 719 €	0,176%
JAPAN TOBACCO	149 000	4 523 259 €	0,007%
JARDIN,MATHES,HOLD	5 400	324 389 €	0,001%
JARDINE CYCLE	32 917	966 035 €	0,008%
JCDECAUX	464 570	15 326 164 €	0,219%
JERON,MARTINS ESC,	1 003 535	16 829 282 €	0,159%
JFE HOLDINGS	150 000	2 402 039 €	0,024%
JGC	172 700	2 803 948 €	0,067%
JM AB	150 000	4 443 804 €	0,205%
JOHN WOOD CONSO	125 000	1 111 452 €	0,033%
JOHNSON ELECTRIC LTD	578 839	1 615 624 €	0,066%
JOHNSON JOHNSON	279 035	32 493 861 €	0,010%
JOHNSON MATTHEY PL	67 737	2 439 261 €	0,035%
JPMORGAN CHASE	603 536	49 567 203 €	0,017%
JS GROUP	56 800	1 346 367 €	0,018%
JSP	116 700	2 539 043 €	0,048%
JTEKT	90 000	1 305 672 €	0,026%
JUMBO	214 767	3 174 256 €	0,158%
JUPITER FUND MANAG	500 000	2 490 354 €	0,109%
JUST EAT	1 295 467	8 572 832 €	0,191%
JX HOLDING INC 1 SEC	1 225 600	5 622 047 €	0,036%
K S HOLDINGS	70 000	1 199 362 €	0,062%
K&S NOM	319 008	6 951 184 €	0,167%
KAKAKU,COM	68 400	869 492 €	0,031%
KANAMOTO	62 700	1 576 707 €	0,174%
KANEKA	160 000	1 111 596 €	0,046%
KANSAI PAINT	33 400	662 227 €	0,012%
KAO	41 500	2 125 491 €	0,008%
KAR AUCTION SVCES	119 660	4 885 748 €	0,087%
KARDEX	37 016	3 383 322 €	0,479%
KATO SANGYO	10 700	256 412 €	0,028%
KAUFMAN ET BROAD	55 972	1 931 034 €	0,269%
KAWASAKI HEAVY	806 000	2 285 853 €	0,048%
KBC ANCORA	153 881	6 416 838 €	0,197%
KBC BANCASSURANCE	184 285	11 460 684 €	0,044%
KDDI	268 500	6 582 959 €	0,010%
KEPPEL	967 400	4 492 309 €	0,053%
KERING	109 212	26 478 449 €	0,086%

KERLINK	14 785	253 267 €	0,412%
KERRY GROUP CL,A	345 240	25 444 188 €	0,196%
KERRY LOGISTIC	1 009 106	1 323 298 €	0,060%
KERRY PROPERTIES	349 620	1 133 573 €	0,024%
KESKO CL,B	10 399	464 835 €	0,015%
KEYCORP	30 735	510 933 €	0,003%
KEYENCE	16 200	6 059 708 €	0,013%
KIKKOMAN	45 000	1 255 454 €	0,021%
KIMBERLY CLARK	16 169	1 989 926 €	0,005%
KIMCO REALTY	14 439	298 217 €	0,003%
KINDEN	50 000	651 955 €	0,023%
KINDER MORGAN	94 422	1 919 250 €	0,004%
KINEPOLIS GROUP NV	54 728	2 621 471 €	0,200%
KINGFISHER	159 214	607 035 €	0,007%
KINGSPAN GROUP	685 968	20 513 873 €	0,384%
KINGSTON FINANCIAL	1 676 000	510 140 €	0,012%
KINTETSU WORLD EXP	62 800	886 303 €	0,087%
KION GROUP	1 918	117 439 €	0,002%
KITZ	206 000	1 282 531 €	0,187%
KIWI PROPERTY	145 341	135 367 €	0,011%
KLA TENCOR	21 018	1 868 245 €	0,013%
KLEPIERRE	508 902	18 554 567 €	0,162%
KLOCKNER	15 512	157 214 €	0,016%
KOHL S	5 260	195 784 €	0,003%
KOITO MFG	25 000	1 214 549 €	0,016%
KOMATSU	69 500	1 692 014 €	0,007%
KON,BAM GROEP	1 161 955	5 881 816 €	0,427%
KON,BOSKALIS	220 089	7 114 377 €	0,169%
KON,DSM NOM,	209 608	13 291 243 €	0,116%
KON,PHILIPS ADR	101 859	3 058 008 €	0,011%
KON,PHILIPS ELEC,	726 724	21 896 194 €	0,078%
KONE B	324 081	13 339 174 €	0,072%
KONECRANES A	97 806	3 256 940 €	0,138%
KONICA	89 000	743 783 €	0,018%
KONINKLIJKE AHOLD NV	1 839 565	36 901 674 €	0,145%
KONINKLIJKE KPN	5 034 712	14 212 992 €	0,118%
KONINKLIJKE VOPAK	210 205	8 592 129 €	0,164%
KORIAN PROMESSES	486 093	13 795 319 €	0,606%
KROGER	5 028	138 634 €	0,001%
KRONES HERMANN ORD	35 000	3 680 250 €	0,111%
KUBOTA	100 700	1 411 895 €	0,008%
KUMAGAI GUMI	375 000	912 485 €	0,099%
KYB	375 000	1 824 971 €	0,146%
KYORITSU MAINT	41 200	1 145 981 €	0,106%
KYOWA EXEO	165 500	2 237 125 €	0,140%
L3 TECHNOLOGIES IN	9 157	1 415 138 €	0,012%
LABORATORY AMERICA	11 017	1 477 826 €	0,011%
LAGARDERE	358 864	9 908 235 €	0,274%
LAM RESEARCH	13 694	1 643 459 €	0,008%
LAND SECURITIES	136 455	1 689 534 €	0,017%
LANXESS	85 874	5 400 616 €	0,094%
LAR ESPANA REAL ES	193 009	1 393 525 €	0,213%
LAS VEGAS SANDS	44 690	2 384 609 €	0,006%
LAUDER ESTEE CL,A	31 447	2 493 003 €	0,014%
LBRTY BROADBAND CORP	2 912	235 236 €	0,011%
LE NOBLE AGE	9 208	395 944 €	0,095%
LEAR CORP	1 654	218 946 €	0,002%
LECTRA	14 985	312 587 €	0,048%
LEG IMMOBILIEN	100 532	7 724 879 €	0,159%
LEGAL GL GROUP	411 705	1 190 397 €	0,007%
LEGRAND PROMESSES	649 041	36 683 797 €	0,244%
LEIDOS HOLDINGS	14 847	709 902 €	0,010%
LEKOIL LTD	1 883 471	509 240 €	0,351%
LEM HDG SA REGISTER	6 711	5 855 004 €	0,589%
LEND LEASE	161 443	1 794 003 €	0,028%
LENNAR CL,A	4 783	228 920 €	0,002%
LENZING	11 862	1 870 044 €	0,045%

LEONI	42 196	2 035 746 €	0,129%
LEOPALACE21	171 900	829 355 €	0,064%
LI AND FUNG	3 958 272	395 256 €	0,046%
LI AND FUNG LTD	3 923 512	1 590 741 €	0,047%
LIBERTY SIRIUS XM C	5 900	213 924 €	0,058%
LIBERTY GLOBAL CL A	44 576	1 460 374 €	0,018%
LIBERTY GLOBAL INC-A	2 518	84 447 €	0,001%
LIBERTY LILAC C	36 627	789 010 €	0,014%
LIBERTY PROP,PB	7 145	257 529 €	0,005%
LIBERTY SERIUSXM A	2 221	80 820 €	0,022%
LIFESTYLE INTL	712 574	903 577 €	0,044%
LIMITED BRANDS NV	3 039	133 829 €	0,001%
LINCOLN NATIONAL	5 070	310 253 €	0,002%
LINDE	125 159	19 537 320 €	0,067%
LINEDATA SERVICES	56 280	2 827 507 €	0,767%
LION	78 000	1 310 253 €	0,026%
LISI	350 244	11 873 272 €	0,648%
LIVE NATION	79 740	2 264 227 €	0,039%
LKQ	37 600	1 028 986 €	0,012%
LLOYDS BANKING GRP	455 071	1 446 628 €	0,001%
LLOYDS TSB GROUP	4 290 606	3 326 938 €	0,006%
LOBLAW	4 048	204 784 €	0,001%
L'OCCITANE INTL	635 702	1 209 914 €	0,043%
LOEW'S	274 129	11 987 297 €	0,081%
LONDON STOCK EXCH,	58 765	2 178 695 €	0,017%
LONZA GROUP NOM,	4 668	825 855 €	0,008%
LOOMIS	300 000	8 909 600 €	0,418%
LOWES	33 179	2 550 274 €	0,004%
LULULEMON ATHLETIC	21 581	1 046 614 €	0,017%
LUXOTTICA GROUP	172 546	8 929 256 €	0,036%
LVMH MOET VUITTON	245 338	50 502 827 €	0,048%
LYONDELLBASELL IND	12 643	1 077 944 €	0,003%
LYXOR WORLD WATER	210 000	7 637 700 €	0,262%
M AND T BANK	3 231	467 423 €	0,002%
MACQUARIE ATLAS ROAD	383 567	1 400 708 €	0,067%
MACQUARIE GROUP	41 071	2 642 277 €	0,012%
MACY S	5 639	156 271 €	0,002%
MAEDA	200 000	1 654 640 €	0,101%
MAGNA INTL CL,A	3 729	150 033 €	0,001%
MAISONS DU MONDE	588 287	17 354 467 €	1,300%
MAISONS FRANCE	80 428	4 343 112 €	1,159%
MAN ORD,	204 366	19 747 887 €	0,145%
MANITOU BF	82 517	2 021 667 €	0,209%
MANPOWER	2 665	255 574 €	0,004%
MANULIFE FINANCIAL	42 454	702 110 €	0,002%
MANUTAN INTL	9 000	626 400 €	0,118%
MAPFRE	2 522 464	8 109 722 €	0,082%
MARATHON OIL	99 762	1 473 741 €	0,012%
MARATHON PETROLEUM	62 352	2 946 351 €	0,012%
MARINE HARVEST	96 569	1 376 066 €	0,021%
MARKEL	163	148 722 €	0,001%
MARKETAXESS HLDGS	4 160	729 240 €	0,011%
MARKS SPENCER GRP	558 311	2 199 822 €	0,034%
MARR	273 419	5 550 406 €	0,193%
MARRIOTT INTL CL,A	6 000	528 334 €	0,002%
MARSHAALLS	700 000	2 887 408 €	0,354%
MARUBENI	417 200	2 399 653 €	0,024%
MASTERCARD CL,A	177 830	18 699 958 €	0,017%
MATSUMOTOKIYOSHI	15 000	664 541 €	0,027%
MATSUSH,ELEC,IND,	91 500	965 825 €	0,004%
MAUREL ET PROM DT 17	412 396	- €	0,000%
MAZDA MOTOR	85 500	1 149 996 €	0,014%
MC CARTHY AND STONE	3 914 069	8 649 118 €	0,728%
MC GRAW HILL ORD,	47 440	5 798 986 €	0,018%
MCDONALDS	5 456	661 168 €	0,001%
MCKESSON	4 558	631 826 €	0,002%
MEAD JOHNSON NUTRI	4 303	358 386 €	0,002%

MEDIASET	790 593	3 067 501 €	0,067%
MEDIAWAN BSA	137 500	49 500 €	0,501%
MEDIAWAN PREF	197 224	1 972 240 €	0,718%
MEDIBANK	1 112 477	2 237 570 €	0,040%
MEDIOBANCA	97 607	824 779 €	0,011%
MEDTRONIC HOLDINGS	371 917	28 013 308 €	0,027%
MEGGITT	124 052	645 859 €	0,016%
MEGMILK SNOW BRAND	90 000	2 314 566 €	0,127%
MEIJI HOLDINGS	17 500	1 361 176 €	0,011%
MEKONOMEN AB	148 642	2 747 369 €	0,414%
MELCO CROWN ADR	3 901	67 621 €	0,001%
MELCO CROWN ENTER	2	- €	0,000%
MELCO INTL DEV,	452 571	747 025 €	0,029%
MELEXIS	35 000	2 842 350 €	0,087%
MERCADOLIBRE	21 829	4 316 001 €	0,049%
MERCIALYS	69 277	1 211 308 €	0,075%
MERCK AND CO, NEW	727 537	43 221 636 €	0,027%
MERCK KGAA	373 769	39 918 529 €	0,289%
MERIDIAN ENERGY	1 846 219	3 378 701 €	0,072%
MERLIN ENTERTAINMENT	766 842	4 299 982 €	0,075%
MERLIN PROPERTIES	375 000	3 930 000 €	0,080%
MERSEN	72 054	1 822 966 €	0,352%
METCASH	809 462	1 426 034 €	0,083%
METHANEX CORP	34 200	1 499 677 €	0,038%
METLIFE	18 469	912 096 €	0,002%
METRO	580 510	17 403 690 €	0,179%
METROPOLE TV	31 000	648 520 €	0,025%
METSO	370 375	10 511 243 €	0,246%
METTLER TOLEDO	655	293 288 €	0,003%
MGI COUTIER	6 860	222 950 €	0,026%
MGM CHINA HOLDINGS	465 514	907 282 €	0,012%
MGM MIRAGE	235 588	6 035 352 €	0,041%
MICHAEL PAGE INTL	170 000	850 497 €	0,052%
MICHELIN	516 200	58 769 370 €	0,286%
MICROCHIP TECHN,	122 627	8 459 090 €	0,057%
MICRON TECHNOLOGY	73 399	1 983 293 €	0,007%
MICROSOFT	1 048 110	64 539 783 €	0,014%
MID AMERICA APARTM	2 986	284 041 €	0,003%
MIGHTY RIVER POWER	1 383 732	2 848 860 €	0,100%
MINTH GROUP	394 000	1 483 662 €	0,035%
MIRAI INDUSTRY	65 700	871 002 €	0,257%
MIRVAC GROUP	2 465 610	3 851 279 €	0,067%
MITSU,UFJ LEASE	513 500	2 391 278 €	0,057%
MITSUB,ELECTRIC	574 600	7 699 582 €	0,027%
MITSUBISHI	411 400	8 303 597 €	0,026%
MITSUBISHI CH,HDG	199 600	1 442 653 €	0,013%
MITSUBISHI GAS	40 000	775 969 €	0,017%
MITSUBISHI TOKYO	2 360 500	13 858 381 €	0,017%
MITSUBOSHI BELTING	138 000	1 197 281 €	0,212%
MITSUI	360 400	4 876 196 €	0,020%
MITSUI CHEMICALS	450 000	2 076 691 €	0,044%
MITSUI FUDOSAN	16 000	318 711 €	0,002%
MITSUI MINING	500 000	1 590 032 €	0,087%
MITSUI SUMITOMO	87 200	2 590 099 €	0,014%
MIURA	123 500	1 851 775 €	0,099%
MIZUHO FCIAL GRP	1 371 300	2 347 250 €	0,005%
MOBILEONE	669 060	953 562 €	0,072%
MOHAWK INDUSTRIES	1 142	245 035 €	0,002%
MOLSON COORS CL,B	3 415	305 595 €	0,002%
MONCLER SPA	453 138	9 302 923 €	0,179%
MONDELEZ INTL	370 003	14 903 211 €	0,024%
MONDI	17 375	391 461 €	0,005%
MONEYSUPERMKT,COM	717 807	2 771 190 €	0,132%
MONSANTO	10 048	1 063 469 €	0,002%
MONSTER BEVERAGE	97 758	4 219 987 €	0,017%
MOODY S	1 436	150 427 €	0,001%
MORGAN STANLEY	379 365	15 195 172 €	0,020%

MORI SEIKI	70 000	1 019 634 €	0,054%
MORITA	115 400	1 566 682 €	0,246%
MOTOROLA SOLTN-ED	207 515	16 728 478 €	0,127%
MTR	790 028	4 148 788 €	0,013%
MTU AERO ENGINES	84 445	10 298 068 €	0,162%
MUNCHENER RUCKVERS	149 037	27 333 386 €	0,096%
MURATA MFG	64 100	8 516 727 €	0,028%
MUSASHI SEIMITSU I	61 500	1 468 611 €	0,197%
MUSASHINO BANK	64 900	1 797 030 €	0,192%
NACHI-FUJIKOSHI	150 000	717 402 €	0,060%
NAFCO	150 800	2 276 298 €	0,506%
NAKANISHI	141 900	5 167 360 €	0,452%
NAT,AUSTRALIA BANK	343 488	8 167 961 €	0,013%
NATEXIS BQ,POPUL,	2 371 514	13 697 865 €	0,076%
NATIONAL GRID TRAN	112 307	1 330 798 €	0,003%
NATIONAL OILWELL	6 852	256 834 €	0,002%
NATUREX	28 800	2 372 544 €	0,311%
NAVIENT CORPORATION	89 568	1 236 056 €	0,031%
NCC GROUP PLC	2 889 162	4 492 676 €	1,045%
NEC SYSTEM INTEGR,	16 500	298 074 €	0,001%
NEOPOST	106 264	3 824 441 €	0,307%
NESTE OY	1 017 204	37 188 978 €	0,397%
NESTLE NOM,	218 519	15 686 502 €	0,007%
NETFLIX INC	62 235	8 600 772 €	0,014%
NEURONES	124 446	2 974 259 €	0,513%
NEW WORLD DEV,	1 102 637	1 268 192 €	0,011%
NEWBELCO	206 402	21 238 766 €	0,010%
NEWCREST MING	202 324	3 213 691 €	0,026%
NEWELL RUBBERMAID	67 258	2 966 257 €	0,014%
NEWMONT MINING	46 979	1 447 738 €	0,009%
NEXANS	238 771	11 603 077 €	0,550%
NEXITY	129 798	5 981 741 €	0,235%
NEXON CO LTD	348 100	5 166 881 €	0,080%
NEXT GROUP	6 621	334 417 €	0,005%
NEXTERA ENERGY INC	125 478	15 060 176 €	0,027%
NEXUS	158 746	3 207 463 €	1,009%
NH HOTELES	120 000	530 400 €	0,034%
NHK SPRING	80 000	824 971 €	0,033%
NIDEC	39 500	3 511 516 €	0,013%
NIELSEN HOLDINGS PLC	3 605	139 239 €	0,001%
NIFCO	50 300	2 359 263 €	0,094%
NIKE CL,B	5 248	273 452 €	0,000%
NIKON	89 500	1 212 057 €	0,022%
NINTENDO	2 300	498 578 €	0,002%
NIP,SUISAN KAISHA	227 000	1 057 099 €	0,073%
NIPPON DENSETSU	45 000	757 803 €	0,069%
NIPPON LIGHT METAL	475 000	976 464 €	0,077%
NIPPON SEIKI	148 000	2 974 157 €	0,243%
NIPPON STEEL	100 000	2 152 207 €	0,011%
NIPPON TELEG,TEL,	112 500	4 485 652 €	0,005%
NISHIMATSU CONST,	175 000	804 665 €	0,063%
NISHIO RENT ALL	120 800	3 172 546 €	0,446%
NISSAN MOTOR	262 300	2 362 637 €	0,006%
NISSHIN FUDOSAN	491 100	2 352 896 €	1,046%
NISSIN KOGYO	27 300	457 214 €	0,042%
NITTA CORP	120 800	3 147 206 €	0,399%
NN GROUP N,V,	909 141	27 715 163 €	0,265%
NOBLE ENERGY	42 914	1 377 838 €	0,010%
NOBLE GROUP	9 421 610	1 223 013 €	0,072%
NOK	35 000	758 852 €	0,020%
NOKIA	3 048 729	15 335 107 €	0,052%
NOKIAN RENKAAT	185 223	7 249 628 €	0,136%
NOMURA HOLDINGS	65 800	382 002 €	0,002%
NOMURA RL ESTATE	91 000	1 354 539 €	0,047%
NORD,AFFINERIE	89 472	5 620 631 €	0,199%
NORDEA BANK	299 463	3 208 112 €	0,007%
NORDSTROM	29 772	1 296 323 €	0,018%

NORFOLK SOUTHERN	83 420	8 733 147 €	0,029%
NORMA GROUP AG	62 908	2 789 655 €	0,197%
NORTHERN TRUST	1 831	148 219 €	0,001%
NORTHROP GRUMMAN	68 684	15 273 529 €	0,039%
NOVARTIS	146 127	10 148 561 €	0,006%
NOVO NORDISK AS	58 791	1 893 475 €	0,003%
NOVOZYMES B NV	123 036	4 573 128 €	0,049%
NTN	325 000	1 510 740 €	0,061%
NTT DOCOMO	267 400	5 816 702 €	0,013%
NUCOR	27 906	1 558 175 €	0,009%
NUFARM	305 453	2 113 259 €	0,114%
NVIDIA	109 258	11 127 553 €	0,018%
NXP SEMICONDUCTORS	98 029	9 486 234 €	0,028%
O REILLY AUTOMOT,	24 937	6 291 431 €	0,027%
OAKLEY CAPITAL INV	1 490 592	2 640 298 €	0,728%
OBARA GROUP INC	39 400	1 626 515 €	0,189%
OBAYASHI	100 000	873 469 €	0,014%
OBRASCON HUARTE	237 957	1 021 311 €	0,080%
OC OERLIKON CORP,	415 820	4 156 064 €	0,122%
OCADO GROUP	669 786	1 887 273 €	0,112%
OCCIDENTAL PETROL,	168 830	10 001 467 €	0,022%
OENEO	270 640	2 324 798 €	0,430%
OIL SEARCH	419 636	2 160 959 €	0,028%
OKINAWA CELLULAR	167 500	5 066 601 €	0,006%
OLD MUTUAL	258 082	605 299 €	0,005%
OLYMPUS OPTICAL	13 200	474 039 €	0,004%
OMNICOM GROUP	4 291	345 872 €	0,002%
OMRON	33 200	1 360 816 €	0,016%
OMV	125 775	4 639 211 €	0,038%
ONEOK	3 810	197 491 €	0,002%
ONTEX GROUP AIW	368 054	11 078 425 €	0,447%
OPEN HOUSE CO	90 000	2 011 747 €	0,157%
OPHIR ENERGY PLC	1 308 874	1 319 892 €	0,185%
ORACLE	763 248	31 834 410 €	0,019%
ORANGE	3 857 616	56 186 177 €	0,145%
ORCHESTRA-PREMAMAN	26 784	244 538 €	0,144%
ORÉAL	214 438	38 631 006 €	0,038%
ORICA	266 859	3 349 894 €	0,071%
ORIENT OVERSEAS	129 500	646 565 €	0,021%
ORIGIN ENTERPRISES	273 022	1 819 146 €	0,217%
ORION CL,B	270 478	13 218 260 €	0,261%
ORIX	1 095 600	15 145 167 €	0,083%
ORKLA S,A	38 542	322 643 €	0,004%
ORPEA	300 419	27 031 702 €	0,496%
OSAKA GAS	364 000	1 291 928 €	0,017%
OSRAM LICHT AG	105 538	6 200 358 €	0,101%
OTSUKA	9 800	496 661 €	0,010%
OVS	685 387	3 988 952 €	0,302%
OW BUNKER AS	41 498	- €	0,113%
OXFORD INSTRUMENTS	79 333	760 588 €	0,138%
OZ MINERALS	285 096	1 592 170 €	0,095%
P,P,G,INDUSTRIES	17 188	1 688 668 €	0,007%
PACCAR	6 357	399 411 €	0,002%
PACIFIC INDUSTRIAL	175 000	2 324 425 €	0,290%
PACIFIC METALS	449 000	1 461 755 €	0,229%
PACKAGING AMERICA	2 354	201 649 €	0,002%
PADDY POWER PLC	32 629	3 279 215 €	0,039%
PAL	14 900	337 557 €	0,064%
PALO ALTO NETWORKS	2 000	210 705 €	0,002%
PALTAC	90 000	2 340 997 €	0,037%
PANDORA	33 444	3 471 991 €	0,030%
PARGESA HOLDING	1 642	108 592 €	0,002%
PARIS-ORLEANS	41 352	1 110 921 €	0,054%
PARKER-HANNIFIN	10 690	1 602 376 €	0,008%
PARROT PROMESSES	68 000	605 200 €	0,225%
PARTNERS GROUP NOM	179	90 039 €	0,001%
PATHEON NV	6 460	159 092 €	0,004%

PATTERSON CIES	3 599	152 197 €	0,004%
PAYCHEX	7 074	389 564 €	0,002%
PAYPAM HOLDING INC	449 626	18 085 092 €	0,037%
PAYSAFE GROUP PLC	505 853	2 765 543 €	0,104%
PBF ENERGY SER A	193 400	4 008 862 €	0,176%
PCCW	7 966 440	4 389 593 €	0,103%
PEARSON	191 196	1 525 678 €	0,023%
PEMBINA PPLN INC TR	7 105	209 902 €	0,002%
PENAUILLÉ POLYSCES	43 563	203 613 €	0,027%
PEPSICO	14 509	1 517 439 €	0,001%
PERNOD-RICARD	247 935	27 495 992 €	0,093%
PERPETUAL	9 378	348 820 €	0,020%
PERRIGO COMPANY	2 050	127 249 €	0,001%
PERSIMMON	60 580	1 483 158 €	0,020%
PETRA DIAMONDS	1 141 709	1 779 373 €	0,215%
PETROFAC	141 006	1 515 077 €	0,041%
PEUGEOT S,A,	2 208 797	41 691 043 €	0,251%
PFIZER	746 953	23 891 601 €	0,013%
PG AND E	14 607	906 288 €	0,003%
PHILIP MORRIS	254 544	26 869 261 €	0,016%
PHILLIPS 66	216 319	16 022 431 €	0,042%
PIERRE VACANCES	20 000	863 200 €	0,204%
PINGUELY HAULOTTE	108 472	1 478 473 €	0,346%
PIONEER NAT,RES,	23 957	4 171 392 €	0,014%
PLANT IMPACT	1 057 187	630 382 €	1,294%
PLASTIC OMNIUM	422 866	14 436 645 €	0,277%
PLAYTECH	422 469	4 598 604 €	0,133%
PNC FIN,SCES GROUP	181 573	20 412 639 €	0,037%
PORR AG	76 896	2 677 519 €	0,163%
PORSHE AUTOMOBILE	302 768	15 483 556 €	0,198%
POSTE ITALIANE	425 900	2 661 875 €	0,033%
POSTNL NV	46 257	204 826 €	0,010%
POWER CORP,CANADA	12 709	278 343 €	0,003%
POWER FINANCIAL	10 259	252 951 €	0,001%
PRA HEALTH SCES	29 930	1 825 379 €	0,048%
PRADA	559 525	2 197 845 €	0,022%
PRAXAIR	49 302	5 466 988 €	0,017%
PREMIER OIL	1 848 684	1 361 710 €	0,362%
PRICE T ROWE GROUP	6 546	417 101 €	0,003%
PRICELINE,COM	21 641	36 015 456 €	0,044%
PRIMA MEAT PACKERS	987 000	4 074 543 €	0,391%
PRINCIPAL FCIAL	6 860	404 782 €	0,002%
PROCTER GAMBLE	161 312	13 551 384 €	0,006%
PROGRESSIVE	13 763	504 169 €	0,002%
PROLOGIS	34 604	1 678 515 €	0,007%
PROSEGUR	650 000	3 666 000 €	0,105%
PROSEGUR CASH S,A,	679 694	1 454 545 €	0,110%
PROSIEBEN NOM,	111 809	4 640 633 €	0,048%
PROTO	41 400	507 860 €	0,198%
PROVIDENT FINANCI,	38 661	1 354 694 €	0,026%
PRUDENTIAL	73 618	1 451 186 €	0,003%
PRUDENTIAL FCIAL	9 301	927 709 €	0,002%
PRYSMIAN	129 474	3 208 366 €	0,060%
PUBLIC SCE ENT,	9 181	380 700 €	0,002%
PUBLICIS GROUPE	395 653	25 919 228 €	0,175%
PULTE HOMES	61 708	1 358 724 €	0,020%
PVH	15 431	1 492 820 €	0,020%
QBE INS,GROUP	170 868	1 570 906 €	0,012%
QIAGEN N,V	335 426	9 126 941 €	0,148%
QUALCOMM	257 425	13 800 897 €	0,017%
QUANTUM PHARMA	2 316 974	1 070 039 €	1,370%
QUEST DIAGNOSTICS	3 754	344 636 €	0,003%
QUINTILES TRANSNTL	2 882	216 995 €	0,001%
RAIFFEIS,INTL BK	310 273	6 563 825 €	0,094%
RAITO KOGYO	85 000	807 350 €	0,147%
RAKUTEN	268 700	2 513 849 €	0,019%
RALPH LAUREN A	2 168	165 445 €	0,004%

RAMSAY HEALTH CARE	68 022	3 390 790 €	0,034%
RANDGOLD RESOURCES	4 432	360 913 €	0,005%
RANDSTAD PROV,DIV,	79 456	4 298 570 €	0,043%
RATHBONE BROTHERS	65 542	1 835 299 €	0,129%
RATIONAL	22 680	9 900 954 €	0,199%
RAYMOND JAMES FIN,	3 317	236 505 €	0,002%
RAYSEARCH LABS B	250 000	6 152 316 €	0,976%
REAL GOLD MINING LTD	90 500	- €	0,010%
REALESTATE,COM,AU	11 057	467 895 €	0,008%
RECKITT BENCKISER	64 378	5 484 135 €	0,009%
RECORDATI IND,CHI,	150 000	4 765 500 €	0,072%
RECRUIT HOLDINGS	65 000	3 097 835 €	0,011%
RED ELECTRICA CORPOR	1 243 801	22 388 418 €	0,230%
RED HAT	81 300	6 575 148 €	0,046%
REED ELSEVIER	199 693	3 651 583 €	0,019%
REGENCY CENTERS	1 891	117 380 €	0,001%
REGENERON PHARM,	9 345	3 385 799 €	0,009%
REGENERSIS	676 462	1 795 357 €	1,163%
REGIONS FINANCIAL	1 063 600	14 449 168 €	0,088%
REINSU GRP AMERICA	1 494	177 372 €	0,002%
RELO HOLDINGS	163 000	2 524 736 €	0,107%
RELX N,V,	776 176	13 474 415 €	0,076%
REMY COINTREAU	104 490	9 589 047 €	0,210%
RENAISSANCE RE HLD	978	132 268 €	0,002%
RENAULT	174 349	14 197 239 €	0,059%
RENISHAW PLC	281 959	10 262 345 €	0,387%
REPSOL YPF	1 490 908	21 580 893 €	0,100%
REPUBLIC SCES	24 995	1 467 847 €	0,007%
RESMED	2 220	149 384 €	0,002%
RESONA HOLDINGS	1 285 000	6 446 564 €	0,055%
RESORTTRUST	69 000	1 134 754 €	0,064%
RESTAURANT BRANDS	2 923	151 806 €	0,001%
RESTAURANT GROUP	500 000	1 949 608 €	0,249%
REXEL PROMESSES	1 166 738	19 857 881 €	0,385%
REYNOLDS AMERICAN	15 032	885 715 €	0,001%
REZIDOR HOTEL	898 977	3 219 626 €	0,516%
RHEINMETALL ORD,	4 912	386 231 €	0,011%
RIB SOFTWARE	96 342	1 194 641 €	0,206%
RIGHTMOVE	286 156	13 342 571 €	0,309%
RINNAI	17 100	1 271 237 €	0,033%
RIO TINTO	17 677	762 278 €	0,004%
RITE AID	20 740	82 413 €	0,002%
RM2 INTERNATIONAL	2 577 337	693 076 €	0,643%
RNTS MEDIA	462 304	824 288 €	0,404%
ROBERTET	8 000	2 800 000 €	0,371%
ROCHE HOLDING BJ	53 976	12 897 166 €	0,008%
ROCKWELL AUTOMAT,	21 673	3 155 255 €	0,017%
ROCKWELL COLLINS	30 455	2 766 591 €	0,019%
ROGERS CIONS CL,B	36 948	1 523 095 €	0,009%
ROHM	54 500	3 383 957 €	0,049%
ROLLS ROYCE HOLDIN	124 862	1 100 736 €	0,007%
ROPER INDUSTRIES	18 768	3 623 397 €	0,018%
ROSS STORES	117 899	7 261 004 €	0,030%
ROTORK PLC	1 410 566	4 012 519 €	0,162%
ROYAL BANK CANADA	30 815	2 093 147 €	0,002%
ROYAL BK SCOT, GRP	244 507	692 098 €	0,002%
ROYAL CARIBBEAN	18 351	1 683 340 €	0,009%
ROYAL DUTCH SHELL	192 352	4 713 782 €	0,004%
ROYAL DUTCH SHELL	245 090	6 259 781 €	0,005%
ROYAL MAIL PLC	120 606	599 293 €	0,012%
RPS GROUP PLC	650 000	1 873 319 €	0,290%
RTL GROUP	90 439	6 828 054 €	0,058%
RUBIS	157 988	14 514 358 €	0,347%
RYANAIR HOLDINGS	388 542	5 643 573 €	0,032%
RYOBI	175 000	710 690 €	0,102%
RYOHIN KEIKAKU	15 800	3 233 445 €	0,056%
SA SA INTERNATIONAL	2 115 534	778 818 €	0,071%

SAFESTORE HOLDING	844 830	3 743 605 €	0,404%
SAFEWAY PDC LLC CVR	60 198	- €	0,000%
SAFEWAY PDC LLC CVR	60 198	- €	0,000%
SAFRAN	336 917	23 594 298 €	0,081%
SAINSBURY	77 534	239 591 €	0,004%
SAINT MARC HOLDINGS	66 600	1 827 337 €	0,292%
SAINT-GOBAIN	609 816	29 353 493 €	0,110%
SAIPEM	8 530 964	3 629 925 €	0,084%
SAKATA INKS	21 500	276 552 €	0,034%
SALESFORCE,COM	178 987	13 804 532 €	0,025%
SALVATORE FERRAGAM	113 346	3 182 756 €	0,067%
SALZGITTER	8 726	296 117 €	0,015%
SAMPO A	328 783	14 617 692 €	0,059%
SAMSONITE INTL SA	769 390	2 619 555 €	0,054%
SAN A	29 600	1 256 721 €	0,093%
SAN,AV,ADR SPONS,	248 520	10 514 263 €	0,019%
SANDS CHINA	321 542	1 392 627 €	0,004%
SANDVIK	239 942	3 364 477 €	0,019%
SANKEN ELECTRIC	150 000	615 456 €	0,120%
SANKYU	651 000	3 687 070 €	0,200%
SANOFI AVENTIS	1 596 877	135 127 732 €	0,123%
SANTOS	43 719	118 492 €	0,002%
SANYO CHEMICAL IND	23 000	902 207 €	0,098%
SANYO DENKI	75 000	522 948 €	0,116%
SAP SYSTEME ORD,	299 486	27 546 722 €	0,024%
SARTORIUS PRIV,	117 193	9 639 124 €	0,313%
SARTORIUS STEDIM BIO	381 265	24 076 885 €	1,018%
SATO HOLDINGS	38 600	768 243 €	0,111%
SAVANNAH PETROLEUM	3 352 716	1 509 173 €	1,221%
SBA COMMUNICATIONS	2 844	320 071 €	0,002%
SBI	203 500	2 650 042 €	0,091%
SCANDINAV TOBACCO	217 652	3 567 874 €	0,218%
SCHAEFFLER PREF,	22 241	366 532 €	0,013%
SCHEIN HENRY	1 925	305 916 €	0,002%
SCHIBSTED CLASS A	46 230	1 112 187 €	0,043%
SCHIBSTED CLASS B	38 463	822 749 €	0,036%
SCHINDLER HOLD,BP	1 926	348 661 €	0,005%
SCHINDLER HOLD,NOM	1 614	286 300 €	0,004%
SCHLUMBERGER ORD	216 534	15 811 608 €	0,016%
SCHNEIDER ELECTRIC	904 561	62 080 021 €	0,152%
SCHOELLER BLECKM,	26 063	1 701 914 €	0,163%
SCHROEDERS	40 000	1 417 047 €	0,018%
SCHWAB CHARLES	274 863	10 487 737 €	0,021%
SCOR REGPT	548 453	19 431 690 €	0,284%
SCRIPPS NETWORKS	2 623	192 197 €	0,003%
SEAGATE TECHNOLOGIE	5 442	233 697 €	0,002%
SEALED AIR	4 909	200 023 €	0,003%
SEB	193 023	25 266 711 €	0,385%
SEGRO NV09	534 420	2 850 490 €	0,054%
SEIBU HOLDINGS INC	185 700	2 862 317 €	0,054%
SEKISUI CHEMICAL	136 100	2 136 626 €	0,027%
SEKISUI HOUSE	122 100	1 875 861 €	0,017%
SEMBCORP MARINE	855 597	1 096 332 €	0,048%
SEMICONDUCTOR MANUF	978 800	1 132 827 €	0,021%
SEMPRA ENERGY	4 303	444 562 €	0,002%
SERVICENOW	160 229	13 103 857 €	0,095%
SES GLOBAL FDR	785 284	17 123 118 €	0,205%
SEVERN TRENT	57 957	1 614 095 €	0,025%
SFR GROUP	320 679	9 456 824 €	0,029%
SGS NOM,	285	568 909 €	0,004%
SHAFTESBURY	782 818	8 374 588 €	0,281%
SHANGRI LA ASIA	1 078 269	1 468 480 €	0,030%
SHAW CIONS CL,B	68 805	1 329 889 €	0,015%
SHERWIN-WILLIAMS	12 374	3 588 697 €	0,013%
SHIKOKU CHEMICALS	239 000	2 408 449 €	0,405%
SHIMA SEIKI MFG	12 500	439 461 €	0,034%
SHIMACHU	51 200	1 164 652 €	0,100%

SHIMANO	2 000	272 697 €	0,002%
SHIN-ETSU CHEMICAL	114 500	9 265 296 €	0,026%
SHINMAYWA IND,	130 000	1 159 507 €	0,130%
SHINSEI BANK	863 000	1 484 435 €	0,031%
SHIONOGI	85 200	4 109 159 €	0,026%
SHIRE	59 663	3 251 365 €	0,007%
SHIRE ADR	7 176	1 168 972 €	0,001%
SHIZUOKA GAS	116 900	740 556 €	0,153%
SHOP APOTHEKE EUR	90 684	2 460 257 €	1,000%
SHOWA DENKO KK	95 000	1 582 271 €	0,063%
SHUI ON LAND	10 786 579	2 270 995 €	0,134%
SHUN TAK HOLDINGS	1 774 474	587 079 €	0,058%
SIA ENGINEERING	63 130	155 871 €	0,005%
SIEMENS	499 723	64 164 433 €	0,059%
SIIX	76 400	2 871 891 €	0,303%
SIKA POR,	2 169	12 176 629 €	0,101%
SIMCORP	296 683	16 756 567 €	0,715%
SIMS	407 969	3 596 517 €	0,206%
SINGAPORE AIRPORT	752 507	2 457 166 €	0,068%
SINGAPORE EXCHANGE	281 157	1 448 584 €	0,026%
SINGAPORE POST	2 820 820	2 566 956 €	0,124%
SINGAPORE PRESS	1 789 954	4 251 814 €	0,112%
SINGAPORE TECHN,	1 444 300	3 604 710 €	0,046%
SINGAPORE TELECOM,	915 325	2 400 852 €	0,006%
SINO LAND	667 605	1 093 934 €	0,038%
SINTOKOGIO	68 800	558 228 €	0,126%
SJM HLDGS LTD	1 062 749	808 057 €	0,019%
SK KAKEN	19 000	1 737 708 €	0,121%
SKANDINAV,ENSK,A	309 028	3 226 441 €	0,014%
SKANSKA S,B	35 103	775 635 €	0,009%
SKF S,B LIBRE	18 784	348 761 €	0,004%
SKY CITY ENTERT,	104 703	283 998 €	0,016%
SL GREEN REALTY	13 169	1 312 775 €	0,013%
SMC	31 700	8 756 201 €	0,047%
SMITH NEPHEW	422 115	6 001 308 €	0,048%
SMITHS GROUP	155 118	2 936 233 €	0,039%
SMUCKER	11 137	1 364 909 €	0,010%
SNAM RETE GAS	6 899 762	27 971 635 €	0,197%
SNAP CL A	190 583	4 014 618 €	0,028%
SNAP ON	2 457	387 473 €	0,004%
SOCIETE GENERALE A	1 536 304	73 051 255 €	0,190%
SOCIETE LDC	16 000	1 499 520 €	0,096%
SODEXHO ALLIANCE	242 198	26 702 330 €	0,158%
SODEXO PF 2020	10 000	1 102 500 €	0,000%
SODEXO PRI FID 2019	41 800	4 608 450 €	0,000%
SOFTBANK	229 300	15 126 335 €	0,021%
SOITEC SA	12 702	504 396 €	0,042%
SOLOCAL GROUPE	700 000	698 600 €	0,121%
SOLUTIONS 30	49 299	811 462 €	0,241%
SOLVAY	78 746	9 020 354 €	0,074%
SOMFY	13 589	5 571 490 €	0,184%
SOMPO HOLDING	221 700	7 587 802 €	0,053%
SONIC HEALTHCARE	231 634	3 654 466 €	0,055%
SONOVA HOLDING NOM	2 522	327 220 €	0,004%
SOPHOS GROUP	1 086 096	3 448 891 €	0,236%
SOPRA GROUP	130 210	17 402 567 €	0,634%
SOUTHWEST AIRLINES	274 180	13 781 419 €	0,045%
SPECTRIS	40 000	1 168 245 €	0,034%
SPECTRUM BRDS HLDG	1 547	201 064 €	0,001%
SPIE	440 139	9 953 743 €	0,286%
SPIRAX-SARCO ENG PLC	30 647	1 708 822 €	0,042%
SPLUNK INC	80 883	4 710 581 €	0,058%
SPRINT NEXTEL CORP	21 538	174 793 €	0,001%
SQUARE CL A	128 210	2 071 403 €	0,062%
SRA HOLDINGS	6 700	165 504 €	0,044%
SRP GROUP	274 191	6 317 361 €	0,800%
ST, JAMES S PLACE	1 113 037	13 820 242 €	0,211%

STABILUS GMBH	71 961	4 346 444 €	0,291%
STAGECOACH GROUP NV	1 238 643	3 032 525 €	0,216%
STANDARD CHARTERED	219 813	1 960 918 €	0,007%
STANDARD LIFE BK PLC	139 218	577 349 €	0,007%
STANLEY BLACK DECKER	107 967	13 412 721 €	0,071%
STARBUCKS	131 290	7 167 522 €	0,009%
STARHUB	1 302 842	2 510 662 €	0,075%
STARTS	254 200	4 956 879 €	0,471%
STATE STREET	305 041	22 705 169 €	0,080%
STATOILHYDRO	53 103	848 029 €	0,002%
STEEL DYNAMICS	65 752	2 136 917 €	0,027%
STEF TFE	49 263	3 977 987 €	0,374%
STERICYCLE	13 100	1 015 248 €	0,015%
STMICROELECTRONICS	2 127 529	30 487 491 €	0,234%
STOCKLAND	1 725 519	5 710 501 €	0,071%
STORA ENSO S,R	1 325 651	14 688 213 €	0,217%
STORE EL,SYS,PROM,	102 389	3 142 318 €	0,796%
STRATEC BIOMEDICAL	130 571	7 344 619 €	1,101%
STRAUMANN HOLDING	9 161	3 976 998 €	0,058%
STRYKER	49 477	6 090 082 €	0,013%
SUDZUCKER	384 922	9 053 365 €	0,189%
SUEZ ENVIRON,COMP,	1 648 302	24 403 111 €	0,291%
SUMCO	140 000	2 177 882 €	0,048%
SUMITOMO	413 400	5 194 382 €	0,033%
SUMITOMO REALTY	18 000	435 879 €	0,004%
SUMITOMO ELECTRIC	284 200	4 402 024 €	0,036%
SUMITOMO FORESTRY	329 000	4 665 296 €	0,185%
SUMITOMO METAL	75 000	996 497 €	0,013%
SUMITOMO MITSUI	564 500	19 159 276 €	0,040%
SUMITOMO SEIKA	42 500	1 688 517 €	0,304%
SUMMIT INTERNAT	1 149 116	- €	0,014%
SUN ART RETAIL GRO	2 055 500	1 800 294 €	0,022%
SUN FRONT,FUDOSAN	130 000	1 058 063 €	0,304%
SUN HUNG KAI PROP,	305 300	4 194 569 €	0,011%
SUN LIFE FINANCIAL	4 394	149 588 €	0,001%
SUNCOR ENERGY	30 177	863 802 €	0,002%
SUNCORP GROUP	78 561	740 195 €	0,006%
SUNTRUST BANKS	10 824	559 644 €	0,002%
SURUGA BANK	374 700	7 369 498 €	0,161%
SUZUKI MOTOR	153 800	5 964 622 €	0,031%
SVB FINANCIAL GROUP	7 700	1 339 716 €	0,015%
SVENSKA HANDEL FONDE	107 362	1 381 762 €	0,006%
SWATCH GROUP NOM,	1 707	111 297 €	0,006%
SWATCH GROUP POR,	480	160 829 €	0,002%
SWECO B	243 325	5 203 232 €	0,220%
SWEDBANK A	10 257	222 986 €	0,001%
SWIRE PACIFIC CL,A	142 500	1 330 366 €	0,016%
SWIRE PROPERTIES	697 326	2 088 958 €	0,077%
SWISS LIFE HO,NOM,	3 011	909 024 €	0,009%
SWISS RE	48 027	4 035 336 €	0,013%
SWISSCOM NOM,	7 142	3 082 825 €	0,014%
SWORD GROUP	102 000	3 213 000 €	1,069%
SYDNEY AIRPORT UNITS	704 312	3 400 872 €	0,031%
SYMRISE	213 049	13 281 475 €	0,164%
SYNCHRONY FCIAL	67 136	2 153 022 €	0,008%
SYNERGIE	142 870	5 291 905 €	0,586%
SYNGENTA NOM,	6 950	2 870 109 €	0,008%
SYNOPSIS	2 238	150 930 €	0,001%
SYSCO	33 823	1 641 896 €	0,006%
SYSMEX	60 100	3 403 885 €	0,029%
T AND D	306 600	4 157 288 €	0,045%
T&K TOKA	174 600	1 552 912 €	0,698%
TABCORP HOLDINGS	385 747	1 306 871 €	0,046%
TAKAMATSU	55 100	1 203 434 €	0,142%
TAKARA LEBEN	125 000	520 222 €	0,101%
TAKEAWAY,COM B,V,	110 382	3 475 929 €	0,256%
TAKEDA PHARMA,	24 200	1 061 770 €	0,003%

TAKKT	494 357	10 749 793 €	0,753%
TAKUMA	125 000	1 142 180 €	0,151%
TALANX AG	187 775	6 206 903 €	0,074%
TARGA RESOURCES	3 022	169 247 €	0,002%
TARGET	174 861	9 023 027 €	0,032%
TARKETT SA	529 928	21 464 734 €	0,832%
TATE LYLE	143 536	1 282 980 €	0,031%
TATTS GROUP	313 858	991 684 €	0,021%
TAYLOR WIMPEY	154 360	348 497 €	0,005%
TD AMERITRADE HLDG	162 498	5 904 046 €	0,031%
TDC	498 529	2 410 756 €	0,061%
TDK	113 300	6 702 173 €	0,087%
TE CONNECTIVITY LTD	53 821	3 751 443 €	0,015%
TECAN GROUP NOM,	15 000	2 243 239 €	0,129%
TECHNICOLOR	1 042 826	4 495 623 €	0,252%
TECHNIPFMC P,L,C,	806 489	24 668 864 €	0,173%
TECHNOGYM SPA	578 193	3 628 161 €	0,289%
TECHTRONIC INDUST,	744 070	2 815 327 €	0,041%
TECK COMINCO CL,B	33 757	688 204 €	0,006%
TED BAKER	76 938	2 482 741 €	0,174%
TEGNA	3 100	74 257 €	0,001%
TEIJIN	70 000	1 232 841 €	0,036%
TEL,ERICSSON S,B	569 418	3 565 850 €	0,019%
TELE COLUMBUS	521 974	4 175 792 €	0,409%
TELE2 AB-B	29 953	268 344 €	0,006%
TELECOM ITAL,EPAR,	14 757 363	10 094 036 €	0,097%
TELECOM ITAL,ORD,	13 180 710	11 111 339 €	0,087%
TELECOM NEW ZEALD	575 002	1 315 364 €	0,031%
TELEFONICA	2 892 554	30 328 429 €	0,057%
TELEFONICA DEUTSCH	2 527 205	11 751 503 €	0,085%
TELEKOM AUSTRIA	581 271	3 713 159 €	0,087%
TELENET GROUP HOLD	214 530	11 960 048 €	0,183%
TELENOR	133 586	2 078 045 €	0,009%
TELEPERFORMANCE	391 646	39 654 158 €	0,678%
TELEPIZZA GROUP	896 688	4 270 925 €	0,890%
TELIASONERA	39 693	156 249 €	0,001%
TELSTRA	1 703 731	5 662 699 €	0,014%
TELUS CORP	11 252	340 542 €	0,000%
TEMENOS GROUP NOM,	52 642	3 914 159 €	0,076%
TENARIS	863 922	13 883 227 €	0,073%
TERNA	4 471 068	20 790 466 €	0,222%
TESARO	5 290	761 042 €	0,010%
TESCO	556 143	1 206 830 €	0,007%
TESLA MOTORS	40 602	10 564 758 €	0,025%
TESORO	21 181	1 605 284 €	0,018%
TESSI	19 831	2 712 881 €	0,709%
TEXAS INSTRUMENTS	123 733	9 319 742 €	0,012%
TEXWINCA HOLD,DIV,	1 212 408	762 860 €	0,088%
TF1	526 546	5 897 315 €	0,251%
TGS-NOPEC GEOPHYS,	125 000	2 476 527 €	0,122%
THALES	274 848	24 917 720 €	0,129%
THE LINK REIT	425 369	2 786 494 €	0,019%
THE MOSAIC	8 924	243 469 €	0,003%
THERMO FISHER	17 982	2 582 427 €	0,005%
THK	51 200	1 204 175 €	0,038%
THOMSON REUTERS	10 169	409 997 €	0,001%
THULE GROUP AB	231 610	3 645 415 €	0,227%
THYSSENKRUPP	458 898	10 536 298 €	0,081%
TIFFANY	2 656	236 657 €	0,002%
TIME WARNER	62 258	5 687 653 €	0,008%
TINGYI HOLDING	1 583 833	1 859 746 €	0,028%
TITAN PETROCHEMICALS	780 000	10 229 €	0,002%
TJX COS	146 890	10 860 700 €	0,023%
T-MOBILE US	84 900	5 127 101 €	0,010%
TOKAI CORP	33 800	1 154 271 €	0,188%
TOKAI TOKYO SECU,	428 300	2 080 766 €	0,153%
TOKIO MARINE HOLD,	236 300	9 310 831 €	0,031%

TOKYO ELECTRON	2 800	285 568 €	0,002%
TOKYO GAS	36 000	153 026 €	0,002%
TOKYO STEEL MFG	436 000	3 420 540 €	0,281%
TOLL BROTHERS	5 019	169 451 €	0,003%
TOMOKU	309 000	868 560 €	0,320%
TOMRA SYSTEMS	85 700	876 941 €	0,058%
TOPCON	112 700	1 883 692 €	0,104%
TOPRE	191 500	4 654 938 €	0,354%
TORAY INDUSTRIES	27 000	223 603 €	0,002%
TORCHMARK	3 352	241 446 €	0,003%
TORONTO DOMIN BANK	58 380	2 726 228 €	0,003%
TOSOH	290 000	2 379 762 €	0,045%
TOTAL FINA	1 891 494	89 685 188 €	0,076%
TOTAL SYSTEM SERV,	3 978	198 835 €	0,002%
TOWNGAS CHINA	3 888 000	2 053 455 €	0,143%
TOYO BUSSAN	16 900	166 476 €	0,084%
TOYOTA INDUSTRIES	107 400	4 983 403 €	0,033%
TOYOTA MOTOR	135 500	6 869 366 €	0,004%
TOYOTA TSUSHO	45 900	1 297 894 €	0,013%
TPR CO LTD	106 900	3 278 398 €	0,297%
TRACTOR SUPPLY	18 270	1 178 142 €	0,014%
TRANSCANADA	15 511	667 351 €	0,002%
TRANSURBAN UNIT	650 041	5 410 633 €	0,032%
TRAVELERS COS,	1 439	162 178 €	0,001%
TRAVIS PERKINS	11 826	209 337 €	0,005%
TREASURY WINE EST	232 071	2 024 342 €	0,031%
TREEHOUSE FOODS	160 400	12 696 427 €	0,282%
TREND MICRO	47 300	1 964 549 €	0,034%
TRIGANO	38 603	3 481 605 €	0,200%
TRITAX BIG BOX REI	1 496 876	2 530 671 €	0,135%
TRYGVESTA A/S NV	118 220	2 011 058 €	0,042%
TSUBAKI NAKASHIMA	38 800	599 352 €	0,097%
TSUKADA GLOBAL HOL	147 400	745 781 €	0,301%
TULLOW OIL	436 993	1 195 561 €	0,032%
TV BROADCASTS	389 859	1 472 759 €	0,089%
TWENTY FST CENTUR B	7 954	236 341 €	0,001%
TYCO INTL	269 512	10 613 665 €	0,029%
TYMAN	891 979	3 352 873 €	0,501%
TYSON FOODS CL,A	117 735	6 792 975 €	0,041%
U S BANCORP	325 672	15 681 462 €	0,019%
UBE INDUSTRIES	350 000	737 120 €	0,033%
UBI BANCA	1 912 921	6 882 690 €	0,196%
UBI SOFT ENTERTAIN	137 179	5 493 333 €	0,121%
U-BLOX HOLDING	30 000	6 179 067 €	0,434%
UBM REALITAETEN AG	25 850	837 540 €	0,346%
UBS NOM,	318 867	4 774 591 €	0,008%
UCB	288 839	21 001 484 €	0,148%
ULTA SALON COS&FRA	37 563	10 017 385 €	0,060%
ULTIMATE SOFTWARE	19 327	3 527 487 €	0,063%
ULVAC	15 000	653 214 €	0,030%
UMICORE	365 745	19 530 783 €	0,327%
UNDER ARMOUR INC	4 229	72 358 €	0,002%
UNI CHARM	61 600	1 378 738 €	0,010%
UNIBAIL	158 177	34 656 581 €	0,159%
UNICREDIT SPA	1 531 219	22 126 115 €	0,069%
UNILEVER	83 993	3 868 706 €	0,007%
UNILEVER	476 215	22 177 333 €	0,028%
UNION PACIFIC ORD,	96 149	9 521 857 €	0,012%
UNIPOL	259 374	1 005 334 €	0,036%
UNIPRES	80 000	1 556 637 €	0,167%
UNI-PRESIDENT CHINA	2 188 000	1 439 889 €	0,051%
UNITED COMPANY RUS	1 750 000	848 472 €	0,012%
UNITED CONTINENTAL	15 621	1 031 712 €	0,005%
UNITED DRUG	350 574	2 877 387 €	0,141%
UNITED OVS BK LCL	117 196	1 733 826 €	0,007%
UNITED PARCEL CL,B	78 155	7 840 710 €	0,011%
UNITED RENTALS	22 464	2 626 453 €	0,027%

UNITED TECHNO,	160 686	16 858 096 €	0,020%
UNITED THERAPEUTIC	383	48 479 €	0,001%
UNITED UTILITIES	123 722	1 437 131 €	0,018%
UNITEDHEALTH GROUP	134 391	20 608 170 €	0,014%
UNIV,HEAL,SCE CL,B	2 339	272 160 €	0,003%
UOL GROUP	25 467	118 772 €	0,003%
UPM KYMMENE	893 216	19 668 616 €	0,167%
UTD INTERNET NOM,	62 000	2 571 760 €	0,030%
VALEANT PHARM INTL	632	6 509 €	0,000%
VALEO	513 993	32 088 583 €	0,215%
VALLOUREC	421 868	2 625 706 €	0,093%
VALSPAR	2 876	298 316 €	0,004%
VANTIV A CLASS A	88 338	5 295 903 €	0,055%
VARIAN MEDICAL SYS	16 941	1 443 442 €	0,018%
VEEVA SYSTEMS A	16 130	773 359 €	0,015%
VENTAS	6 371	387 424 €	0,002%
VENTURE CORP,	288 879	2 217 091 €	0,103%
VEOLIA ENVIRON,	943 218	16 562 908 €	0,167%
VEREIT	40 777	323 684 €	0,004%
VERISIGN	18 317	1 491 837 €	0,018%
VERIZON CIONS	713 214	32 508 235 €	0,017%
VERMILION ENERGY	19 906	695 956 €	0,017%
VERTEX PHARM,	128 330	13 120 364 €	0,052%
VESTAS WIND SYST,	28 743	2 191 585 €	0,013%
VETO PROMESSES	43 000	2 269 540 €	0,362%
VIACOM CL,B	7 180	312 965 €	0,002%
VICAT	56 845	3 783 603 €	0,127%
VICINITY CENTERS	1 555 101	3 138 929 €	0,039%
VICTREX PLC	304 589	6 766 270 €	0,355%
VIENNA INSUR,GROUP	184 645	4 187 749 €	0,144%
VILMORIN CLAUSE	13 811	891 776 €	0,066%
VINCI	640 217	47 568 123 €	0,108%
VIRBAC	50 600	7 425 550 €	0,598%
VIRGIN HOLDINGS NV	441 960	- €	0,000%
VISA INC LTD	444 335	36 920 248 €	0,024%
VISCOFAN	118 913	5 763 119 €	0,255%
VITROLIFE	45 000	2 021 625 €	0,207%
VIVENDI UNIVERSAL	1 816 331	33 102 632 €	0,141%
VMWARE A	2 322	200 037 €	0,000%
VODAFONE GROUP	1 322 237	3 217 088 €	0,005%
VOESTALPINE	110 433	4 074 978 €	0,063%
VOLKSWAGEN ORD,	9 361	1 307 264 €	0,003%
VOLKSWAGEN PF	188 179	25 705 251 €	0,064%
VOLVO S,B	194 651	2 696 791 €	0,012%
VONOVIA	511 255	16 886 753 €	0,109%
VORNADO REALTY	14 722	1 380 734 €	0,008%
VTECH HOLDINGS	282 953	3 162 456 €	0,113%
VULCAN MATERIALS	22 675	2 554 237 €	0,017%
VZ HOLDING	26 994	6 934 146 €	0,337%
WABCO HOLDINGS	11 776	1 292 822 €	0,022%
WACKER CHEMIE	40 853	3 944 357 €	0,078%
WAL MART STORES	218 653	14 735 644 €	0,007%
WALGREEN	3 598	279 383 €	0,000%
WALLIX GROUP	17 252	167 344 €	0,430%
WANT WANT CHINA	2 803 465	1 814 562 €	0,022%
WARTSILA	222 247	11 145 687 €	0,113%
WASH TEC	55 533	3 120 955 €	0,397%
WASTE CONNECTIONS	96 280	7 941 491 €	0,055%
WASTE MANAGEMENT	15 900	1 084 033 €	0,004%
WATERS	8 563	1 251 445 €	0,011%
WEC ENERGY GROUP	246 400	13 967 773 €	0,078%
WELLPOINT	39 844	6 160 909 €	0,015%
WELLS FARGO	470 488	24 484 467 €	0,009%
WELLTOWER INC	2 272	150 440 €	0,001%
WENDEL INVEST,	146 529	17 407 645 €	0,311%
WERELDHAVE	22 000	909 370 €	0,055%
WESFARMERS	135 345	4 350 771 €	0,012%

WEST JAPAN RAILWAY	53 000	3 220 112 €	0,027%
WESTERN DIGITAL	5 158	398 008 €	0,002%
WESTERN UNION	8 141	154 896 €	0,002%
WESTPAC BANKING	342 890	8 574 390 €	0,010%
WESTROCK CO	43 019	2 092 729 €	0,017%
WEYERHAEUSER	13 581	431 473 €	0,002%
WH GROUP	2 216 916	1 786 975 €	0,015%
WHARF HOLDINGS	163 613	1 312 920 €	0,005%
WHEELLOCK	115 881	856 700 €	0,006%
WHIRLPOOL	28 300	4 533 345 €	0,038%
WHITBREAD	21 000	971 799 €	0,011%
WHITEWAVE FOODS CO	3 082	161 801 €	0,000%
WHOLE FOODS MARKET	9 812	272 650 €	0,003%
WIENERBERGER	288 968	5 744 684 €	0,246%
WILLIAM DEMANT HLD	4 574	89 619 €	0,002%
WILLIAM HILL	68 541	233 038 €	0,008%
WILLIAMS COMPANIES	14 805	409 593 €	0,002%
WILLIS TOWERS WATSON	1 245	152 361 €	0,001%
WIRECARD	159 409	8 273 327 €	0,129%
WM,MORRIS,SUPERM,	543 568	1 525 270 €	0,023%
WOLSELEY	55 826	3 276 587 €	0,022%
WOLTERS KLUWER	219 327	8 546 077 €	0,073%
WOODSIDE PETROLEUM	13 750	314 611 €	0,002%
WOOLWORTHS	244 321	4 617 886 €	0,019%
WORKDAY CL A	6 900	537 265 €	0,005%
WORLDLINE	430 155	12 560 526 €	0,408%
WORLDPAY GROUP	1 301 428	4 494 819 €	0,065%
WORLEYPARSONS	423 553	3 326 071 €	0,171%
WPP PLC	88 675	1 816 422 €	0,007%
WS ATKINS	163 473	2 943 393 €	0,163%
WST PHMCEUTCLS SVC	22 630	1 726 740 €	0,031%
WYNDHAM WORLDWIDE	1 990	156 830 €	0,002%
WYNN MACAU LTD	488 719	930 165 €	0,009%
XEBIO	46 000	666 186 €	0,096%
XERO LIVE LIMITED	27 485	355 509 €	0,020%
XEROX ORD,	187 491	1 286 694 €	0,018%
XILINX	4 600	248 978 €	0,002%
XINYI GLASS HLDGS	396 666	326 419 €	0,010%
XINYI SOLAR HLDG	1 038 852	309 956 €	0,015%
XL GROUP	271 600	10 121 991 €	0,102%
XYLEM	3 243	152 273 €	0,002%
YAHOO	3 502	151 959 €	0,000%
YAKULT HONSHA	24 900	1 291 173 €	0,014%
YAMABIKO CORP	125 000	1 367 679 €	0,283%
YAMADA DENKI	175 000	814 944 €	0,018%
YAMATO KOGYO	158 300	3 814 714 €	0,234%
YOOX	245 467	5 478 823 €	0,270%
YPSOMED HOLDING	12 500	2 224 324 €	0,099%
YUE YUEN IND,	894 439	3 287 429 €	0,054%
YUM BRANDS	57 000	3 405 451 €	0,016%
ZALANDO	131 059	4 970 413 €	0,053%
ZARDOYA OTIS	285 922	2 476 085 €	0,036%
ZENRIN	62 100	1 233 350 €	0,163%
ZEON	150 000	1 599 681 €	0,063%
ZIMMER HOLDINGS	1 366	155 956 €	0,001%
ZODIAC	677 997	15 899 030 €	0,232%
ZOETIS INC	102 504	5 114 897 €	0,021%
ZUMTOBEL	158 736	2 868 360 €	0,365%
ZURICH FINANC,SCES	12 275	3 066 027 €	0,008%

OBLIGATIONS

Encours sous gestion dans la poche

14 980 841 716 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2017
21ST CEN 3700 150924	1 600 000	1 527 230 €
21ST CENT FOX 6,9%19	2 750 000	2 812 034 €
2I RETE GAS 1,75 26	1 300 000	1 312 101 €
3M CO 2,25 09/26	1 500 000	1 313 375 €
A2A SPA 1,75% 2025	3 900 000	4 002 109 €
A2A SPA 3,625% 2022	1 500 000	1 717 760 €
ABB FINAN 0,625% 23	3 250 000	3 297 594 €
ABBAY NAT 0,875% 20	10 150 000	10 365 788 €
ABBAY NATL 2% 19	8 100 000	8 410 559 €
ABBAY NATL 2,625%20	9 370 000	10 250 740 €
ABBAY NATL EUR3M 19	2 000 000	2 017 074 €
ABBOTT 2,35% 16-19	2 295 000	2 170 400 €
ABBOTT 2,9% 16-21	2 400 000	2 272 441 €
ABBOTT 3,4% 16-23	7 650 000	7 290 450 €
ABBOTT 3750 1126	1 200 000	1 138 857 €
ABBOTT LAB 4,90 46	1 740 000	1 709 713 €
ABBVIE 3,6% 2025	1 196 000	1 131 579 €
ABBVIE INC 0,375% 19	11 126 000	11 194 658 €
ABBVIE INC 2,30 0521	3 000 000	2 793 834 €
ABBVIE INC 2,9% 2022	7 085 000	6 663 052 €
ABBVIE INC 3,2% 26	1 425 000	1 294 209 €
ABERTI 1000 270227	13 400 000	12 677 664 €
ABERTIS 1,375% 2026	7 900 000	7 923 319 €
ABERTIS 2,50%14-2025	4 900 000	5 385 654 €
ABERTIS IN 3,75 23	3 900 000	4 697 453 €
ABN AMR BK 4,75% 19	7 430 000	8 137 696 €
ABN AMR BK 7,125%22	1 000 000	1 333 740 €
ABN AMRO 2,875%25	5 500 000	5 903 987 €
ABN AMRO BK 0,625%22	5 005 000	5 098 932 €
ABN AMRO BK 2,5% 23	4 700 000	5 318 588 €
ABNAMRO NV 4,125% 22	2 300 000	2 728 110 €
ACCOR 1,25% 0124	1 800 000	1 779 492 €
ACE HLD 3,35% 24	2 500 000	2 415 403 €
ACE INA 2,875% 22	4 805 000	4 568 148 €
ACE INA HOL 3,35% 26	1 155 000	1 104 919 €
ACEA 3% 16-2026	5 200 000	4 940 666 €
ACEA SPA 2,625% 24	3 200 000	3 555 936 €
ACHMEA 4,25% 15-2049	1 000 000	962 130 €
ACHMEA BK 0,875% 18	8 500 000	8 651 861 €
ACHMEA BK 1,125% 22	2 250 000	2 334 175 €
ACHMEA BV 2,5% 20	2 970 000	3 222 897 €
ACMP 4,875% 23	2 000 000	1 964 113 €
ACTAVIS FU 3% 0320	12 185 000	11 589 241 €
ACTAVIS FU 3,45%2022	6 000 000	5 726 726 €
ACTAVIS FUND 3,8% 25	4 500 000	4 246 510 €
ACTAVIS FUND 3,85%24	3 925 000	3 775 802 €
ACUITY BANDS 6% 19	600	623 507 €
ADECCO INT 1,50% 22	6 517 000	6 848 027 €
ADIANT GLO 3,5 0824	3 400 000	3 433 561 €
ADP 1,50% 2023	6 600 000	7 008 409 €
ADP 1,5% 07 04 2025	3 300 000	3 483 083 €
ADP INC 2,25% 20	3 300 000	3 120 306 €
AEGON NV 1% 23	14 550 000	14 676 206 €
AEGON NV 4% 2044	2 000 000	2 148 647 €
AERCAP CAP 3,75% 19	1 975 000	1 921 326 €
AERCAP IRE 3,50 0522	1 425 000	1 349 694 €
AERCAP IRE 4,5 0521	4 100 000	4 079 031 €
AERCAP IRE 5% 10/21	3 250 000	3 246 067 €
AEROPORTI 3,25% 21	7 057 000	7 760 556 €
AETNA INC 2,75%22	900 000	847 479 €
AGRIUM 3,15% 22	2 350 000	2 192 242 €
AGRIUM 3375 150325	1 700 000	1 565 175 €

AIG 2,3% 07 2019	3 200 000	3 013 745 €
AIG 6,40 15/12/20	1 722	1 850 118 €
AIR LEASE 2,125% 20	4 510 000	4 196 707 €
AIR LEASE 3% 0323	8 572 000	7 819 083 €
AIR LEASE 3,375% 21	1 375 000	1 321 037 €
AIR LEASE 3,75% 2022	1 300 000	1 259 509 €
AIR LIQ 0750 130624	3 800 000	3 828 034 €
AIR LIQ 1,75% 270921	960 000	867 504 €
AIR LIQFIN 1,25 25	56	5 798 074 €
AIR LIQUI 1,375 0919	1 550 000	1 427 318 €
AIR LIQUIDE 1,875%24	7 600 000	8 301 098 €
AIR LIQUIDE 2,25% 23	3 045 000	2 723 518 €
AIR LIQUIDE FIN	1 000 000	990 497 €
AIRBUS GR 0875 0526	3 900 000	3 889 003 €
AKELIUS RSDT 1,5% 22	7 000 000	7 131 935 €
AKZO NOB 1,125 %26	2 000 000	1 999 289 €
ALABAMA POW 2,80% 25	2 000 000	1 809 922 €
ALD INTERNAL 0,75%18	2 800 000	2 819 788 €
ALD INTERNATIONAL 2%17	2 200 000	2 243 672 €
ALEXAN 4600 010422	4 000 000	3 968 215 €
ALEXANDRIA 3,9%2023	2 000 000	1 928 225 €
ALFA LAVAL 1,375% 22	4 000 000	4 162 897 €
ALFA SAB 5,25% 24	750 000	735 259 €
ALIMENT 0,875 042023	4 500 000	4 465 575 €
ALLIANDER 3,25% 2049	1 600 000	1 682 302 €
ALLIANZ 2,241% 07/45	1 300 000	1 312 889 €
ALLIANZ 3,375% 24	5 100 000	5 415 366 €
ALLIANZ 5,75% 2041	165	20 051 316 €
ALLIANZ SE 4,75%2049	1 000 000	1 148 212 €
ALLIANZ SE 5,625%42	3 900 000	4 769 447 €
ALLIED WOR 4,35 1025	5 800 000	5 499 954 €
ALLSTATE 5,75% 2053	2 395 000	2 414 764 €
ALLY FCIAL 3,50 19	5 345 000	5 066 349 €
ALLY FCIAL 4,125% 20	5 500 000	5 229 476 €
ALLY FIN 3250 130218	1 300 000	1 224 707 €
ALPHABET 3,375% 24	1 875 000	1 830 735 €
ALSTOM S 3% 19	3 000 000	3 252 275 €
ALSTRIA 2,125% 23	5 100 000	5 459 200 €
ALTERA 2,50 11/18	2 170 000	2 079 090 €
ALTRIA GP 2,625% 26	455 000	401 868 €
ALTRIA GRP 2,85 22	2 000 000	1 879 320 €
ALTRIA GRP 9,25% 19	1 428	1 567 415 €
AM AIRLN 3,20% 28	1 350 000	1 243 567 €
AM TOWER 3375 151026	1 855 000	1 681 784 €
AMADEUS 0,125% 20	3 800 000	3 783 123 €
AMADEUS CAP 1,625%21	2 800 000	2 957 928 €
AMADEUS FI 0,625% 17	1 900 000	1 911 678 €
AMAZON COM 3,80 24	1 500 000	1 500 654 €
AMAZON,COM 2,5% 22	5 600 000	5 245 638 €
AME TOW 4,40 150226	415 000	402 336 €
AMER INTL 3,30% 2021	665 000	634 675 €
AMER INTL 4,875%2022	1 800 000	1 845 779 €
AMER INTL GP3,9 0426	2 075 000	1 943 858 €
AMER TOWER 3,4% 2019	1 025 000	982 557 €
AMER TOWER 4,50 18	2 431	2 342 515 €
AMER TOWER 5% 24	375 000	380 187 €
AMERIC MOV 1,5 0324	1 465 000	1 484 262 €
AMERIC TOW 3,30% 21	7 000 000	6 661 132 €
AMERIC TOWER 3,5% 23	374 000	352 645 €
AMERICA MO 5,125% 73	1 310 000	1 410 852 €
AMERICA MOV 4,125%19	6 983	7 777 411 €
AMERICAN 0625 221121	6 000 000	6 061 891 €
AMERICAN 7%18 SR	2 100	2 067 193 €
AMERICAN EXPRESS	3 000 000	2 830 513 €
AMERICAN LIB 030320	3 375 000	3 161 768 €
AMERICAN TOW 4,7%22	2 000 000	2 000 264 €
AMGEN 2,25% 2019	5 450 000	5 164 431 €

AMGEN 2,60%17- 2026	2 315 000	2 006 764 €
AMGEN INC 3,875% 21	5 000 000	4 989 105 €
AMT 5,9% 2021	2 139	2 285 391 €
ANADARKO PE 4,85 321	5 000 000	5 011 755 €
ANADARKO PE 5,55 326	5 200 000	5 398 040 €
ANALOG DEVICES	7 375 000	6 936 174 €
ANGLO AME 1,50 04/20	4 425 000	4 487 230 €
ANGLO AME 3,25% 23	4 000 000	4 259 956 €
ANGLO AMERI 2,875%20	1 000 000	1 067 824 €
ANHEUS 2,5% 07/22	2 075 000	1 926 246 €
ANHEUS 5,375 20	245	251 573 €
ANHEUSER 1,90% 19	6 500 000	6 100 281 €
ANHEUSER 2,65% 21	15 665 000	14 803 811 €
ANHEUSER 2625 170123	385 000	356 465 €
ANHEUSER 3,30% 23	4 000 000	3 822 866 €
ANHEUSER 7,75%2019	185	193 234 €
ANHEUSER-B 0,875% 22	13 000 000	13 319 383 €
ANHEUSER-B 1,5% 25	6 350 000	6 587 162 €
ANHEUSER-B 2% 28	2 560 000	2 678 667 €
ANHEUSER-B 2,75% 36	13 984 000	14 934 812 €
ANHEUSER-BUS 3,65%26	21 425 000	20 326 835 €
ANZ NZ 0400 010322	7 331 000	7 285 664 €
ANZ NZ 2,85% 15-2020	2 300 000	2 181 169 €
AON 2,875% 14-2026	5 191 000	5 843 462 €
AON 4%13-2023	2 250 000	2 224 760 €
AON PLC 3,50% 24	1 000 000	944 885 €
APACHE 2625 150123	3 000 000	2 716 180 €
APPLE 1% 13-2023	11 263 000	10 535 675 €
APPLE 2850 0223	6 870 000	6 495 106 €
APPLE 3250 0226	10 730 000	10 159 482 €
APPLE INC 0 22	2 900 000	2 735 417 €
APPLE INC 1,375% 24	2 990 000	3 155 627 €
APPLE INC 1,55 19	2 090 000	1 959 781 €
APPLE INC 1,625% 26	4 300 000	4 591 303 €
APPLE INC 1550 0821	1 790 000	1 626 031 €
APPLE INC 2,25 21	4 600 000	4 320 508 €
APPLE INC 2,85 21	790 000	764 071 €
APPLE INC 2450 0826	560 000	496 286 €
APPLE INC 3 24	3 500 000	3 312 055 €
APPLE INC 3,35 27	6 000 000	5 693 373 €
APPLIED M 3,3 010427	3 430 000	3 211 858 €
APRR 1,50%15-2024	1 700 000	1 773 815 €
AQUAR IN Eurib3 17	65	6 502 765 €
AQUARIUS 4,25%2043	11 452 000	13 165 412 €
ARCELOR 2,875% 2020	1 000 000	1 070 515 €
ARCEMIT 1085 0119	2 000 000	2 282 910 €
ARCH CAPFI 4,01 26	4 250 000	4 110 350 €
ARDAGH 2750 150324	1 200 000	1 184 815 €
ARES CAP 3,875% 20	2 575 000	2 474 824 €
ARKEMA 1,50%2025	7 200 000	7 366 648 €
AROUNDTOWN 1,50% 24	7 600 000	7 383 125 €
AROUNDTOWN PRO1,5%22	2 000 000	2 028 985 €
ARRFP 1,125% 14-2021	3 200 000	3 291 908 €
ARROW ELEC 3,50% 22	3 750 000	3 506 564 €
ASB FIN 0500 170620	4 500 000	4 546 633 €
ASB FINA 0500 100622	18 450 000	18 311 025 €
ASHLAND 3,875 18	3 000 000	2 888 585 €
ASML HOLD 0,625%22	1 362 000	1 367 676 €
ASML HOLD 1,375%26	1 158 000	1 166 643 €
ASML HOLDG 1,625% 27	1 400 000	1 411 687 €
ASML HOLDI 3,375% 23	2 000 000	2 354 606 €
ASPA 3,875%16-2026	1 800 000	1 956 486 €
ASR NLD 5 PERP	6 200 000	6 861 723 €
ASSI GEN 5,125% 0924	5 000	6 490 450 €
ASSIC GENER 2,875%20	4 594 000	4 953 524 €
ASSICU GEN 7,75%42	3 700 000	4 549 032 €
ASSICURA 4,125% 26	1 300 000	1 425 543 €

ASSICURAZ 10,125% 42	4 500 000	6 246 416 €
ASSICURAZI EI03M 47	1 530 000	1 657 848 €
ASSOC BANC 2,75%2019	4 200 000	3 997 194 €
ASTRAZ 0,875% 241121	3 200 000	3 283 344 €
ASTRAZE 075 0524	12 200 000	12 243 394 €
ASTRAZENEC 2,37 20	3 300 000	3 115 462 €
AT & T 3,80% 16-2022	10 000 000	9 674 827 €
AT & T 5,20% 16-2020	6 803 000	6 888 670 €
AT AND T 2,45% 2020	385 000	361 989 €
AT AND T 3% 06 2022	8 300 000	7 776 699 €
AT& T INC 3,40% 25	2 000 000	1 831 877 €
AT&T 1,30% 2023	3 176 000	3 249 089 €
AT&T 1,45% 14-2022	4 000 000	4 181 122 €
AT&T 2,45% 2035	5 154 000	4 956 772 €
AT&T 3,875% 2021	1 000	976 618 €
AT&T INC 2,625% 2022	2 500 000	2 299 032 €
AT&T INC 3,20 0322	1 480 000	1 400 708 €
AT&T INC 3,375% 34	3 136 000	3 415 696 €
AT&T INC 3,55% 32	5 078 000	5 748 599 €
AT&T INC 3,6% 23	9 624 000	9 163 563 €
AT&T INC 4,25 0327	7 215 000	6 890 061 €
AT&T INC 4125 022026	2 150 000	2 044 907 €
ATF NETH 2125 130323	5 700 000	5 785 783 €
ATHENE 4000 0122	5 160 000	4 932 034 €
ATLANTI 1625 030225	8 050 000	8 106 164 €
ATLANTIA 2,875%2021	4 600 000	5 042 491 €
ATLANTIA 3,625%2018	3 500 000	3 748 620 €
ATLAS COPCO 2,625%19	2 750 000	2 893 374 €
ATR DU SUD 2,875%23	4 800 000	5 435 502 €
ATRIUM 3,625% 2022	1 580 000	1 754 851 €
ATT 5,80% 0219	3 000	3 013 872 €
ATT INC 2,75% 16-23	8 100 000	9 062 925 €
AUCHAN 0625 070222	12 000 000	11 991 893 €
AUST & NZ BK 0,75%26	4 200 000	4 114 188 €
AUST&ANZ BK 1,875%17	2 428 000	2 295 387 €
AUSTRAL PAC 3,125%23	4 440 000	5 175 540 €
AUTO SUD 2,95% 24	4 900 000	5 615 262 €
AUTODESK 1,95%2017	1 300 000	1 223 679 €
AUTODESK 3600 1222	7 975 000	7 649 453 €
AUTONATIO 4,5 1025	3 692 000	3 563 658 €
AUTOROUTE 1250 0127	1 700 000	1 704 938 €
AUTOROUTES PARIS	1 100 000	1 098 869 €
AUTOSTRAD 1,125% 21	2 500 000	2 576 189 €
AVALONBAY 2,95% 26	2 325 000	2 106 102 €
AVALONBAY 4,20% 2018	3 200 000	3 200 758 €
AVERY DENNSN 1,25 25	7 021 000	6 947 909 €
AVIATION 2875 0122	7 000 000	6 523 666 €
AVIATION CP 2,875%18	2 000 000	1 892 305 €
AVINOR AS 1,25 27	4 454 000	4 529 804 €
AVIVA 0,10% 2018	2 500 000	2 502 842 €
AVIVA PLC 3,375% 45	1 300 000	1 323 345 €
AVIVA PLC 0,625% 23	11 850 000	11 662 424 €
AVIVA PLC 3,875% 44	2 580 000	2 770 521 €
AVNET 4,875% 22	6 300 000	6 282 633 €
AVNET INC 4,625 0426	1 100 000	1 060 250 €
AXA 3,941%29/11/2049	8 927	9 466 614 €
AXA 5,125%13-2043	4 000 000	4 807 302 €
AXA SA 3,375% 47	5 000 000	5 302 263 €
AXA SA 5,25%04-40	100	5 823 887 €
AXA VRN 10/99	2 000 000	2 107 405 €
AXP 2,65% 02/12/22	1 500 000	1 399 758 €
B IRELAND 1,25% 2020	4 000 000	4 158 555 €
B IRELAND TF/TV 24	7 600 000	8 204 673 €
B MONTREAL 1,50 19	7 000 000	6 492 177 €
BAA 4,6%20 EMTN	4 700	4 912 437 €
BABCOCK INTL 1,75%22	2 167 000	2 262 066 €
BALL 3,50%15-2020	750 000	829 126 €

BALL CORP 4% 23	2 000 000	1 898 080 €
BALTIMORE 2,4 08/26	2 125 000	1 856 886 €
BAN OF AM 2,151 1120	10 250 000	9 566 828 €
BANCO SANTANDER	15 500 000	15 660 371 €
BANK AMER 4,45% 26	2 425 000	2 334 660 €
BANK AMER,5,75%17	549	2 683 726 €
BANK IRELAND 3,25%19	2 134 000	2 268 494 €
BANK OF AM 2,625% 21	3 230 000	3 052 137 €
BANK OF AM EI3M 0222	19 965 000	20 013 898 €
BANK OF AMER 2,6% 19	10 200 000	9 686 045 €
BANK OF AMER 2,65%19	3 200 000	3 027 619 €
BANK OF AMER 3,3%30	15 738 000	14 893 676 €
BANK OF AMER 4,10%23	1 800 000	1 771 316 €
BANK OF AMER 5% 21	1 200	6 196 637 €
BANK OF AMER CRP	6 455 000	6 493 826 €
BANK OF NY M 3 1028	1 800 000	1 612 446 €
BANK OF NY MELLO	5 000 000	4 730 754 €
BANKIA 3375 150327	2 500 000	2 525 698 €
BANKIA SA TF/TV 24	5 000 000	5 334 899 €
BANKINTER 250 060427	9 900 000	9 912 375 €
BARCLAYS 1,50% 2022	3 700 000	3 770 322 €
BARCLAYS 1,875 0321	2 978 000	3 091 604 €
BARCLAYS 1,875 1223	22 945 000	23 584 713 €
BARCLAYS 2,625% 2025	4 000 000	4 073 470 €
BARCLAYS 2,75% 2019	1 420 000	1 351 226 €
BARCLAYS 3,20% 2021	1 900 000	1 786 607 €
BARCLAYS 3,25 0121	1 025 000	972 428 €
BARCLAYS 5,2 0526	1 370 000	1 336 755 €
BARCLAYS 6%18 EMTN	3 900	4 127 141 €
BARCLAYS BK 5,14%20	9 150	9 316 609 €
BARCLAYS BK 6,625%22	2 500	3 101 856 €
BARRICK GOLD 4,10%23	1 650 000	1 674 111 €
BARRICK NO 4,40% 21	235 000	238 361 €
BARRY 2375 24/05/24	400 000	417 143 €
BARRY CALL 5,375% 21	1 000 000	1 246 984 €
BASF FIN 0 11/20	5 882 000	5 860 257 €
BAT HLD 2,375% 23	5 000 000	5 450 031 €
BAT HLDNV 3,125% 29	1 034 000	1 171 426 €
BAT IF 0,375 19	4 200 000	4 222 059 €
BAXALTA 4%230625	2 600 000	2 503 889 €
BAXTER INTL 2,60% 26	3 945 000	3 459 934 €
BAYER AG 2,375% 75	3 649 000	3 604 652 €
BAYER US FINANCE	8 000 000	7 593 153 €
BB&T CO 2050 150521	6 725 000	6 226 053 €
BB&T CORPOR 2,45% 20	10 400 000	9 858 918 €
BBT CORP 5,25 19	1 610 000	1 645 327 €
BBVA 0,625 170122	6 400 000	6 405 466 €
BBVA BANC 6,50% 21	4 000 000	4 096 317 €
BBVA SENIOR 2,375%19	7 500 000	7 850 557 €
BBVA SUB 3,5% 24	6 000 000	6 506 601 €
BECTION DICK 1,9 1226	1 960 000	2 035 583 €
BECTION DICK,2,675%19	240 000	228 994 €
BECTION DICKI 1 1222	4 438 000	4 500 999 €
BELFIUS BK 2,25% 18	6 800 000	7 098 959 €
BELFIUS BK 3,125% 26	10 800 000	11 339 572 €
BELGACOM 2,375% 2024	2 000 000	2 208 880 €
BEMIS CO 6,8% 0819	2 500	2 600 320 €
BERKSH HAT 1,125%27	4 150 000	4 070 134 €
BERKSHIRE 1,7% 19	3 400 000	3 184 230 €
BERKSHIRE 2,20%16-21	6 400 000	5 989 583 €
BERKSHIRE 2,75%16-21	5 020 000	4 696 087 €
BERKSHIREH 1,30% 24	6 259 000	6 436 783 €
BERTEL 1,125% 26	7 500 000	7 612 600 €
BERTELSMANN 2,625%22	4 000 000	4 529 637 €
BFCM 0,25 06/19	4 400 000	4 425 557 €
BFCM 1,25% 25	13 000 000	13 267 600 €
BFCM 1,625% 26	300 000	312 225 €

BFCM 1,875% 16-2016	7 400 000	7 110 731 €
BFCM 2,625% 03/24	3 200 000	3 576 237 €
BFCM 2,625% 21	18 300 000	19 960 622 €
BFCM 3% 13-2023	9 300 000	10 746 406 €
BFCM 3% 14-2024	9 800 000	10 717 264 €
BFCM 3,25% 08/22	400 000	465 987 €
BFCM 4% 22/10/20	2 000 000	2 281 635 €
BFCM 4,125% 2020	3 000 000	3 474 485 €
BFIFTH CIN 2,25 0621	3 900 000	3 619 510 €
BG ENERGY 3,625%19	2 000	2 215 766 €
BG ENERGY 1,25%11/22	3 730 000	3 897 904 €
BG ENERGY 3% 2018	2 200	2 331 999 €
BHARTI AIR 4% 18	3 859 000	4 146 992 €
BHP 6750 102075	4 325 000	4 691 708 €
BHP BILL 3,125% 33	800 000	963 999 €
BHP BILLI TF/TV 79	1 660 000	1 961 915 €
BHP FIN 0,75 22	4 000	4 055 153 €
BHP FINANCE 3,85%23	3 250 000	3 220 205 €
BIMBO 3,875% 24	1 700 000	1 609 192 €
BIOGEN INC 3,625% 22	3 900 000	3 761 925 €
BK AME,4%18 EMTN	46	2 302 896 €
BK AMERICA 0,75% 23	8 100 000	8 020 272 €
BK AMERICA 3,875%25	5 550 000	5 313 008 €
BK F C M 2,2625 0327	4 300 000	4 328 725 €
BK MONTR 0125 190421	2 720 000	2 733 526 €
BK NOVA 2800 210721	6 625 000	6 287 513 €
BK NY MELLON 2,60%20	4 460 000	4 226 467 €
BK OF A 2503 211022	1 875 000	1 726 677 €
BK OF A 3248 211027	2 465 000	2 226 224 €
BK OF AME 1,625 0922	11 580 000	12 184 142 €
BK OF AMER 2,375% 24	10 121 000	11 159 533 €
bK OF NY M 2,45 1120	5 000 000	4 733 818 €
BK OF NY ME 4,95% 20	3 650 000	3 563 344 €
BK POSTALE 2,75% 26	7 000 000	7 406 528 €
BKAMERICA 1,375% 25	2 500 000	2 532 896 €
BKAMERICA 2,50% 2020	8 584 000	9 345 372 €
BKAMERICA 3,50 26	9 300 000	8 720 626 €
BKAMERICA 4% 01/25	5 200 000	4 898 424 €
BKAMERICA TF/TV 25	580 000	585 084 €
BLACK 4,25% 11/23	6 000 000	5 940 911 €
BLACK HILLS 2,50%19	840 000	792 904 €
BLACK HILLS 3,15% 27	1 075 000	963 937 €
BMBG BOND 3%2021	2 800 000	2 903 245 €
BMW FI 0,875 030425	14 850 000	14 789 768 €
BMW FIN 0,125 0720	3 550 000	3 550 225 €
BMW FIN 0,125% 20	4 550 000	4 559 109 €
BMW FIN 0,75% 24	2 300 000	2 325 218 €
BMW FIN 0750 120724	3 000 000	3 003 713 €
BMW FINANCE 1,5%18	6 960 000	7 173 862 €
BMW US 2,70 04/22	4 000 000	3 741 798 €
BMW US CA 1,125% 21	4 500 000	4 688 568 €
BNP 0,5 010622	9 558 000	9 580 428 €
BNP 0,75% 16-2022	17 890 000	18 012 516 €
BNP 2,375% 20/05/24	8 355 000	9 364 187 €
BNP PAR 2875 1026	5 904 000	6 178 233 €
BNP PAR,5,019% 17	8 200 000	8 606 986 €
BNP PARIB 1,12 23	5 406 000	5 538 949 €
BNP PARIB 2,25% 21	9 700 000	10 466 218 €
BNP PARIB 2,625% 27	5 900 000	6 149 769 €
BNP PARIB 3,75% 20	8 800 000	10 050 286 €
BNP PARIBAS	3 300 000	3 739 029 €
BNP PARIBAS 1,375%18	3 000 000	3 081 078 €
BNP PARIBAS 1,50% 28	4 564 000	4 663 004 €
BNP PARIBAS 2% 2019	4 000 000	4 156 537 €
BNP PARIBAS 2,25%27	3 050 000	2 981 926 €
BNP PARIBAS 2,875%26	15 142 000	15 765 975 €
BNP PARIBAS 3,8% 24	4 325 000	4 061 841 €

BNP PARIBAS TV08-18	72	4 118 312 €
BNP PRBAS 1,125% 23	16 101 000	16 028 984 €
BNPP 5% 15/01/2021	3 000	3 057 869 €
BNPP CA 4,032% 99	3 800 000	3 860 940 €
BNZ INTL FUND/LN	2 726 000	2 557 384 €
BOA 1,875% 19	11 829 000	12 263 693 €
BOA 3,95% 2025	3 000 000	2 841 675 €
BOA 3824 0128	8 000 000	7 541 614 €
BOA 4,2% 24	2 705 000	2 597 058 €
BOA 5,625% 2020	1 660	8 617 609 €
BOA CORP 1,375% 21	10 325 000	10 758 583 €
BOARDWALK PIPELI	2 176 000	2 073 745 €
BOEING CO 2,8 27	1 500 000	1 373 345 €
BORG-WAR 1,80% 1122	5 000 000	5 275 441 €
BOSTON PP 3,85% 23	4 000 000	3 892 457 €
BOSTON PRO 3,65% 26	2 900 000	2 711 906 €
BOSTON PRO 3,8% 24	2 225 000	2 138 970 €
BP 3,561ù 2021	9 800	9 672 209 €
BP CAP 1953 0325	12 300 000	13 123 562 €
BP CAPIT 1,526% 22	14 200 000	15 018 753 €
BP CAPIT 3,119% 26	2 125 000	1 953 145 €
BP CAPIT MA 1676 519	7 000 000	6 552 966 €
BP CAPITAL 1,109%23	1 400 000	1 434 423 €
BP CAPITAL 1,573%27	4 000 000	4 094 039 €
BP CAPITAL 2,213% 26	1 576 000	1 725 305 €
BP CAPITAL 2,994% 19	2 500 000	2 651 070 €
BP CAPITAL PLC	2 425 000	2 183 896 €
BP CAPMKT 2,177% 21	6 119 000	6 683 225 €
BP CAPMKTS 1,117 24	8 364 000	8 510 762 €
BP CAPMKTS 3,06 22	1 200 000	1 136 531 €
BPCE 0,375% 05/10/23	5 700 000	5 545 825 €
BPCE 0,625% 20/04/20	8 200 000	8 348 127 €
BPCE 1% 05/10/2028	2 400 000	2 291 354 €
BPCE 1,125 180123	5 200 000	5 190 726 €
BPCE 1,125%15-2022	7 000 000	7 202 659 €
BPCE 2,125% 2021	1 700 000	1 819 399 €
BPCE 2,65% 16-2021	6 000 000	5 605 594 €
BPCE 2,75% 11/2027	2 000 000	2 078 759 €
BPCE 2,875% 24	500 000	569 150 €
BPCE 2,875% 26	5 300 000	5 561 596 €
BPCE 3% 14-2024	400 000	469 124 €
BPCE 4,25% 02/2023	1 700 000	2 052 881 €
BPCE 4,625% 23	6 400 000	7 657 929 €
BPCE 5,15% 14-2024	4 300 000	4 159 834 €
BPCE 5,7% 2023	2 375 000	2 413 523 €
BPCE SA 08/07/2026	5 200 000	5 466 521 €
BQ FD CDMUT 0,375 22	1 800 000	1 792 911 €
BRAMBLES 4,625% 18	5 000	5 454 357 €
BRAMBLES U 4,125% 25	1 600 000	1 556 202 €
BRANCH BKG 1,45%2019	5 000 000	4 651 070 €
BRCLYS PLC 3,684% 23	3 774 000	3 570 783 €
BRDCOM 3875 0127	3 000 000	2 840 710 €
BRDCOM C 2,375 0120	6 900 000	6 486 754 €
BRISA CONCES 2% 23	4 100 000	4 222 682 €
BRISTOL SQ 0,875% 17	5 550 000	5 190 839 €
BRIT SKY 2,625% 19	4 701 000	4 416 516 €
BRITISH SKY 1,50% 21	9 048 000	9 438 928 €
BRITISH TEL 0,625%21	10 350 000	10 394 857 €
BRIXMOR 3850 010225	2 500 000	2 317 013 €
BRIXMOR OP 3,25 0923	5 307 000	4 857 132 €
BRK 3,45% 2021	2 600	2 532 145 €
BROADDRID 3,95% 2020	1 200 000	1 176 170 €
BROOKFIELD 4,25 626	7 150 000	6 808 399 €
BT 1,125 10/03/23	3 000 000	3 038 997 €
BTP 0,30 151018	10 000 000	10 069 818 €
BTP 1,25 01/12/26	6 000 000	5 566 579 €
BUCKEYE PART 3,95%26	2 075 000	1 931 375 €

BUNDERSREPUB DEUTSCH	10 000 000	15 122 884 €
BUNGE FI 1850 160623	2 179 000	2 288 811 €
BUNGE FIN 3,25% 2026	2 205 000	1 991 425 €
BURL NTHN 3,65 0925	2 620 000	2 555 054 €
BURLINGTON 3% 0425	1 600 000	1 488 541 €
BURLINGTON 305% 0922	1 900 000	1 819 794 €
BURLINGTON N 4,1 621	1 600 000	1 609 817 €
C SUISSE 3574 090123	1 675 000	1 573 906 €
CA ASSUR 4,25% 2025	10 700 000	10 927 961 €
CA ASSUR 4,5% 49	9 700 000	10 057 809 €
CA INC 3600 150822	5 000 000	4 743 257 €
CA LOND 1,25 140426	11 400 000	11 552 671 €
CA LONDON 2,375% 21	3 300 000	3 037 621 €
CA LONDON 2,375% 24	12 500 000	13 995 527 €
CA LONDON 3,125% 23	8 900 000	10 391 023 €
CADES 4,125 04/23	39 952 000	50 404 754 €
CAIXABK 3500 150227	4 500 000	4 642 257 €
CAJA 2,375% 2019	2 200 000	2 345 341 €
CAMPO FOOD 3,37 22	1 500 000	1 241 426 €
CAN IMPERIAL BK	5 929 000	5 565 405 €
CAP GEMINI 1,75% 20	13 100 000	13 805 730 €
CAPGEMINI 0,50 1121	4 400 000	4 392 923 €
CAPITA OBAK 3,375 23	2 375 000	2 223 219 €
CAPITAL 2350 310120	1 375 000	1 289 410 €
CAPITAL ON 3,75 0327	4 600 000	4 280 911 €
CAPITAL ONE 1,65% 18	1 895 000	1 773 510 €
CAPITAL ONE 2,95% 21	11 500 000	10 881 964 €
CAPITAL ONE 5,50% 24	4 056 000	3 757 590 €
CARGILL INC 2,5% 23	2 461 000	2 736 464 €
CARLSBERG 2,5% 24	11 863 000	13 207 948 €
CARMILA 2,375% 23	4 600 000	4 931 027 €
CARMILA 2,375% 24	4 900 000	5 205 348 €
CARREFOUR 1,75 22	4 000 000	4 271 081 €
CARREFOUR 1,75%2019	4 200 000	4 412 854 €
CARREFOUR SA	8 500 000	8 435 534 €
CARREFR Eurib3 20	1 100 000	1 104 233 €
CASINO 3,157%2019	1 200 000	1 337 314 €
CASINO 3,248%14-2024	4 000 000	4 349 522 €
CASINO 3,994% 03/20	1 500 000	1 693 343 €
CASINO 5,976% 21	2 300 000	2 801 207 €
CBL ASSOC LP 5,95 26	4 770 000	4 381 778 €
CBS 2,90%16-2027	3 500 000	3 059 156 €
CBS CORP 3,7% 08/24	4 700 000	4 460 502 €
CBS CORPO 4% 2026	3 200 000	3 086 184 €
CCHLN 1,875%16-2024	3 700 000	3 937 943 €
CDT AGRI 4125 100127	3 433 000	3 206 518 €
CELANES US 1,125 923	6 750 000	6 780 406 €
CELG 3,875% 15/08/25	1 000 000	958 667 €
CELGENE 2,125% 2018	1 045 000	983 174 €
CELGENE 3,55% 2022	6 050 000	5 837 316 €
CELLNEX 2375 160124	500 000	505 978 €
CENTENE CORP	3 500 000	3 436 524 €
CF INDUST 6,875%2018	1 300 000	1 300 146 €
CF INDUSTRIE 3,45%23	1 150 000	1 020 407 €
CFCM NORD 2,125%26	3 500 000	3 382 423 €
CHARTER COMM OPT	4 830 000	4 783 567 €
CHEVRON 1,345% 17	1 750 000	1 644 482 €
CHEVRON CORP 2,35%22	5 000 000	4 635 735 €
CHRTER C OT 4,908 25	14 858 000	14 772 093 €
CHUBB 0000 0437	7 000 000	6 525 005 €
CIE ST GOBAIN 0%20	3 300 000	3 278 644 €
CIE DE ST GOB 1% 325	12 300 000	12 204 307 €
CIMAREX 5,875 0522	6 850 000	6 752 471 €
CINTAS CORP 3,7 0427	1 815 000	1 735 121 €
CISCO 2450 0620	1 000 000	955 286 €
CISCO SYS 1,65 18	2 000 000	1 884 422 €
CISCO SYS 4,45% 20	3 000	3 028 523 €

CISCO SYSTEM 1,85%21	6 740 000	6 172 221 €
CISCO SYSTEM 2,5% 26	1 390 000	1 233 412 €
CISCO SYSTEMS	1 725 000	1 662 465 €
CIT GROUP 3875 0219	1 600 000	1 531 412 €
CIT GROUP 5,375% 20	3 000 000	3 042 390 €
CITIGR L3MUS 0923	3 265 000	3 138 086 €
CITIGRO 3887 100128	7 950 000	7 520 279 €
CITIGROU I 2,65 1020	7 000 000	6 647 720 €
CITIGROUP 0,75% 2023	12 930 000	12 770 420 €
CITIGROUP 1,375% 21	14 590 000	15 246 499 €
CITIGROUP 1,50% 2028	2 800 000	2 735 273 €
CITIGROUP 1,75% 2018	1 600 000	1 505 151 €
CITIGROUP 1,75% 2025	1 767 000	1 833 377 €
CITIGROUP 1,80% 2018	2 975 000	2 790 723 €
CITIGROUP 2,125% 26	7 650 000	8 161 854 €
CITIGROUP 2,15% 2018	5 540 000	5 213 323 €
CITIGROUP 2,50% 18	2 025 000	1 909 820 €
CITIGROUP 2,50% 2019	3 800 000	3 596 609 €
CITIGROUP 3,375%2023	7 500 000	7 077 912 €
CITIGROUP 3,4% 26	3 400 000	3 138 835 €
CITIGROUP 5%19EMTN	6 138	7 043 946 €
CITIGROUP 5,50% 25	4 095 000	4 192 713 €
CITIGROUP I 4,6 0326	5 000 000	4 816 335 €
CITIGROUP7,375%04/19	4 072	4 961 443 €
CITIZENS 2250 020320	800 000	747 284 €
CITIZENS 2550 130521	3 400 000	3 191 808 €
CITIZENS BANK 2,5%19	5 770 000	5 439 021 €
CITIZENS BK 230 1218	7 640 000	7 217 798 €
CITY NATIONAL	2 300	2 354 721 €
CLOVERIE 1,75% 2024	22 084 000	23 492 156 €
CNA 3,95% 05/2024	3 500 000	3 397 774 €
CNCEP 6,117%07-2017	5 000 000	5 272 719 €
CNH IND CP 4,375% 20	2 000 000	1 956 351 €
CNH IND FIN 2,75% 19	1 500 000	1 559 776 €
CNH INDUS 3,875%18	3 500 000	3 352 385 €
CNP ASSU 4% 99	2 000 000	2 087 627 €
CNP ASSUR 1,875 1022	10 600 000	10 837 976 €
CNP ASSUR 8,875 2041	2 000 000	2 458 918 €
COCA COL Eurib3 19	1 514 000	1 520 147 €
COCA-CO 0500 150377	3 968 000	3 918 033 €
COCA-CO 1100 020936	1 765 000	1 606 958 €
COCA-CO E3M25 080319	2 175 000	2 183 396 €
COCA-COLA 0,75%2022	1 450 000	1 465 500 €
COCA-COLA 0 090321	5 846 000	5 806 773 €
COCACOLA 0,75% 2023	3 330 000	3 377 570 €
COCA-COLA 1,125% 27	2 200 000	2 207 950 €
COCA-COLA 1,375 0519	1 765 000	1 649 887 €
COCA-COLA 165 0318	8 350 000	7 836 396 €
COCA-COLA 2,375% 20	7 300 000	7 892 462 €
COCA-COLA 3,8% 11/25	1 900 000	1 830 474 €
COFIROUTE 0375 0225	10 000 000	9 529 823 €
COFIROUTE 5%240521	4 300 000	5 309 175 €
COLUMBIA PIPELIN	2 850 000	2 831 028 €
COM BK AUST 1,625%19	8 720 000	9 007 660 €
COM BK AUST 2% 27	4 800 000	5 012 860 €
COMCAST 1,625% 2022	1 450 000	1 303 558 €
COMCAST 3,125 22	5 100 000	4 899 655 €
COMCAST 3,375% 2025	705 000	668 376 €
COMCAST 5,15% 2020	4 000 000	4 085 359 €
COMCAST 9,455% 02-22	651	835 499 €
COMCAST CORP	8 295 000	7 781 993 €
COMMERZBK 0,50% 2023	5 989 000	5 753 985 €
COMMON BK 1,75% 18	3 800 000	3 571 291 €
COMMONW BK 2,55%2021	6 000 000	5 604 881 €
COMPASS GRP 1,875%23	3 650 000	3 926 152 €
COMPASS GRP 3,125%19	5 327 000	5 659 603 €
COMZBK AG 4 03/27	7 000 000	7 375 599 €

CONCHO R 4375 150125	1 300 000	1 238 714 €
CONCHO RES 5,50 23	3 375 000	3 266 769 €
CONOCOPHIL CO	3 000 000	2 765 322 €
CONS EDI 2000 150320	970 000	903 263 €
CONT AIRLN 4% 26 A	6 000	4 989 161 €
CONT AIRLN 7,25% 21	605	430 121 €
CONTIN 0000 050220	5 467 000	5 440 825 €
CONTINE 4500 150423	1 200 000	1 116 963 €
CONTINENTL 3,125% 20	4 100 000	4 578 658 €
CONTL RUB 0,50% 19	6 721 000	6 780 792 €
COVENTRY 5,45%11-21	4 225	4 428 805 €
COVENTRY BG 2,5%20	4 600 000	4 966 372 €
COVIDIEN I 4,20 20	328	329 412 €
CPL ONE BANK 2,4% 19	1 500 000	1 409 808 €
CR SUISSE 0,375% 19	7 300 000	7 373 848 €
CR AGRICOLE 3,875%19	5 400 000	5 816 056 €
CR SUISSE 1,375% 19	8 995 000	9 337 156 €
CR, AGRI,ASSU TV48	4 300 000	4 599 080 €
CRD MU ARK 3,25 0626	1 500 000	1 596 553 €
CRD MU ARK 3,5 0229	900 000	929 601 €
CRE SUISSE 1,5% 2026	5 400 000	5 710 786 €
CREAGR 0,875% 2022	15 600 000	15 899 057 €
CREAGR LONDN 0,75%22	6 000 000	6 044 729 €
CRED AGRI 3,875% 24	2 427 000	2 378 278 €
CRED SUIS 1,125% 20	1 200 000	1 244 184 €
CRED SUIS 1,75% 2018	2 925 000	2 743 925 €
CRED SUIS GP 1,25%22	6 489 000	6 657 263 €
CRED SUIS NY 1,7% 18	3 195 000	3 005 194 €
CRED SUIS NY 3,62%24	5 025 000	4 772 649 €
CRED,AGRIC,8,2% 2018	7 000 000	7 507 700 €
CREDI AGRI 2,625% 27	4 000 000	4 065 700 €
CREDIT AG 1,875 1226	6 500 000	6 503 423 €
CREDIT AGR 1125 0325	11 200 000	11 248 513 €
CREDIT AGR 1625 0329	8 900 000	8 925 379 €
CREDIT SUIS 1% 2023	12 345 000	12 684 372 €
CRH FIN VRN 21	3 200 000	3 409 320 €
CRH FINA 1375 181028	3 050 000	2 993 909 €
CRH FINANCE 3,125%23	5 155 000	5 853 370 €
CRH FINLAND 2,75%20	3 200 000	3 497 075 €
CRITERI S 1,625 22	15	1 536 434 €
CROWN CASTL 3,222%22	2 000 000	1 891 973 €
CROWN CASTL 3,4 0221	7 500 000	7 163 636 €
CROWN CASTLE 5,25%23	2 021 000	2 082 424 €
CROWN CST 6,113 20	800 000	811 965 €
CROWN EU 2,625 09/24	3 700 000	3 623 379 €
CROWN EUROPEAN 4%22	1 250 000	1 391 297 €
CRWCASTINT 4 0327	4 395 000	4 156 009 €
CS AG 5,75% 09/25	3 700 000	4 256 635 €
CS GR FDG 3,45% 21	8 000 000	7 693 285 €
CS LONDON 1,375%22	15 579 000	16 302 881 €
CS NY 5,3 08/19	2 095	2 112 816 €
CSC HOLDIN 5,5 0427	1 700 000	1 661 906 €
CSNY 3% 29/10/21	4 000 000	3 812 183 €
CSTEL BRD 4,75 25	7 400 000	7 555 957 €
CSX CORP 2,60 26	500 000	442 107 €
CUBESMAR L 3,125 926	975 000	858 645 €
CVS 4% 05/12/23	1 260 000	1 250 285 €
CVS CARRK 2,75% 22	1 390 000	1 297 782 €
CVS HEALTH 2,125 621	355 000	327 696 €
CVS HEALTH 2,80% 20	3 600 000	3 434 880 €
CVS HEALTH 2,875% 26	2 825 000	2 537 872 €
CVS HEALTH 3,50% 22	4 265 000	4 140 392 €
CVS HEALTH 3,875% 25	2 656 000	2 576 021 €
DAIMLER 0,625% 0320	4 200 000	4 262 252 €
DAIMLER 0,75%16-2023	2 350 000	2 387 177 €
DAIMLER AG 0,85 25	21 937 000	21 827 847 €
DAIMLER AG 0,875%21	12 300 000	12 622 941 €

DAIMLER BZ 0,50 19	12 864 000	13 040 939 €
DAIMLER BZ 2,25% 22	3 000 000	3 286 836 €
DAIMLER FI 2,25 19	8 300 000	7 809 958 €
DAN BANK 2,75% 05/26	2 000 000	2 177 800 €
DANFOSS 1,375% 2022	3 577 000	3 709 914 €
DANONE 0,424 22	2 800 000	2 780 094 €
DANONE 1,125 25	4 600 000	4 645 111 €
DANONE 1,691%16-2019	3 575 000	3 319 754 €
DANONE 2,6% 2023	5 200 000	5 891 817 €
DANONE EMTN 709 1124	3 800 000	3 744 462 €
DANSKE B 1250 150621	4 000 000	4 248 776 €
DANSKE BANK 0,75%23	5 890 000	6 005 406 €
DANSKE BK 3,875% 23	4 650 000	4 982 728 €
DARDEN 6,8%07-2027	4 885	5 549 462 €
DBR 2,50% 2044	5 000 000	6 757 374 €
DELAIR LI 3,625 0325	3 150 000	2 991 740 €
DELPHI AUTO 1,6 0928	2 718 000	2 686 089 €
DELPHI AUTOM 1,5% 25	1 900 000	1 917 325 €
DELT AIR L 2,875 320	1 055 000	994 768 €
DELTA AIRL 4,95% 19	3 000	1 326 840 €
DELTA LLOYD 9% 42	7 263 000	9 731 446 €
DEMETER INV 4,375%25	1 735 000	1 905 002 €
DEMETER INVT,3,5% 46	982 000	1 064 669 €
DEU,TELEK,8,25%30	100	138 709 €
DEUT BAHN 0,875%31	7 385 000	6 954 386 €
DEUT TEL FI 0,625%23	14 005 000	13 984 784 €
DEUT TEL FIN 1,5% 28	10 340 000	10 279 224 €
DEUTANNIG TF/TV 74	3 000 000	3 295 729 €
DEUTS BK LD 2,5% 19	2 500 000	2 347 135 €
DEUTS USLIB 0119	2 060 000	1 947 894 €
DEUTSC ANN 2,125%22	5 200 000	5 660 892 €
DEUTSCH BK AG 1% 19	13 000 000	13 146 529 €
DEUTSCHE 0375 1021	6 950 000	6 976 181 €
DEUTSCHE 0875 0124	12 645 000	12 706 116 €
DEUTSCHE 1375 0118	2 590 000	2 601 846 €
DEUTSCHE 2,375%2022	3 500 000	3 948 842 €
DEUTSCHE 3,125%2019	9 400 000	10 249 810 €
DEUTSCHE 3600 190127	1 725 000	1 612 667 €
DEUTSCHE 4% 31/12/99	4 800 000	5 101 131 €
DEUTSCHE AN 3,625%21	4 590 000	5 295 475 €
DEUTSCHE AN,0,875%20	4 600 000	4 679 170 €
DEUTSCHE B 1,5 0122	23 200 000	23 644 572 €
DEUTSCHE TEL 0,25%16	6 000 000	6 007 625 €
DEUTSCHE W 1,375% 20	8 764 000	9 150 987 €
DEVON ENGY 3,25% 22	559 000	523 120 €
DH EUROP FN 170 0122	1 723 000	1 834 989 €
DH EUROPE FI 2,50%25	4 812 000	5 443 389 €
DIAMOND FIN 3,48%19	4 275 000	4 135 851 €
DIAMOND1 2, 4,42%21	5 500 000	5 442 897 €
DIAMOND1 TF 5,45%23	4 400 000	4 493 767 €
DIGITAL 3950 0722	4 875 000	4 776 246 €
DISCOV BK 3,20 0821	445 000	422 964 €
DISCOV FIN 3,95% 24	1 775 000	1 678 294 €
DISCOVER 3,85% 2022	3 000 000	2 898 492 €
DISCOVER 4,10 0227	940 000	883 987 €
DISCOVER BK 2% 18	2 000 000	1 875 919 €
DISCOVER BK 8,7%19	506	541 415 €
DISCOVERY 380 130324	250 000	232 182 €
DISCOVERY 4,90%16-26	440 000	429 545 €
DISCOVERY 5,625%19	1 491	1 513 922 €
DISH DBS 5,875 24	1 300 000	1 301 005 €
DISH DBS 7,875 19	2 000 000	2 072 904 €
DNB BANK ASA	5 000 000	5 010 622 €
DNB BK 1125 0323	8 400 000	8 712 145 €
DOLLAR GL 1,87 18	1 450 000	1 367 809 €
DOLLAR GL 3,25% 2023	5 980 000	5 659 780 €
DOMINION 1,6%16-2019	1 125 000	1 039 877 €

DOMINION RES 5,2%19	2 255	2 266 812 €
DOW CHEMI 3,5% 1024	2 645 000	2 507 795 €
DTE ENERGY 3,85% 23	2 700 000	2 642 951 €
DUFYR FIN 4,50 22	1 000 000	1 052 735 €
DUKE ENERGY 3,8% 23	1 825 000	1 795 769 €
DUKE ENERGY 1,80%21	3 850 000	3 482 044 €
DUKE ENERGY 5,05% 19	2 040	2 038 923 €
DUKE NRG FLA 3,2% 27	1 025 000	968 986 €
DUKE NRGY 3,95% 2023	1 225 000	1 219 402 €
DUKE REAL 6,5% 18	2 700 000	2 650 280 €
DUKE REALTY	2 000 000	1 921 905 €
DVB BANK 1000 0422	1 400 000	1 407 569 €
E,ETAT 3,75%05 OAT	693 509 779	826 997 072 €
E,ETAT 8,5%92 OAT	694 313 356	1 091 120 097 €
EASTMAN CHEMI 3,6%22	3 717 000	3 596 373 €
EASTMAN CHMC 2,8% 25	1 300 000	1 240 747 €
EASTMN CHM 2,70 20	1 300 000	1 237 926 €
EASYJET 1,75 23	2 500 000	2 586 475 €
EATON 2,75%2022	2 200 000	2 066 047 €
EATON CAP,0,75%2024	1 988 000	1 951 510 €
EBAY 2,6%12-2022	4 000 000	3 699 304 €
EBAY INC 2200 010819	2 000 000	1 882 626 €
ECOLAB 2,625% 2025	2 966 000	3 344 737 €
ECOLAB INC 1 24	7 603 000	7 665 349 €
EDENRED 1875 0327	1 500 000	1 494 040 €
EDF 1% 13/10/2026	14 500 000	14 011 527 €
EDF 1,625% 271125	4 300 000	4 533 042 €
EDF 1,875% 36	1 600 000	1 441 709 €
EDF 2,75% 2023	2 900 000	3 219 706 €
EDF 4,125%01/49	2 000 000	2 033 274 €
EDF 4,25% 49	8 000 000	8 260 548 €
EDF 4,625 04/30	500 000	657 993 €
EDF 5 5/8%33	3 388	4 832 886 €
EDF 5,375% 2049	1 400 000	1 464 606 €
EDISON INC 2% 0521	2 700 000	2 489 811 €
EDP FIN 1,125% 2024	7 350 000	7 042 747 €
EDP FIN 1875 0923	3 000 000	3 050 573 €
EDP FIN 2,375% 23	2 030 000	2 124 654 €
EDP FINA 4,125% 0121	1 090 000	1 231 518 €
EDP FINANC 2,625% 19	600 000	644 702 €
EDP FINANC 4,875% 20	8 090 000	9 460 927 €
EL PASO 6,5% 2020	2 525 000	2 638 085 €
EL PASO OP 6,50% 20	3 238 000	3 351 172 €
ELISA OY 0875 170324	2 850 000	2 820 507 €
ELM 5,849%07-2017	7 950 000	8 404 804 €
ELM BV 3375 290947	5 100 000	5 061 444 €
EMBRAER NL 5,05% 25	2 000 000	1 946 147 €
EMERA 2150 0619	385 000	361 393 €
EMERA 2700 0621	535 000	500 611 €
ENABLE MIDS 4,4 0327	3 990 000	3 695 801 €
ENABLE MIDSTRM	2 500 000	2 305 939 €
ENAGAS FIN 1,375%28	500 000	500 384 €
ENAGAS FIN 0,75%2026	2 500 000	2 388 102 €
ENAGAS FIN 1,25% 25	5 100 000	5 182 270 €
ENAGAS FIN 2,50% 22	3 100 000	3 492 813 €
ENBRIDGE I 4,25 26	3 258 000	3 153 959 €
ENBW 3,625% 14-2076	1 300 000	1 340 428 €
ENCANA C 3,9 1121	3 000 000	2 900 444 €
END FINANCE 2,95% 22	4 500 000	4 223 454 €
ENEL 5,25% 20/05/24	200	1 334 906 €
ENEL FI 5%09-22	5 000	6 301 706 €
ENEL FIN 1,966% 2025	6 808 000	7 153 309 €
ENEL FIN INT1 PCT16	20 870	20 828 174 €
ENEL FIN INTL 1 0924	2 300 000	2 272 633 €
ENEL INV,5,25%23	2 060 000	2 645 797 €
ENEL SPA 4,875% 18	3 510 000	3 681 720 €
ENEL SPA 5% 75	7 300 000	7 871 896 €

ENERGIE B 3,375 0477	3 990 000	4 120 119 €
ENERGY 6050 010641	2 120 000	2 087 867 €
ENERGY TRA 4,2 0427	665 000	620 171 €
ENERGY TRA 6,7% 18	1 525	1 529 141 €
ENERGY TRAN 2,50% 18	2 000 000	1 892 364 €
ENERGY TRAN 4,75% 26	1 000 000	973 985 €
ENEXIS HOLD 0,875%26	6 900 000	6 867 517 €
ENEXIS HOLDG 1,50%23	7 290 000	7 742 573 €
ENGIE 1500 0328	2 800 000	2 819 266 €
ENGIE SA 0,875 27032	6 500 000	6 508 433 €
ENI 0,625% 16-2024	7 865 000	7 587 046 €
ENI SPA 0,75% 22	3 336 000	3 381 393 €
ENI SPA 1,125% 2028	8 000 000	7 530 285 €
ENI SPA 1,50% 26	3 200 000	3 225 434 €
ENI SPA 1500 170127	6 800 000	6 778 260 €
ENI SPA 2,625% 2021	3 004 000	3 317 667 €
ENI SPA 3,25% 2023	2 500 000	2 917 297 €
ENI SPA 3,625% 29	1 200 000	1 435 597 €
ENI SPA 4,125%09-19	43	2 408 499 €
ENLINK MD4,40%04/ 24	5 000 000	4 706 881 €
ENTER PRODU 5,20% 20	8 600	8 782 615 €
ENTERGY 5,59% 24	1 000 000	1 073 359 €
ENTERGY 4% 15-2022	3 930 000	3 854 523 €
ENTERGY CO 2,95 0926	475 000	420 297 €
ENTERP PROD 3,75% 25	1 350 000	1 276 764 €
ENTERPRISE 5,25%2020	5 230	5 317 183 €
ENTERPRISE O 6,5 119	1 378 000	1 404 716 €
ENTERPRISE PRODU	2 700 000	2 667 195 €
EOG RESOU 5,625 0619	1 550 000	1 585 600 €
EPENERGYA 4,37 18	4 200 000	4 453 632 €
EPENERGYA 5,87 19	2 600 000	2 994 209 €
EQUINIX 5,375% 23	3 500 000	3 405 746 €
ERAC USA 3,85% 2024	2 300 000	2 219 019 €
ERAC USA FINANCE	4 400 000	4 081 732 €
ERICSSON 1875 010324	6 600 000	6 601 863 €
ERP OPERA 2,85 11/26	2 450 000	2 188 463 €
ERSTE GRP 1,875% 19	9 700 000	10 229 628 €
ERSTE GRP 7,125%2022	4 000 000	5 218 933 €
ESB FINAN 1,75 0229	10 016 000	10 382 306 €
ESB FINANCE 2,125%27	2 700 000	2 958 691 €
ESSEX PORT 3,62 22	2 000 000	1 916 235 €
ESSEX PORT 3375 0426	3 200 000	2 946 996 €
ESSILOR 1,75% 090421	2 500 000	2 692 110 €
ETP 5,2% 2022	3 000 000	3 030 810 €
ETP 6,50% 2042	2 490 000	2 561 764 €
ETP 9% 15/04/2019	1 222	1 333 157 €
EUROCLEAR 1,125 -26	6 300 000	6 334 688 €
EUROGRID 1,875 25	3 900 000	4 217 666 €
EUTELSAT 1,125% 21	5 300 000	5 422 719 €
EUTELSAT 3,125% 2022	500 000	564 094 €
EUTELSAT SA 2,625%20	2 000 000	2 121 172 €
EVERSOURCE ENERG	595 000	558 128 €
EVERYTH 3,25%2018	6 120 000	6 510 692 €
EVONIK FIN 0,75 0924	3 000 000	2 877 246 €
EVONIK FIN 0,75 0928	2 350 000	2 154 274 €
EVONIK IND 1 23	4 950 000	5 052 831 €
EXELON 2,85% 20	1 100 000	1 049 788 €
EXELON 3497 0622	1 295 000	1 223 421 €
EXELON CORP 2,45% 21	105 000	98 035 €
EXELON CORP 3,4% 26	700 000	653 607 €
EXOR SPA 2,125% 22	3 000 000	3 174 833 €
EXOR SPA 2,5%10/24	5 450 000	5 787 858 €
EXPEDIA 2,50% 22	5 100 000	5 482 859 €
EXPERIAN F 2,37 17	1 350 000	1 272 938 €
EXPRESS 4,75% 2021	4 000 000	4 081 875 €
EXPRESS SCRIPTS 3%23	3 000 000	2 735 403 €
EXXON 2,222% 16-2021	3 250 000	3 047 043 €

EXXON MOBIL3,043 0326	5 435 000	5 080 733 €
FAURECIA 3125 150622	350 000	362 811 €
FAURECIA 3625 0623	2 850 000	3 001 779 €
FCA CAP IRE 1,25% 20	4 323 000	4 404 302 €
FCA CAPI 1,375% 20	7 900 000	8 141 412 €
FCA CAPI 1250 210121	900 000	913 320 €
FCA CPTL IRE 1,25%18	9 800 000	10 009 173 €
FCE BANK 1,875% 21	9 421 000	9 979 873 €
FCE BANK 0869 0921	12 448 000	12 486 224 €
FCE BANK 1,528 1120	2 740 000	2 846 103 €
FCE BANK 1660 110221	1 500 000	1 557 585 €
FCE BANK PL 1615 523	3 030 000	3 138 567 €
FEDEX 2,625% 2018	2 910 000	159 077 €
FEDEX 3,25%16-2026	500 000	461 882 €
FEDEX CORP 1% 23	2 800 000	2 830 966 €
FERMACA EN 6,375% 38	1 825 000	1 638 944 €
FERROVEMIS 2,5 24	1 100 000	1 213 810 €
FERROVIAL 0,375%2022	1 500 000	1 474 678 €
FERROVIAL EMISIO	7 800 000	7 790 063 €
FGA CAPITAL 2% 19	5 130 000	5 354 650 €
FIAT INDFI 6,25 18	1 370 000	1 450 477 €
FIDELI NATIO 2,25%21	3 061 000	2 804 326 €
FIDELITY 3,625% 2020	14 500 000	14 254 455 €
FIDELITY 3,875% 2024	2 100 000	2 037 635 €
FIDELITY 4,50% 2022	1 305 000	1 326 804 €
FIDELITY NATL 3,5%23	1 550 000	1 490 855 €
FINM,5,75%18 EMTN	1 500	1 661 147 €
FIRST AMERIC 4,60%14	2 900 000	2 770 716 €
FIRST HORIZ 3,5 1220	745 000	720 686 €
FIRST RP BK 2,375%19	905 000	850 766 €
FLA GAS 5,45%0720	1 000 000	1 013 287 €
FLEXTRONICS 5%2023	6 000 000	6 015 284 €
FLORIDA PW 3,125% 25	2 000 000	1 908 735 €
FON REG 1,75% 09/21	8 500 000	8 888 336 €
FON TERRA 0750 081124	3 100 000	3 012 148 €
FORD M +127 280322	6 500 000	6 133 451 €
FORD MOTOR 2,375%18	1 800 000	1 698 201 €
FORD MOTOR 2,943%19	4 390 000	4 185 727 €
FORD MOTOR 3,33 21	2 500 000	2 368 018 €
FORD MOTOR 3096 0523	6 675 000	6 164 903 €
FORD MOTOR 4,25% 22	1 325 000	1 291 825 €
FORD MOTOR 4,375%23	1 135 000	1 112 842 €
FORD MOTOR 4,389% 26	5 100 000	4 912 397 €
FORD MOTOR 5%18	976 000	960 080 €
FORD MOTOR 5,875%21	2 000 000	2 098 754 €
FORTIS INC 2,10% 21	1 925 000	1 743 683 €
FORTIVE 2,35%16-2021	2 100 000	1 951 408 €
FRA,TEL,5 5/8%18	900	1 000 864 €
FRA,TELEC,8 1/8%33	1 194 000	2 164 283 €
FRESENF 1,50 24	5 000 000	5 102 281 €
FRESENIUS 0875 0122	5 000 000	5 037 633 €
FRESNS FIN 4 010224	1 050 000	1 239 231 €
FRTEL 4,125% 2019	1 100 000	1 189 317 €
FTB MEMPHI 2,95 19	4 825 000	4 575 263 €
G4S INTL 1,50% 01/23	3 805 000	3 863 839 €
G4S PLC 2,625% 18	920 000	964 901 €
GAI BOND IS 3,4 926	2 042 000	1 850 205 €
GALP GAS 1,375% 2023	3 900 000	3 874 314 €
GAS FENOSA 2,875% 24	3 700 000	4 157 414 €
GAS N 1125 0424	7 100 000	7 086 013 €
GAS NA FE 1,375 0127	7 800 000	7 723 399 €
GAS NAT 4,125 18	69	3 592 561 €
GAS NAT 5,375 19	30	3 479 023 €
GAS NAT 6,375 19	800 000	951 143 €
GAS NAT FE 4,125% 22	1 000 000	1 053 093 €
GAS NAT FEN, 1,25%21	5 300 000	5 287 253 €
GAS NAT FENO 3,5% 21	6 000 000	6 942 346 €

GAS NATURAL 6% 20	3 000 000	3 531 543 €
GDF SUEZ 0,5 130322	3 800 000	3 813 371 €
GDF SUEZ 1,5% 2017	5 300 000	5 380 787 €
GDF SUEZ 3% 2049	17 400 000	18 370 497 €
GE 4,65% 2021	5 000	5 232 434 €
GE CAP 2,25% 20	5 000 000	5 433 138 €
GE CAP 2,625% 2023	1 900 000	2 141 220 €
GE CAP EUR FD 0,8%22	9 610 000	9 845 945 €
GE CAP FUND 2,875%19	5 389 000	5 851 720 €
GE CAPIT2,342% 20	7 000 000	6 624 641 €
GE EUR FUND 5,375%20	1 200	1 392 333 €
GECINA 1% 30/01/29	2 400 000	2 237 650 €
GECINA 1,5% 2025	1 600 000	1 649 314 €
GECINA 2% 24	1 200 000	1 301 311 €
GELF BOND 1,75% 21	4 640 000	4 843 124 €
GELF BOND 0,875% 22	4 499 000	4 466 245 €
GEN ELECT 1,875 % 27	1 000 000	1 091 512 €
GEN ELECTRI 1,25% 23	16 360 000	17 223 179 €
GEN ELECTRIC 2,7%22	6 325 000	6 030 261 €
GEN ELECTRIC 5%2021	3 822 000	3 804 375 €
GEN MOT 2,35% 19	2 400 000	2 244 193 €
GEN MOT 4200 010321	2 080 000	2 034 953 €
GEN MOTORS 3,2% 20	9 000 000	8 620 317 €
GEN MOTORS 3,2% 21	4 130 000	3 906 118 €
GEN MOTORS 3,7 0523	2 200 000	2 099 427 €
GEN MOTORS F 1 0520	3 664 000	3 779 342 €
GEN MOTORS FIN	2 635 000	2 543 284 €
GENERAL 5,625%18	3 038	3 034 570 €
GENMOTFIN 4,375% 21	5 965 000	5 869 661 €
GENMOTFIN 5,25%2026	5 300 000	5 349 347 €
GILEAD 2,35%02/20	1 650 000	1 557 187 €
GILEAD SCIE 2,5 0923	1 720 000	1 558 013 €
GILEAD SCIE 3,25% 22	3 455 000	3 303 076 €
GILEAD SCIE 3,65% 26	1 730 000	1 634 708 €
GILEAD SCIENCES	3 000 000	2 879 083 €
GLENCORE 1,25% 2021	1 860 000	1 886 598 €
GLENCORE 4,125% 18	11 514 000	12 014 476 €
GLENCORE 1,875% 2023	1 057 000	1 085 834 €
GLENCORE FI 1,75% 25	3 397 000	3 345 386 €
GLENCORE FI 3,375%20	3 000 000	3 327 132 €
GN FENOSA 3,875%2022	2 000 000	2 393 586 €
GNL QUINTE 4,634% 29	1 425 000	1 370 344 €
GOLD SACHS 2,35% 21	2 050 000	1 899 678 €
GOLD SACHS 2,75% 20	2 350 000	2 216 099 €
GOLD SACHS 4,25% 25	11 135 000	10 794 158 €
GOLDCORP 3,70%13-23	1 700 000	1 621 522 €
GOLDM SACH 3,75 0226	755 000	711 570 €
GOLDMA 3000 260422	1 425 000	1 342 355 €
GOLDMAN 2,875% 2026	2 500 000	2 836 562 €
GOLDMAN 1,625% 2026	8 975 000	9 049 440 €
GOLDMAN 2,125% 24	10 305 000	11 038 456 €
GOLDMAN 2,625% 2019	12 720 000	12 075 997 €
GOLDMAN 2,625% 21	950 000	894 936 €
GOLDMAN 2300 131219	3 500 000	3 295 689 €
GOLDMAN 5,125% 10/19	228	13 108 534 €
GOLDMAN 5,75%12-2022	3 090 000	3 277 559 €
GOLDMAN 6,375%18	1 100	1 240 151 €
GOLDMAN S,1,25% 2025	9 345 000	9 292 331 €
GOLDMAN SA 3,85 0127	9 045 000	8 547 393 €
GOLDMAN SACH 2,55%19	5 205 000	4 958 632 €
GOLDMAN SACHS 4% 24	7 800 000	7 582 788 €
GOODMAN FD 6,37 20	2 400 000	2 562 647 €
GOODYEAR 5,125% 2023	3 000 000	2 953 468 €
GREAT 5,292%2022	1 200 000	1 237 743 €
GREAT PL 2500 090320	145 000	136 171 €
GREAT PLAINS 3,9 727	4 825 000	4 553 859 €
GREAT PLAINS ENE	585 000	552 256 €

GREAT-WEST 1,75 -26	1 548 000	1 590 005 €
GREAT-WEST 2,5%2023	15 866 000	17 709 434 €
GROUPE FNAC 3,25% 23	1 400 000	1 432 300 €
GRUPO TE 4625 300126	1 375 000	1 333 232 €
GSACHS G 0,75 19	2 387 000	2 436 486 €
GSACHS G 2% 16-2019	2 300 000	2 164 821 €
GSACHS G 2,50% 21	3 200 000	3 513 494 €
GSACHS G 2,60 20	2 725 000	2 589 763 €
GSACHS G 2,625% 2020	16 334 000	17 845 613 €
GSACHS G 2,875% 21	5 000 000	4 721 866 €
GSACHS G 3,25% 23	13 600 000	15 441 471 €
GSACHS G 3,50 26	1 000 000	926 421 €
GSACHS G 6,15% 18	1 400	1 363 602 €
GSACHS G 7,5 19	6 600 000	6 834 039 €
HAMMERSON 2% 22	2 250 000	2 393 612 €
HANNOVER 3,375% 49	3 800 000	4 082 335 €
HANNOVER 5,75%2040	29	1 715 972 €
HANNOVER FIN,5%2043	3 000 000	3 695 043 €
HARRIS C 4854 270435	1 250 000	1 270 059 €
HCA INC 3,75%14-2019	5 195 000	4 978 774 €
HCA INC 4,50 27	975 000	913 349 €
HCA INC 4,75%12-2023	1 900 000	1 882 927 €
HCA INC 5250 150626	1 825 000	1 816 284 €
HDLBRG LUX 2,25 19	1 500 000	1 562 246 €
HEALTH CARE 4,50%24	2 000 000	1 984 592 €
HEALTHCARE 3,5%26	1 550 000	1 393 329 €
HEATHROW 1,875% 2022	4 160 000	4 502 388 €
HEIDE 7500 0420	3 000 000	3 640 745 €
HEIDEBGCMNT 2,25%24	2 050 000	2 223 776 €
HEIDELB 1500 070225	1 400 000	1 421 601 €
HEIDELBER 2,25 0323	3 984 000	4 257 911 €
HEIDELCE 1,625 0426	14 485 000	14 525 413 €
HEIDELCEM 8,5% 19	1 500 000	1 874 151 €
HEIDELCEMENT FIN	1 250 000	1 256 425 €
HEINEKEN 1% 16-2026	27 600 000	27 327 336 €
HEINEKEN 2,5%12-2019	3 968 000	4 163 792 €
HEINEKEN 2,875%2025	9 845 000	11 391 691 €
HEINEKEN NV 1,50% 24	10 118 000	10 574 517 €
HEINEKEN NV 2% 21	3 700 000	4 023 894 €
HEMSO FASTIGHET 1%26	2 600 000	2 510 074 €
HENKEL AG & CO 0%18	3 675 000	3 679 397 €
HERA SPA 0875% 26	2 950 000	2 792 244 €
HERA SPA 2,375% 24	4 200 000	4 657 252 €
HESS CO 3500 150724	1 800 000	1 625 289 €
HEWLETT CO 2,85 18	3 000 000	2 837 034 €
HILCORP EN 5,75 1025	2 250 000	2 031 403 €
HILDOC 4,25%16-2024	3 714 000	3 438 680 €
HLDG D'INFRA 2,25%25	2 500 000	2 687 565 €
HOIST KRED 3,125% 19	1 850 000	1 959 319 €
HOLCIM FIN 3% 2024	5 140 000	5 835 232 €
HOLCIM FIN, 2,25% 28	750 000	800 199 €
HOME DEPOT 2 0619	8 160 000	7 726 050 €
HOME DEPOT 2%16-2021	1 000 000	929 318 €
HOME DEPOT 2,125% 26	1 075 000	931 071 €
HOME DEPOT 3%16-2026	2 025 000	1 886 927 €
HONEYWEL 0,65%2023	1 600 000	1 624 531 €
HONEYWEL IN 1,4 1019	3 585 000	3 345 132 €
HOST H&R 6% 10/21	775 000	806 409 €
HOST HOTELS 3,75%23	2 950 000	2 817 879 €
HOWARD HUGHES 3,5%23	3 900 000	3 812 215 €
HSBC 3,90 05/26	5 100 000	4 883 151 €
HSBC 4% 30/03/2022	2 000 000	1 953 280 €
HSBC 5,1% 05/04/2021	5 000	5 065 822 €
HSBC 6,25%18 SUBD,	24	1 273 437 €
HSBC 6,375% 15-2049	6 000 000	5 707 421 €
HSBC FINCE 6,676% 21	7 500	8 017 757 €
HSBC FR 1,625% 12/18	4 900 000	5 060 012 €

HSBC FRCE EUR3M 19	2 800 000	2 827 051 €
HSBC HO 4,375 231126	690 000	659 615 €
HSBC HOL 0875 060924	14 625 000	14 389 725 €
HSBC HOL 4,041 03/28	4 650 000	4 395 966 €
HSBC HOLD 1,50% 22	11 229 000	11 641 733 €
HSBC HOLD 3,375% 24	7 900 000	8 354 208 €
HSBC HOLDI 2,65 0122	4 125 000	3 847 892 €
HSBC HOLDINGS	12 673 000	12 675 943 €
HSBC USA 1,70% 2018	2 630 000	2 461 945 €
HSBC USA 2% 2018	2 975 000	2 794 095 €
HSBCUSA 2,25 19	1 725 000	1 627 497 €
HUGHES SATEL 6,5%19	3 365 000	3 443 532 €
HUMANA INC 3,15% 22	3 320 000	3 146 263 €
HUMANA INC 3,95 0327	1 475 000	1 410 548 €
HUNTINGTON 3,15 0321	2 000 000	1 899 299 €
HUSKY ENE 3950 0422	7 000 000	6 906 231 €
HWLTT PCKD 4,65% 21	3 340	3 382 824 €
HYUNDAI LIBUS 030420	4 000 000	3 744 491 €
IBER INTL 2,50% 22	3 200 000	3 558 553 €
IBERDROLA 2,875% 20	7 500 000	8 290 127 €
IBERDROLA 1,125%2026	8 600 000	8 566 583 €
IBERDROLA 3% 22	10 600 000	11 921 061 €
IBERDROLA FIN SA	1 500 000	1 487 444 €
IBERDROLA IN 3,5% 21	2 000 000	2 253 813 €
IBM 1,625 05/20	4 975 000	4 637 206 €
IBM CO 1800 170519	1 650 000	1 557 654 €
IBM CORP 1,125% 24	8 800 000	9 093 972 €
IBM CORP 1,25% 23	8 731 000	9 195 084 €
IBM CORP 1900 0120	4 230 000	3 981 112 €
ICADE 1,125% 171125	11 100 000	10 705 583 €
ICADE 1,875% 09/2022	2 500 000	2 647 083 €
ICADE 2,25% 21	3 300 000	3 572 350 €
ICAHN EFL 4,875 19	3 000 000	2 842 359 €
IE2 HOLD 2875 010626	4 900 000	5 294 682 €
ILLINOIS TOOL1,25%23	9 190 000	9 631 936 €
IMERYS 2,5% 13-2020	7 700 000	8 305 109 €
IMERYS SA 0,875%22	2 000 000	2 012 972 €
IMP TOBAC 3,375% 26	2 060 000	2 385 780 €
IMPERIAL 1375 0125	3 610 000	3 627 394 €
INBEV NV 4% 0418	3 000	3 237 260 €
INFINEON TECH 1%2018	5 560 000	5 665 161 €
INFRA FOCH 1,25% 20	3 900 000	4 030 815 €
ING 0,75 22/02/21	3 500 000	3 568 220 €
ING 2,50 01/10/19	1 500 000	1 411 081 €
ING BANK 1,25% 2019	7 650 000	7 925 278 €
ING BANK 1,875% 2018	4 300 000	4 385 051 €
ING BANK 3%16-2028	4 400 000	4 769 240 €
ING BANK 3,625% 26	1 500 000	1 634 583 €
ING BANK 4,5% 2022	5 000 000	6 031 612 €
ING BANK NV 0 050617	2 100 000	2 102 903 €
ING BANK NV 3,50% 23	7 000 000	7 437 882 €
ING BANK TV290523	5 700	6 371 620 €
ING BK 5,80% 23	2 425 000	2 512 294 €
ING GROEP 0750 0322	12 000 000	11 943 311 €
ING GROEP 2,50 0229	11 600 000	11 866 562 €
ING GROEP 3,15 22	3 998 000	3 738 712 €
ING GROEP 3,95 27	380 000	354 721 €
ING GROEP NV	5 525 000	5 178 161 €
ING US INC 2,9% 2018	3 687 000	3 491 844 €
ING VERZ,6 3/8%27	1 280	13 606 097 €
INMOBILIARIA 1,45%24	18 100 000	17 278 640 €
INT LEASE 5,875%2019	12 730 000	12 689 804 €
INT PAPER 3,80% 2026	3 900 000	3 714 269 €
INTEL CO 3300 011021	1 550 000	1 504 678 €
INTEL CORP 2,60 26	3 490 000	3 156 295 €
INTEL CORP 2,7% 22	1 600 000	1 512 382 €
INTERNATI FL1,75 324	4 883 000	5 129 161 €

INTESA 4%10-2018	38	4 091 056 €
INTESA SA 4,375%2019	2 000 000	2 237 521 €
INTESA SAN 1,125% 22	6 250 000	6 238 553 €
INTESA SAN 1,375 124	3 100 000	3 073 609 €
INTESA SAN 3,875% 18	3 400 000	3 245 325 €
INTESA SAN 4% 23	9 364 000	10 984 655 €
INTESA SANP 2% 21	16 640 000	17 635 067 €
INTESA SANP 4,75% 24	4 900 000	5 091 797 €
INTESA SANPA 3% 19	5 497 000	5 801 347 €
INTESA SANPA 3,5% 22	4 800 000	5 359 077 €
INTESA SP 6,625%2018	48	2 697 861 €
INTESA SPA 4,125%20	54	3 086 715 €
INTL LS FIN 3,875 18	1 885 000	1 825 533 €
INTL LS FIN 5,875 22	2 000 000	2 093 310 €
INTL PAPER 3%16-2027	1 400 000	1 231 349 €
INTPUB GRP 4,20% 24	1 650 000	1 616 359 €
INTPUBLICGRP 3,75 23	1 249 000	1 189 196 €
INVESTOR 4,875%21	850	1 045 004 €
IREN SPA 0,875 1124	9 489 000	9 030 711 €
IRON MOUNT 6% 0823	1 625 000	1 602 397 €
ITALGAS 0500 0122	1 450 000	1 441 698 €
ITALGAS 1125 0324	12 500 000	12 499 567 €
JAB HOLD 1,75% 23	10 600 000	11 192 051 €
JAGR LD RVR 2,2% 24	2 480 000	2 462 753 €
JC DECAUX 1%16-2023	4 000 000	4 069 294 €
JJOHNSON 2,45% 26	4 550 000	4 093 847 €
JOHN DEERE 2,8 0323	2 815 000	2 635 095 €
JOHNSON 1% 150923	14 226 000	14 171 757 €
JOHNSON&JO 065 0524	8 695 000	8 785 932 €
JOHNSON&JOHN 1,65%35	7 000 000	7 316 528 €
JOHNSON&JOHN 2,05%23	1 075 000	980 386 €
JOHSON CO 3,9 0426	1 600 000	1 555 413 €
JP MORGAN 4,5%12-22	17 500 000	17 737 986 €
JPM 4,625% 2021	7 500	7 674 666 €
JPMORG CH 3625 1227	2 657 000	2 442 355 €
JPMORG CHASE 4,4%20	2 260 000	2 267 400 €
JPMORG CHASE 6% 0118	4 000 000	3 912 836 €
JPMORGAN 1,375% 21	8 129 000	8 531 140 €
JPMORGAN 1,5% 25	2 120 000	2 192 880 €
JPMORGAN 2,625% 21	19 200 000	21 420 445 €
JPMORGAN 0625 250124	18 600 000	18 251 226 €
JPMORGAN 1,50% 2022	1 400 000	1 473 875 €
JPMORGAN 1,875%2019	6 000 000	6 328 968 €
JPMORGAN 2,295% 2021	5 245 000	4 858 411 €
JPMORGAN 2,55% 20	3 100 000	2 941 399 €
JPMORGAN 2,55%16-21	5 000 000	4 688 272 €
JPMORGAN 2,75% 0822	2 800 000	3 160 026 €
JPMORGAN 2,75% 23	1 900 000	2 128 402 €
JPMORGAN 2,95% 2026	5 050 000	4 480 280 €
JPMORGAN 3,20%2023	5 000 000	4 750 466 €
JPMORGAN 3,25% 22	4 885 000	4 650 482 €
JPMORGAN 3,875% 2024	4 775 000	4 530 796 €
JPMORGAN 4125 1226	4 050 000	3 898 588 €
JPMORGAN 6,75% 49	2 000 000	2 088 916 €
JPMORGAN C 3,125% 25	5 125 000	4 732 222 €
JPMORGAN Ch 4,95 320	4 760 000	4 804 972 €
JPMORGAN CH VAR1249	2 100 000	2 068 362 €
JPMORGAN CHASE TV 23	2 100 000	2 015 187 €
JYSKE BK 2250 050429	1 465 000	1 467 227 €
KAISER HOSP 3,5% 22	700 000	675 502 €
KANSAS CITY SOUT	920 000	856 664 €
KBC GROEP 2,375% 24	8 700 000	9 120 516 €
KBC GROEP 1%16-2021	3 200 000	3 285 470 €
KBC GROEP 1,875% 27	4 900 000	4 969 585 €
KBC GRP 0750 010322	16 500 000	16 470 332 €
KBC GRP 0750 181023	8 500 000	8 376 476 €
KERING	5 200 000	5 215 829 €

KERING 0,875% 22	1 500 000	1 520 553 €
KERING 1,5 050427	1 300 000	1 296 555 €
KERING 2,5%13-2020	2 700 000	2 948 865 €
KERR-MCGEE CORP	2 400 000	2 678 825 €
KEY BANK 1,60 08/19	2 100 000	1 944 203 €
KEY BK 3400 200526	5 800 000	5 349 091 €
KEYBANK NA 2,25% 20	9 500 000	8 893 321 €
KEYSIGHT TECHNOL	5 665 000	5 335 550 €
KILROY RE 4,375 1025	2 000 000	1 944 493 €
KINDER MORG 1,50% 22	5 000 000	5 110 543 €
KINDER MORG 2,25% 27	1 060 000	1 078 174 €
KINDER MORG 3,95%22	7 850 000	7 524 349 €
KINDER MORG 4,30%25	5 600 000	5 412 196 €
KLA-TENCOR 4,65% 24	4 000 000	4 041 669 €
KLEPIERRE 1% 2023	6 500 000	6 672 825 €
KLEPIERRE 4% 10-2017	5 900 000	6 135 786 €
KON DSM 0,75% 2026	6 500 000	6 336 799 €
KONINKL 0625 090425	3 000 000	2 867 539 €
KONINKL 1125 110928	2 500 000	2 356 501 €
KPN TF/TV PERP EUR	6 985 000	7 701 293 €
KRAFT FOODS 3,5% 22	2 665 000	2 572 183 €
KRAFT HEINZ 1,5%2024	2 700 000	2 733 426 €
KRAFT HEINZ 2,25% 28	2 712 000	2 772 143 €
KRAFT HEINZ 3,95% 25	3 380 000	3 234 971 €
KRAFT HZ 2% 07/18	7 890 000	7 425 155 €
KRAFT HZ 3% 01/06/26	5 000 000	4 437 302 €
KRAFT HZ 3,5% 150722	1 280 000	1 229 637 €
KROGER 3500 010226	1 500 000	1 409 390 €
KROGER CO/THE	3 000 000	2 920 577 €
LABORATORY 4% 2023	2 800 000	2 718 743 €
LAM RESEAR 2,75% 20	8 000 000	7 583 958 €
LAMAR MEDIA 5,375%23	1 675 000	1 622 496 €
LANDSBA 1,375 03/22	1 350 000	1 346 950 €
LANXESS 4,5% 23	2 105 000	2 281 044 €
LANXESS AG 1% 26	800 000	772 832 €
LBP 2,75% 27	1 500 000	1 561 303 €
LEASE CORP 2,375% 19	510 000	544 224 €
LEASEPLAN 1 240521	9 200 000	9 367 454 €
LEASEPLAN 1,375%2018	6 000 000	6 153 799 €
LEASEPLAN CORP	8 200 000	8 405 062 €
LEG IMMOBI 1,25 0124	1 500 000	1 520 729 €
LENNAR CP 4,50 19	3 500 000	3 425 389 €
LEVI STRAUSS	3 270 000	3 288 623 €
LEXINGTON 4,40% 2024	1 700 000	1 590 112 €
LIBERTY MUTL 2,75%26	4 200 000	4 577 571 €
LIBERTY MUTUAL E	5 161 000	5 233 993 €
LIBERTY PR 3,75 0425	2 000 000	1 877 381 €
LIFEP HEALTH 5,5%21	3 480 000	3 411 329 €
LINCOLN NATL CRP	2 758 000	2 565 158 €
LINDE FINAN 0,25 122	1 750 000	1 751 852 €
LLOYDS BANK 4,65% 26	685 000	653 580 €
LLOYDS BK 1,25% 25	2 650 000	2 744 652 €
LLOYDS BK 1% 191121	10 900 000	11 216 376 €
LLOYDS BK 4,5% 24	2 410 000	2 349 150 €
LLOYDS TSB 6500 0320	2 300	2 697 141 €
LOWE'S C 2500 150426	1 725 000	1 545 179 €
LOWES CO 3,75% 15-21	4 000 000	4 005 304 €
LTD BRAND 6,625 0421	3 140 000	3 191 101 €
LUNAR FDG5 1,75 25	1 500 000	1 603 990 €
LYB INTL FI 4% 23	1 600 000	1 572 488 €
LYONDELLBA 5% 19	2 645 000	2 662 759 €
MACQ GROUP 6% 20	8 000 000	8 221 850 €
MACQUA BK 1% 19	6 495 000	6 665 723 €
MACQUARIE 6,625%2021	1 200 000	1 297 294 €
MACQUARIE BK 2,35%19	5 600 000	5 279 735 €
MACQUARIE BK 2,60%19	1 400 000	1 328 824 €
MACYSRETAIL 2,875%23	7 075 000	6 210 449 €

MAGNA INTL 1,90% 23	5 100 000	5 437 835 €
MANPOW 1,875 09/2022	5 803 000	6 150 663 €
MANUF&TRADER 2,10%20	2 800 000	2 619 865 €
MANULIFE FIN4,15% 26	4 100 000	4 032 355 €
MAPFRE 1,625% 26	4 400 000	4 457 432 €
MAPFRE 4375 310347	3 500 000	3 593 991 €
MARATH PETRO 2,70%18	2 950 000	2 805 113 €
MARATHON OIL 2,8% 22	4 000 000	3 624 955 €
MARKEL 3,625%2023	4 000 000	3 808 867 €
MARRIOTT 3125 150626	1 000 000	906 202 €
MARRTTINTL 2,30 22	4 155 000	3 809 878 €
MARSH & MCL 3,75 326	1 500 000	1 436 844 €
MASCO CO 4,45 25	3 500 000	3 422 262 €
MASTERCARD 1,10 1222	3 200 000	3 312 977 €
MASTERCARD 3,375% 24	1 370 000	1 324 291 €
MAXIM 2,5% 11/18	5 000 000	4 751 448 €
MCDONALD 3,375% 15	1 500 000	1 424 553 €
MCDONALDS 1% 11/23	1 800 000	1 824 623 €
MCDONALD'S 1,125%22	5 700 000	5 909 858 €
MCDONALD'S 2,75% 20	360 000	344 221 €
MCDONALD'S 3,70%26	1 270 000	1 218 396 €
MCDONALD'S CORP	700 000	656 325 €
MCKESSON 0625 0821	3 500 000	3 503 592 €
MCKESSON 1500 1125	3 700 000	3 737 658 €
MCKESSON CORP	3 000 000	2 907 603 €
MEAD JOHNSON 3%15-20	2 200 000	2 114 178 €
MEDICOM 2,25% 19	2 300 000	2 385 067 €
MEDIOBA 0750 170220	7 036 000	7 071 548 €
MEDTRONIC 1,375% 18	3 350 000	3 127 281 €
MEDTRONIC 3,5% 25	7 400 000	7 075 678 €
MEDTRONIC 4,125%0321	2 500 000	2 484 881 €
MEDTRONIC GLOBAL	1 160 000	1 088 995 €
MERCIALYS 1,787% 23	2 300 000	2 341 019 €
MERCK & CO 1,125% 21	8 550 000	8 914 845 €
MERCK & CO 2,35% 22	1 375 000	1 287 233 €
MERCK FIN 1,375% 22	3 200 000	3 387 145 €
MERCK FIN 4,5%10-20	900	1 020 275 €
MERCK NEW 2,80%2023	3 500 000	3 315 095 €
MERCK&CO 5%09-2019	3 857	3 913 056 €
MERLIN PROP,2,225%23	1 316 000	1 376 473 €
MERLINENTT 2,75% 22	1 000 000	1 032 261 €
MET LIFE 0,875% 22	10 200 000	10 428 897 €
MET LIFE 2,375% 19	14 720 000	15 747 972 €
MET LIFE 2,375% 2023	6 006 000	6 636 122 €
METLIFE 3% 03/25	1 675 000	1 539 038 €
METROVACESA 2,375%22	10 000 000	10 612 543 €
MFINANCE 1,398%2020	2 369 000	2 435 100 €
MICHELIN LU 1,75% 27	4 000 000	4 315 524 €
MICROSFT 1,625 1218	3 400 000	3 208 794 €
MICROSFT 2 11/20	8 000 000	7 557 903 €
MICROSOFT 1,85% 0220	4 804 000	4 511 785 €
MICROSOFT 2 080823	3 015 000	2 715 196 €
MICROSOFT 2,375% 22	1 765 000	1 656 904 €
MICROSOFT 2,70% 2025	1 345 000	1 240 128 €
MICROSOFT 2875 0224	11 310 000	10 665 078 €
MICROSOFT 3,125% 28	6 000 000	7 311 641 €
MICROSOFT CORP	2 840 000	2 627 340 €
MICROSOFT1550 080821	10 735 000	9 782 136 €
MICROSOFT2400 080826	5 530 000	4 896 264 €
MIDAM NRJ 3,50%2024	2 000 000	1 966 580 €
MIDAMERICA E 3,1 527	6 675 000	6 232 649 €
MITSUB FIN 2,95%2021	7 350 000	6 932 634 €
MOHAWK INDUS 2% 2022	3 600 000	3 830 891 €
MOLSON 1,25% 24	4 765 000	4 806 153 €
MOLSON C 2100 150721	4 275 000	3 918 653 €
MOLSON CO 1,45% 19	1 600 000	1 480 237 €
MOLSON COORS	5 362 000	4 787 156 €

MOLSON E3M 0309	2 648 000	2 649 089 €
MONDELE INT 2,375%35	119 000	114 111 €
MONDELEZ INT 1% 22	600 000	609 963 €
MONDI 5,75% 2017	4 917 000	4 909 231 €
MONDI FINAN 3,375%20	2 736 000	3 066 574 €
MONDIALE 5,05% 25	5 000 000	5 230 962 €
MORG 5,375% 08/20	206	12 392 857 €
MORG 5,625% 09/2019	1 850	1 871 232 €
MORG STAN 0245 0219	3 200 000	3 030 076 €
MORGA STA 1,375 1026	5 840 000	5 729 118 €
MORGAN EURIB 122019	4 710 000	4 726 212 €
MORGAN 1% 12/2022	15 431 000	15 606 181 €
MORGAN 2,2% 2018	875 000	827 502 €
MORGAN 2,375% 2019	2 850 000	2 691 159 €
MORGAN 3625 0127	8 755 000	8 168 922 €
MORGAN 6,25%17	3 490	3 346 209 €
MORGAN C&C 2,87%2028	900 000	1 053 120 €
MORGAN C&C 2,97 23	7 000 000	6 598 862 €
MORGAN C&C 4,35 21	4 000	4 019 416 €
MORGAN ST 2,5 0421	3 650 000	3 433 088 €
MORGAN STA 3,875% 26	1 604 000	1 529 404 €
MORGAN STA 4,875% 22	3 260 000	3 357 458 €
MORGAN STAN 1,75% 24	14 850 000	15 447 801 €
MORGAN STAN 1,75% 25	2 040 000	2 108 323 €
MORGAN STAN 1,875%18	1 655 000	1 556 413 €
MORGAN STAN 2,375%21	4 200 000	4 515 398 €
MORGAN STAN 3,70% 24	1 158 000	1 117 973 €
MORGAN STAN 7,3%19	4 775	5 059 096 €
MORGAN STAN LIBUS 23	2 100 000	2 010 897 €
MORGAN STAN,3,125%26	4 935 000	4 430 785 €
MORGAN STAN,4,35% 26	3 670 000	3 508 564 €
MORGAN STANL,5%19	500 000	574 365 €
MORGAN STANLEY	7 000 000	6 625 338 €
MORGAN STLEY1,875%23	3 200 000	3 373 419 €
MOTABILITY 3,25% 18	605 000	643 935 €
MOTABILITY 3,75 17	2 700	2 802 749 €
MOTIVA ENT 5,75 20	4 900 000	4 993 725 €
MOVIL SAB 2,125% 28	1 100 000	1 101 793 €
MOVIL SAB 5 03/20	742 000	741 913 €
MPLX LP 4% 2025	2 500 000	2 328 936 €
MPLX LP 4125 010327	3 680 000	3 438 264 €
MPT OP 3325 240325	5 050 000	5 051 525 €
MS 5,5%26/01/2020	11 000	11 255 900 €
MUNC,RUCK,TV PERP,	40	2 112 176 €
MUNICH RE 6% 2041	26	3 222 496 €
MUNICH RE 6,25% 42	4 800 000	6 170 920 €
MYLAN 1250 231120	1 990 000	2 043 710 €
MYLAN 2250 221124	1 352 000	1 398 205 €
MYLAN INC 2,6% 18	2 250 000	2 131 382 €
MYLAN INC 4,20 1123	2 000 000	1 946 763 €
MYLAN NV	3 000 000	2 838 198 €
MYLAN NV 3,125% 28	1 917 000	2 028 809 €
MYLAN NV 3,95 0626	5 375 000	4 967 381 €
MYLAN NV 3750 1220	5 000 000	4 841 982 €
NAB 4,625%10-20	3 000	3 397 839 €
NAT 1,125% 03/06/22	13 680 000	14 210 929 €
NAT RURAL 1,65 19	2 200 000	2 055 011 €
NAT RURAL 5,45 17	6 000	5 758 402 €
NATION BLDG 0,50% 19	6 835 000	6 915 023 €
NATIONAL 0,625% 24	11 005 000	10 788 001 €
NATIONAL RETAIL	4 413 000	4 096 121 €
NATIONWIDE 1,25% 25	1 400 000	1 426 321 €
NATIONWIDE 3,125%17	2 000 000	2 000 640 €
NATIONWIDE 3,90%2025	3 000 000	2 903 165 €
NATL AUST 0,625 1123	4 725 000	4 713 712 €
NATL AUSTR 2% 20	8 770 000	9 406 119 €
NATL GRID NA 1,75%18	2 000 000	2 035 523 €

NATWIDE B 4,125%2023	11 995 000	12 415 883 €
NCB CLEVE 5,8 17	700 000	671 675 €
NEDERLANDSE G 0 1119	1 550 000	1 548 125 €
NEMAK SA 3,25 03/24	900 000	905 549 €
NETAPP INC 2% 17	1 325 000	1 247 983 €
NEUBERGE BE 4,5 0327	1 896 000	1 801 222 €
NEUBERGER 5,875%2022	4 000 000	3 854 944 €
NEW YORK L 2,9 0124	3 550 000	3 349 700 €
NEWELL RUBB 3,83 423	4 140 000	4 006 488 €
NEWELL RUBBE 2,6 319	160 000	151 456 €
NEWELL RUBBE4,2 0426	810 000	788 149 €
NEWELL RUBBER TV21	6 000 000	5 728 203 €
NEWF EXPL 5,375% 26	2 000 000	1 976 036 €
NEWFIELD 5,75% 22	495 000	493 548 €
NEWS AMER 3%2022	8 248 000	7 706 462 €
NGNA 0,75 02/22	5 400 000	5 465 404 €
NISOURCE 6,80% 2019	850 000	870 783 €
NISOURCE FI 3,85% 23	1 800 000	1 732 206 €
NN GROUP 0875 130123	11 221 000	11 247 187 €
NN GROUP 1% 2022	9 296 000	9 464 401 €
NN GROUP 4625 130148	5 553 000	5 786 089 €
NOBLE ENERG 3,9% 24	2 738 000	2 630 064 €
NOBLE ENRGY 5,625%21	3 000 000	2 956 531 €
NOKIA OYJ 1% 03/21	4 013 000	4 010 102 €
NOKIA OYJ 2% 03/24	1 050 000	1 035 936 €
NOMURA EUR 1,50% 21	8 300 000	8 712 316 €
NORDEA B 1 0926	550 000	551 260 €
NORDEA B 1% 22022023	6 320 000	6 523 601 €
NORDEA BANK 1,375%18	6 000 000	6 173 839 €
NORDEA BANK 2% 2021	7 031 000	7 532 225 €
NORDEA BK 1,875%25	3 500 000	3 655 269 €
NORDEA BK 2,5%20	8 300 000	7 772 689 €
NORDSTROM 4% 03/27	5 475 000	5 116 257 €
NORFOLK 5,75%18 SR	2 500 000	2 428 752 €
NOVALIS OF 3% 2022	1 000 000	1 037 903 €
NOVARTIS C 1,80 20	2 645 000	2 474 610 €
NVIDIA COR 2,20 0921	815 000	746 040 €
NVIDIA CORP 3,20% 26	950 000	860 972 €
NXP BV FDG 4,625% 23	3 417 000	3 429 398 €
NYKREDIT 0,37 20 E	2 350 000	2 345 500 €
NYKREDIT 0,75% 21	4 000 000	4 042 238 €
NYKREDIT 0875 130619	4 991 000	5 097 524 €
NYKREDIT 2,75% 27	5 000 000	5 237 835 €
OAT 0% 25/10/2023	330 000	320 037 €
OAT 3% 25/04/22	715 616 461	840 780 623 €
OAT 3,50% 25/04/20	1 679 660 699	1 930 511 811 €
OAT 4,25%07-23	633 341 000	804 073 314 €
OAT ZCP 04/24	176 110 002	168 970 503 €
OAT ZCP 25/04/2021	9 831 119	9 856 483 €
OAT ZCP 25/04/2022	9 831 119	9 753 060 €
OAT ZCP 25/04/2023	9 879 118	9 653 084 €
OCCID PETROL 3% 27	1 395 000	1 272 154 €
OMEGA HE 4500 150125	4 800 000	4 500 704 €
OMNICOM 4,45% 2020	1 200	1 200 898 €
OMNICOM GP 3,6%26	5 260 000	4 974 562 €
OMNICOM GRP 3,65% 24	4 300 000	4 132 687 €
ONCOR 2,95%15-25	2 550 000	2 356 113 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1 635 000	1 856 645 €
ONEOK INC 7,50% 2023	2 930 000	3 200 477 €
ONEOK PART 3,8% 20	4 000 000	3 868 884 €
ONTEX GROU 4,75 21	1 000 000	1 063 710 €
OPTUS FINAN 3,5% 20	6 000 000	6 766 106 €
ORACLE 3,125% 25	3 200 000	3 849 587 €
ORACLE 1,20 10/17	3 450 000	3 242 547 €
ORACLE 2,25 10/19	3 400 000	3 249 741 €
ORACLE 2,4% 23	2 550 000	2 317 884 €
ORACLE 2,80 07/21	5 000 000	4 797 142 €

ORACLE 3,875%2020	5 000 000	4 986 542 €
ORACLE CORP	6 165 000	5 507 194 €
ORACLE CORP 1,9% 21	5 650 000	5 186 217 €
ORACLE CORP 2,5% 22	3 000 000	2 819 828 €
ORAN 0,75 110923	9 800 000	9 797 745 €
ORANGE 0,875%16-2027	5 600 000	5 430 608 €
ORANGE 1% 052025	3 500 000	3 513 897 €
ORANGE 1,875% 18	1 400 000	1 451 098 €
ORANGE 1625 031119	7 900 000	7 317 969 €
ORANGE 2,75% 2019	6 125 000	5 816 027 €
ORANGE 5% 29/10/49	6 900 000	7 579 828 €
ORANGE 5,25% 2024	5 434 000	6 017 420 €
O'REILLY AUTO3,55%26	3 000 000	2 785 795 €
ORIGIN ENER 2,50%20	1 300 000	1 394 743 €
PACKAGG CORP 4,5% 23	1 300 000	1 316 056 €
PARKER-H 1125 010325	9 246 000	9 255 776 €
PARTNERRE 1,25% 2026	4 050 000	3 875 768 €
PASO NATL 8,625% 22	875	1 007 832 €
PEMEX 3,75% 03/19	710 000	746 071 €
PENSKE TRUCK 3,20%20	9 165 000	8 763 636 €
PENSKE TRUCK 4,25%23	1 000 000	982 187 €
PENTAIRFI 1,875 0917	700 000	655 189 €
PEOPLE'S UNT 3,65%22	4 535 000	4 361 009 €
PEPSI INC 5% 0618	2 457 000	2 431 437 €
PEPSICO 0,875% 2028	8 900 000	8 606 725 €
PEPSICO 3,60% 2024	1 575 000	1 547 713 €
PEPSICO IN 1,35 1019	2 150 000	1 992 657 €
PERNOD RIC 1,875% 23	5 900 000	6 357 720 €
PETRO-CANADA 6,05%18	2 445 000	2 445 475 €
PEUGEOT 2 24	12 650 000	12 670 968 €
PFIZER 1,20 06/18	1 000 000	936 668 €
PFIZER INC 0 03/20	6 508 000	6 491 911 €
PFIZER INC 0,25 0322	1 592 000	1 582 057 €
PHILIP INT 1,87 21	2 475 000	2 269 959 €
PHILIP MOR 2,875% 29	1 630 000	1 904 547 €
PHILIPPS 66 4,3% 22	1 300 000	1 288 147 €
PHILIPS 3,75% 03/22	25 000	24 334 €
PHILLIPS 3,605% 25	2 200 000	2 028 795 €
PIONEER N 6,875% 18	2 280 000	2 301 317 €
PIONEER NAT 3,45% 21	875 000	845 971 €
PLAINS ALL 2,6%19	2 925 000	2 747 333 €
PLAINS ALL 3,60% 24	4 000 000	3 680 052 €
PLAINS ALL 4,35%25	750 000	737 363 €
PLAINS PIPEL 3,65%22	8 000 000	7 654 002 €
PNC BANK 1,80%2018	4 800 000	4 519 777 €
PNC BANK N 2,45%20	4 000 000	3 791 906 €
PNC BANK NA	4 000 000	3 733 271 €
PNC FUND 3,3% 03/22	2 000 000	1 926 259 €
PNC FUNDI 5,125%0220	2 500 000	2 542 131 €
PNC PITTSB 1,95 19	4 600 000	4 314 547 €
PNC PITTSB 2,15% 25	5 200 000	4 842 734 €
POHJOLA BK 0,75%22	7 050 000	7 187 121 €
POHJOLA BK 0875 0621	10 000 000	10 336 768 €
POSTE ITAL 3,25%18	6 744 000	7 171 043 €
PPG INDS 0,875 22	3 900 000	3 940 164 €
PPG INDUS 0% 19	2 921 000	2 910 747 €
PPL CAPITAL 3,95% 24	875 000	842 934 €
PPR 3,125% 23/04/19	5 250 000	5 734 695 €
PRAXAIR 1,20%16-2024	5 200 000	5 381 356 €
PRECISION 3250 0625	3 285 000	3 123 508 €
PRICEL GRP 2,375% 24	5 000 000	5 393 955 €
PRICELIN 0800 100322	9 385 000	9 352 792 €
PRICELIN 3600 010626	3 575 000	3 360 543 €
PRICOA GLOB 1,6% 18	1 500 000	1 409 289 €
PRICOA GLOB 2,55% 20	5 700 000	5 389 242 €
PRO & GAMBLE 2,45%26	1 400 000	1 264 921 €
PROCTER 4 7/8%27	2 570	3 612 968 €

PROG EN 3,15% 04/22	2 665 000	2 515 199 €
PROGRS NR 4,875% 19	1 965	1 985 029 €
PROLINTL2 1,87 25	1 500 000	1 562 283 €
PROLINTLII 2,875% 22	1 630 000	1 792 201 €
PROLOGIS 1,375% 0521	6 700 000	6 996 229 €
PROLOGIS 1,375% 20	9 353 000	9 706 724 €
PROLOGIS 3% 01/22	10 831 000	12 051 251 €
PROLOGIS 3,375% 24	2 500 000	2 873 373 €
PROSEGUR 2,75% 02/18	6 000 000	6 151 884 €
PROXIMUS 0,5 220322	8 500 000	8 549 601 €
PRUD 4,50% 2021	3 000	3 070 838 €
PRUDENT 7,575% 2019	1 000	1 062 133 €
PRUDENT FI 3,50 24	1 000 000	972 401 €
PRUDENT FI 4,5% 2020	5 350	5 442 789 €
PRUDENT FI 4,60% 44	2 000 000	2 000 316 €
PS COLOR 2,25%2022	1 000 000	918 152 €
PSA BANQUE FR 0,5 20	5 400 000	5 423 705 €
PSE&G 3 15/05/25	2 000 000	1 888 321 €
PTN RE FIN 5,5 20	4 325 000	4 490 205 €
PUBLICIS 1,125% 2021	3 700 000	3 806 911 €
PUBLICIS GRP 0,50%23	1 500 000	1 460 200 €
PUGET ENERGY INC	2 000 000	2 088 841 €
PUGET ENGY 6% 21	2 000 000	2 091 359 €
PULTEGROUP 5,5%26	1 500 000	1 444 455 €
PZU FIN 1,375% 19	2 315 000	2 385 497 €
QBE INSURA 2,40 18	8 000 000	7 575 348 €
QORVO INC 6,75 23	3 250 000	3 343 469 €
QUEST DIAGNO 4,25%24	1 400 000	1 371 742 €
QUINTILE IMS 3,25 25	6 450 000	6 427 748 €
QVC 4,45% 15/02/2025	4 000 000	3 632 034 €
QVC 4,85% 14-2024	770 000	714 997 €
QVC INC 4,375% 2023	1 250 000	1 166 449 €
RABOBANK 2,50% 2026	9 500 000	10 141 224 €
RABOBANK 3,75% 2020	11 950	13 547 531 €
RABOBANK 3,875% 2023	1 500 000	1 776 382 €
RABOBANK 3,95% 22	5 775 000	5 611 987 €
RABOBANK 4% 01/22	6 105 000	7 232 002 €
RABOBANK 4,625% 23	2 375 000	2 371 604 €
RABOBANK 4,75%0622	16 392	20 733 211 €
RABOBANK 5,5% 20	5 650 000	5 899 931 €
RABOBANK N 2,5 0121	7 000 000	6 573 984 €
RABOBANK NED NY	2 100 000	1 936 718 €
RABOBANK NL 1,25% 26	5 300 000	5 393 184 €
RABOBANK NL 3,875%22	2 300 000	2 276 163 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	7 960	9 331 905 €
RAYMOND J 3,625% 26	3 640 000	3 366 354 €
RBS GRP PLC 5,375%19	13 650	15 748 116 €
RCI 1 17/05/23	4 466 000	4 452 803 €
RCI 2,25% 290321	3 000 000	3 175 093 €
RCI BANQUE	6 265 000	6 213 151 €
RCI BANQUE 0,5%2023	4 068 000	3 885 178 €
RCI BANQUE 0,625% 20	8 000 000	8 044 016 €
RCI BANQUE 1,375% 20	6 000 000	6 204 769 €
RCI BANQUE E3M 0319	3 400 000	3 443 757 €
RCI Bq 0,625 1121	13 229 000	13 119 269 €
RCI BQE 1375 080324	11 981 000	12 002 028 €
RCI BQUE 1,25% 22	2 670 000	2 725 116 €
REALTY IN, 3,875% 24	1 555 000	1 497 297 €
REALTY INC 6,75 0819	4 450 000	4 634 004 €
REALTY INCOME	350 000	309 009 €
RED EL 2,125% 2023	9 700 000	10 706 440 €
RED ELECTRI 1 0426	800 000	796 051 €
REDEXIS GAS 2,75%21	4 000 000	4 441 189 €
REGIONS FINL 2,25%18	4 630 000	4 344 215 €
REGLP FIN 5% 2022	5 160 000	5 123 650 €
REGLP FIN 5,875% 22	1 140 000	1 175 130 €
RELFINANCE 0375 321	5 255 000	5 258 491 €

RELX CAPI 1,30% 25	5 850 000	5 991 376 €
RELX FINANCE 1% 0324	5 170 000	5 192 450 €
RENAULT 1 03/23	7 000 000	6 970 704 €
RENFINANCE 4,75%2020	4 300 000	5 000 441 €
REPSOL 2,625% 2020	2 500 000	2 739 885 €
REPSOL INTL 2,25% 26	3 300 000	3 526 732 €
REXEL 2625 150624	900 000	886 587 €
REYNOLDS 4% 22	3 990 000	3 955 588 €
REYNOLDS 4,45% 25	1 000 000	994 968 €
REYNOLDS 8,125% 2019	1 000 000	1 075 154 €
REYNOLDS A 4,85% 23	1 000 000	1 015 702 €
REYNOLDS AMERICA	2 000 000	2 163 507 €
RIO TINTO 2875 0822	30 000	28 260 €
RIO TINTO 3,75% 25	192 000	187 497 €
RIO TNNT0 9% 2019	1 665	1 833 687 €
ROCKWELL 1950 150719	370 000	346 040 €
ROCKWELL 3,2 150324	8 185 000	7 646 629 €
ROCKWELL COLLINS	1 145 000	1 069 559 €
ROGERS COMM 3,625%25	1 045 000	996 809 €
ROPER IND 3,125% 22	2 000 000	1 904 358 €
ROPER TE 2800 151221	515 000	485 731 €
ROPER TECH 3% 2020	3 000 000	2 877 696 €
ROYA BK CA 4,65 0126	3 270 000	3 263 467 €
ROYAL BK 2000 080323	11 300 000	11 395 931 €
ROYAL BK 3,875% 2023	13 525 000	12 461 964 €
ROYAL BK 4800 050426	2 000 000	1 909 214 €
ROYAL BK SC 250 0323	2 760 000	2 858 749 €
RPM INTL 3750 150327	1 683 000	1 577 457 €
RWE 5,75%33 EMTN	1 810	2 675 627 €
RWE 6,5%08-21	3 000	3 930 751 €
RWE FINANCE 1,875%20	5 000 000	5 257 153 €
RYANAIR 1,125% 23	5 162 000	5 187 931 €
RYANAIR 1,875% 21	2 613 000	2 788 487 €
RYLAND 6,625%2020	3 000 000	3 136 376 €
S AND P GLOBA 2,5%18	1 600 000	1 509 259 €
SABINE P 5625 010221	875 000	886 208 €
SABINE P 5625 150423	4 870 000	5 049 275 €
SABINE P 6250 150322	4 940 000	5 139 772 €
SABINE PL 5,75 24	2 000 000	2 078 278 €
SALLY HC 5,625% 25	1 900 000	1 812 803 €
SAMPO OYJ 1 0923	27 952 000	28 038 389 €
SAMPO OYJ 1,50% 2021	3 100 000	3 251 557 €
SANEF 0,95% 1028	3 900 000	3 674 216 €
SANOFI	4 900 000	4 599 868 €
SANOFI 0% 2022	5 700 000	5 557 862 €
SANOFI 0,625% 24	800 000	799 318 €
SANOFI 1,125% 28	2 300 000	2 280 647 €
SANOFI 1,75% 14-2026	200 000	213 705 €
SANPAOLO 5,35% 18	14 600 000	16 088 546 €
SANTAN 3125 190127	8 100 000	8 359 804 €
SANTAN C 0875 240122	3 300 000	3 310 707 €
SANTAN CONS 0,90% 20	6 800 000	6 923 790 €
SANTAN CONS 075 0419	2 500 000	2 530 762 €
SANTAN CONS 1 0521	5 700 000	5 836 823 €
SANTAN CONS 1,10% 18	5 500 000	5 618 810 €
SANTAN CONS 1,5%2020	5 400 000	5 627 533 €
SANTAND ISSU 2,5% 25	2 000 000	1 996 852 €
SANTAND UK 3,05 18	1 019 000	970 523 €
SANTAND UK 5 23	5 965 000	5 935 980 €
SANTANDE HLD 3,45%18	1 700 000	1 621 468 €
SANTANDER 0,25%2019	900 000	901 839 €
SANTANDER INTL	10 200 000	10 603 265 €
SANTANDER INTL 4%20	7 000 000	7 799 374 €
SANTANDER UK 2,50%19	1 500 000	1 415 289 €
SANTANDEU 1,125 0923	5 700 000	5 715 871 €
SAPPI PAP HOLD 4% 23	1 100 000	1 150 362 €
SAPRR 4,875% 01/19	2 800 000	3 069 166 €

SAPRR Eurib3 19	3 700 000	3 733 991 €
SCA AB 0,50 03/20	2 000 000	2 011 222 €
SCA HYGIE 1,625 327	3 732 000	3 787 403 €
SCA HYGIEN 1,125 324	6 250 000	6 314 165 €
SCANIA e3m 24/10/18	1 355 000	1 356 819 €
SCENTRE MG 1,5% 20	6 967 000	7 288 637 €
SCENTRE MG 2,25% 24	2 800 000	3 065 139 €
SCENTRE MGM 1375 323	2 306 000	2 374 228 €
SCHAEFFLFI 2,50 20	1 100 000	1 118 989 €
SCHAEFFLFI 3,25% 25	6 100 000	6 547 396 €
SCHAEFFLFI 4,75 23	3 430 000	3 312 777 €
SCHLMB NOR 4,20 21	2 303 000	2 299 734 €
SCHNEIDER EL 2,5%21	3 600 000	3 995 808 €
SCOR 3%15-2046	9 300 000	9 595 415 €
SCOR 3875 1049	1 000 000	1 065 350 €
SCOR SE 3,625 0548	4 100 000	4 341 188 €
SCRIPPS NET,3,50%22	4 100 000	3 945 302 €
SELECT INCOM 2,85%18	1 872 000	1 769 061 €
SELECT INCOM 4,15%22	2 641 000	2 501 950 €
SELP FIN 1250 251023	2 498 000	2 449 199 €
SEMPRA 9,8% 15/02/19	815	878 666 €
SERVICE C 7,625 18	1 500 000	1 496 560 €
SERVICE COR 5,375%24	2 750 000	2 721 339 €
SES 4,625%16-2022	2 571 000	2 716 229 €
SES 5,625% 49	2 098 000	2 273 660 €
SES GLOBA 1,875% 18	2 900 000	3 005 521 €
SES GLOBAL GP 2,5%19	3 000 000	2 791 186 €
SES SA 3,6% 23	6 700 000	6 141 035 €
SG 2,5% 2026	5 100 000	5 295 277 €
SG 0750 26/05/23	6 400 000	6 456 287 €
SG 2,625% 27/02/25	2 800 000	2 874 716 €
SG 4,75 02/03/21	2 800 000	3 290 485 €
SGSP AUSTR 2 22	6 000 000	6 455 933 €
SHELL 2,5% 240326	800 000	906 536 €
SHELL IN 0,375% 25	2 000 000	1 929 257 €
SHELL INTF 2,50 26	2 600 000	2 277 944 €
SHELL INTL 0,75%2028	5 000 000	4 736 512 €
SHELL INTL 1,625% 27	3 170 000	3 344 375 €
SHELL INTL FIN	1 435 000	1 336 021 €
SHELL INTL2,125% 20	3 275 000	3 088 583 €
SHIRE ACQ 1,90% 2019	3 475 000	3 221 489 €
SHIRE ACQ 2,875%2023	1 390 000	1 258 893 €
SHIRE ACQ IN 2,4 921	10 145 000	9 272 732 €
SHIRE ACQ IN 3,2 926	3 991 000	3 550 935 €
SIEMENS FIN,2,35% 26	1 950 000	1 709 476 €
SILGAN HDG 3250 0325	450 000	449 705 €
SIMON INT F 125 525	1 090 000	1 107 102 €
SIMON INTL 1,375% 22	14 465 000	15 051 850 €
SIMON PROP 2,50% 21	8 000 000	7 494 932 €
SKANDINAV 2,5% 2026	5 000 000	5 370 638 €
SKANDINAV 2,625%2021	2 000 000	1 873 776 €
SKANDINAV ENSKIL	6 000 000	5 698 749 €
SKF 2,375% 2020	8 200 000	8 825 648 €
SKY PL 2,875% 11/20	3 500 000	3 288 301 €
SKY PLC 2,25% 25	1 140 000	1 215 143 €
SKY PLC 2,50 09/26	3 500 000	3 805 045 €
SLB 0,625% 19	5 000 000	5 066 332 €
SMBC 2,25 07/19	6 600 000	6 200 995 €
SMITHFIELD FOODS	864 000	819 009 €
SMITHS 2000 0227	1 600 000	1 630 903 €
SMURFIT AC 4,12 20	1 500 000	1 652 630 €
SNAM 0,875% 16-2026	14 230 000	13 526 739 €
SNAM 0000 251020	10 112 000	9 988 815 €
SNAM 1,25 0125	13 100 000	13 146 062 €
SNAM 1,375% 15-2023	1 028 000	1 055 014 €
SNAM 3,375% 21	1 400 000	1 561 770 €
SNS BANK TV051125	4 000 000	4 273 933 €

SNTDER UK 3,571% 23	3 300 000	3 112 689 €
SO GEN 0750 0221	2 000 000	2 033 385 €
SOC GEN 2,375% 02/18	4 300 000	4 405 648 €
SOC GEN 4% 23	2 800 000	3 270 222 €
SOCIET GE 0,125 1021	3 100 000	3 063 941 €
SOCIETE G 1% 04/22	11 300 000	11 295 469 €
SODEXO 0750 14042027	7 650 000	7 325 427 €
SODEXO 1,75% 14-2022	4 000 000	4 256 076 €
SOGECAP 4,125% 99	2 000 000	2 008 491 €
SOLVAY FI 4,199% 49	8 000 000	8 673 588 €
SOLVAY FIN 4,45% 25	2 200 000	2 180 275 €
SOLVAY TF 22	2 000 000	2 106 885 €
SOUTHER CO 1,85 0719	2 725 000	2 544 337 €
SOUTHER CO 2,95 0723	1 675 000	1 542 123 €
SOUTHERN 1,55% 2018	650 000	607 153 €
SOUTHERN P 1,95 1219	2 700 000	2 526 545 €
SOUTHERNCO 2,15% 19	2 050 000	1 919 033 €
SP GLOBAL 3,30%2020	6 000 000	5 738 217 €
SPCM 2,875 06/23	2 000 000	2 045 770 €
SPECTRA PA 3,50 25	3 100 000	2 821 359 €
SPECTRA PARTNERS	1 235 000	1 116 425 €
SPI ELECT 2,375% 20	2 960 000	3 214 647 €
SPIE SA	2 600 000	2 628 478 €
SPIRT AERO 3,85 26	4 140 000	3 887 098 €
SPRINT SPECT 3,36%21	5 000 000	4 680 333 €
ST FONCIERE 1,875%21	6 000 000	6 307 541 €
STANCORP FI 5 08/22	4 465 000	4 504 553 €
STAND CHART 4,05% 26	2 800 000	2 688 843 €
STANDARD C 3,625% 22	2 018 000	2 225 897 €
STANDARD CH 2,1 0819	3 875 000	3 604 379 €
STANDARD CHART 4%25	1 500 000	1 617 561 €
STARBUCKS 3,85%23	4 500 000	4 507 438 €
STARBUCKS C 2,45 26	1 625 000	1 463 884 €
STATE STREET 1,95%21	3 350 000	3 094 593 €
STATE STREET 3,55%25	1 500 000	1 446 391 €
STATOIL 2,875% 25	4 000 000	4 703 219 €
STATSTREET 2,55%2020	2 400 000	2 280 957 €
STATSTREET 4,95% 18	2 000	1 925 732 €
STD CHART 3,125% 24	2 200 000	2 361 984 €
STDER CS BK 0,375 20	1 000 000	1 003 215 €
STE AUTO 1,875% 25	5 200 000	5 529 122 €
STE AUTO 2,25% 20	4 600 000	4 884 806 €
STE FONCIERE 2,25%22	3 900 000	4 180 181 €
STE FONCIERE 3,50%17	2 200 000	2 276 754 €
STE GLE 6,999%2017	152	8 078 617 €
STEELRIVTC 4,71 17	500	309 711 €
STORA ENS 2,125 0623	1 250 000	1 288 288 €
STRYKER CO 3,37 24	2 000 000	1 917 563 €
STRYKER CORP 3,5% 26	3 400 000	3 212 395 €
SUEDZUCKER 1,25 23	2 750 000	2 814 171 €
SUEZ CO 1 030425	8 000 000	7 998 859 €
SUEZ ENVIRON 3% 2020	2 700 000	2 843 796 €
SUMIT MITSU 2,058%21	5 400 000	4 926 521 €
SUMITOMO 2,25%20	4 789 000	5 182 179 €
SUMITOMO MITSUI 1%22	3 390 000	3 474 672 €
SUNOCO LOG 4,25% 24	1 675 000	1 584 515 €
SUNTRUST BK 3,30% 26	3 800 000	3 483 342 €
SVB FINANC, 5,375%20	3 500	3 549 204 €
SVENSKA 2,25% 2020	5 370 000	5 825 763 €
SVENSKA 2,656% 24	2 600 000	2 718 288 €
SVENSKA H 0,25 0222	2 950 000	2 933 194 €
SVENSKA HAND 2,4% 20	11 400 000	10 649 913 €
SVENSKA HND 1,875%21	5 250 000	4 763 696 €
SVENSKA HNDL 2,45%21	6 300 000	5 870 656 €
SVENSKA HNDLSBKN	31 736 000	32 964 610 €
SVK HANDBK 4,37 21	1 600	1 926 171 €
SWEDBANK 0300 0609	11 600 000	11 493 009 €

SWEDBANK AB 2,8 0322	4 725 000	4 436 590 €
SWEDBANK VRN 24	4 200 000	4 365 600 €
SWISS BV 2,6% 25	10 800 000	10 779 859 €
SWISS RE 1,375%23	7 600 000	7 824 196 €
SYDNEY AIR 2,75% 22	11 300 000	12 749 259 €
SYNCHRON 4,25 24	6 000 000	5 778 932 €
SYNCHRONY FI 2,75%20	410 000	386 298 €
SYNCHRONY FIN 2,6%19	8 525 000	8 067 467 €
T MOBILE 6,25% 21	1 055 000	1 048 046 €
T MOBILE 6,375% 25	1 155 000	1 161 869 €
T MOBILE U 6,731% 22	1 900 000	1 860 043 €
TALANX AG 3,125% 23	8 000 000	9 266 000 €
TD AMERITR 3,62 25	2 750 000	2 616 743 €
TDC 1,75% 27	2 040 000	2 008 626 €
TDF 2,5% 07/04/26	4 500 000	4 749 488 €
TDF INFRA TF 22	1 600 000	1 750 222 €
TELECOM IT 2500 0723	7 250 000	7 362 788 €
TELECOM IT 6,125% 18	1 500 000	1 676 680 €
TELEF SAU 1,477% 21	11 300 000	11 833 911 €
TELEFON E 1,528 125	6 000 000	6 069 287 €
TELEFON TF/TV PERP	3 400 000	3 760 061 €
TELEFONI 2318 171028	2 100 000	2 145 474 €
TELEFONICA 0,75%2022	8 200 000	8 280 256 €
TELEFONICA 1,46%2026	2 300 000	2 295 209 €
TELEFONICA 2,242% 22	6 500 000	7 116 687 €
TELEFONICA 2,932% 29	4 200 000	4 545 866 €
TELEFONICA 3,75% 22	3 000 000	3 011 864 €
TELEFONICA 3,961%21	4 900 000	5 581 132 €
TELEFONICA 4,71%20	8 300 000	9 418 275 €
TELEFONICA 8,25%30	1 500	1 910 575 €
TELEFONICA EMIS	6 366 000	5 987 018 €
TELEKFIMA 3,125% 21	12 753 000	14 427 321 €
TELEKOM AUS 5,625%18	2 000 000	2 099 730 €
TELEKOM FIN 1,5%26	10 800 000	10 803 176 €
TELEP 1,5 030424	2 800 000	2 788 439 €
TELFON DEUT 2,375%21	11 073 000	11 919 316 €
TELIA CO 3000 040478	4 700 000	4 709 776 €
TELSTRA 1,125 0426	4 767 000	4 849 069 €
TELSTRA 3,75% 2022	4 400	5 291 527 €
TENET HE 6250 011118	1 900 000	1 908 644 €
TENNET H 2995 010624	6 800 000	6 777 560 €
TEO TVO 2,5% 03/21	920 000	966 536 €
TEOLL VOIM 2,625%23	3 295 000	3 429 380 €
TEREOS 4125 160623	1 000 000	1 050 350 €
TERNA 4,875%10/19	4 000	4 569 284 €
TERNA SPA 0,875% 22	1 900 000	1 926 525 €
TERNA SPA 2,875% 18	2 925 000	3 007 579 €
TESORO 5,125% 2024	470 000	457 019 €
TESORO 5125 151226	2 325 000	2 308 942 €
TESORO C 5375 011022	1 355 000	1 308 831 €
TEVA FNC 1,25% 03/23	11 097 000	10 885 083 €
TEVA PH 2200 011021	1 635 000	1 476 693 €
TEVA PH 3150 011026	5 250 000	4 507 868 €
TEVA PHA FIN 3,65%21	1 576 000	1 517 872 €
TEVA PHARM 0,375% 20	9 040 000	8 947 506 €
TEVA PHARM 1,125% 24	7 379 000	7 026 403 €
TEVA PHARM 1,625%28	3 613 000	3 302 585 €
TEVA PHARMA 1,70%19	1 590 000	1 471 456 €
TEVA PHARMA 2,80% 23	2 425 000	2 161 710 €
THERMO 1450 0327	3 250 000	3 248 618 €
THERMO FIS 2% 25	9 103 000	9 808 605 €
THERMO FISH 2,95%26	2 150 000	1 912 639 €
THERMO FISH,1,375%28	1 560 000	1 524 451 €
THERMO FISH3,3%02/22	2 350 000	2 243 620 €
THERMO FISHE 0,75%24	11 389 000	11 121 694 €
THERMO FISHER 3% 23	370 000	346 980 €
THYSS 1,375 030322	12 813 000	12 615 622 €

THYSSENKR 3,125% 19	2 000 000	2 133 448 €
TIME WAR 3,6% 25	1 695 000	1 574 557 €
TIME WARN 6,75%2018	605	607 582 €
TIME WARNER7,57%24	750	870 890 €
TIME WARNR 2,95% 26	4 000 000	3 498 950 €
TIME WARNR 3,80 27	3 310 000	3 091 603 €
TIME WARNR 4 22	1 300 000	1 278 534 €
TIME WARNR 4,75% 21	3 100 000	3 111 164 €
TJX COS 2,25% 2026	5 240 000	4 497 420 €
TMCC 2 24/10/18	6 575 000	6 232 369 €
T-MOBILE 6500 150126	1 000 000	1 032 728 €
T-NOTE 0,875 19	2 000 000	1 859 866 €
T-NOTE 1,875 22	855 000	799 288 €
TOBACC FIN 2,05 18	2 225 000	2 089 270 €
TOBACC FIN 2,25% 21	13 458 000	14 361 227 €
TOBACC FIN 4,50 18	1 860	2 025 707 €
TOLL B FIN 4,375 423	3 500 000	3 363 834 €
TORONTO 0375 120121	1 017 000	1 032 706 €
TORONTO 1450 060918	3 500 000	3 266 213 €
TORONTO BK 2,5% 20	4 000 000	3 795 571 €
TORONTO DM 1,80 21	5 125 000	4 678 698 €
TORONTO DO 3,625% 31	2 875 000	2 635 371 €
TOTAL CAN 2,125% 29	2 300 000	2 513 144 €
TOTAL CAP 1,375% 25	11 000 000	11 464 660 €
TOTAL CAP 2,875% 25	500 000	586 651 €
TOTAL CAP 5,125% 24	1 800 000	2 352 147 €
TOTAL CAPI 0,75%28	7 000 000	6 667 012 €
TOTAL CAPIT 0,25% 23	3 400 000	3 344 308 €
TOTAL S,A, 2,708% 49	9 500 000	9 567 255 €
TOTAL S,A, 3,369%26	4 361 000	4 387 228 €
TOTAL SA 2,25% 49	25 060 000	25 173 961 €
TOTAL SA 2,625% 49	8 600 000	8 259 606 €
TOTAL SA 3,875% 22	2 830 000	3 100 403 €
TOTAL SYSTE 3,8 0421	5 225 000	5 044 453 €
TOYOTA MTR 1,25% 17	570 000	532 663 €
TOYOTA MTR 1,375% 18	797 000	747 004 €
TOYOTA MTR 2,15%0320	1 750 000	1 642 671 €
TR INFR 2,2 05/08/25	4 300 000	4 607 711 €
TRANS CAN 4,875%26	3 100 000	3 240 844 €
TRANSC 5300 150377	4 986 000	4 610 859 €
TRANSCANADA 5,875%76	990 000	982 197 €
TRANSURBA 3,375 0327	2 725 000	2 450 064 €
TREEHOUSE 4,875% 22	2 750 000	2 642 032 €
TRINITY A 2,12512 22	4 874 000	5 135 480 €
TRINITY ACQ 3,5% 21	1 735 000	1 645 804 €
TWARN CABL 4% 21	6 000 000	5 824 961 €
TWARN CABL 4,125%21	1 500 000	1 465 120 €
TYCO ELECTR 1,1% 23	8 131 000	8 226 715 €
TYSON FOODS 2,65% 19	3 300 000	3 122 714 €
UA 2014 1 4% 0426	1 250 000	1 125 004 €
UBIIM 2,75% 13-2017	4 744 000	4 869 487 €
UBS AG 4,75% 2026	10 100 000	11 153 239 €
UBS AG LD 1,125% 20	6 600 000	6 871 989 €
UBS AG LOND 1,25% 21	9 210 000	9 672 356 €
UBS AG STA 2,35% 20	5 000 000	4 683 266 €
UBS GRO F 3,491 0523	1 875 000	1 763 984 €
UBS GROUP 1,75% 22	12 230 000	12 894 388 €
UBS GROUP FUNDIN	18 396 000	17 660 614 €
UBS JERSEY 7,152% 17	3 650 000	4 031 570 €
UBS STAMFORD 1,80%18	405 000	378 940 €
UDR 4,25%11-2018	3 400	3 307 395 €
UDR 4,625% 01/2022	2 000 000	2 006 395 €
UNDER AR 3250 150626	1 725 000	1 481 528 €
UNI ROD 1,375 090326	937 000	945 505 €
UNIB R 1,5 220228	975 000	976 858 €
UNIBAIL-RODAM 2,5%24	6 000 000	6 688 263 €
UNICEM 6,25 09/18	1 500 000	1 679 808 €

UNICREDIT 1,5% 19	3 200 000	3 321 828 €
UNICREDIT 2,125% 26	12 674 000	12 762 613 €
UNICREDIT 3,375% 18	1 000 000	1 032 975 €
UNICREDIT 4,375% 27	1 187 000	1 236 958 €
UNICREDIT 5,75%2025	4 000 000	4 409 762 €
UNICREDIT 6,7%0618	9 000	10 091 783 €
UNICREDIT 6,95% 22	2 350 000	2 828 986 €
UNICREDIT SPA 2% 23	3 761 000	3 869 091 €
UNICREDITO 3,25% 21	11 105 000	12 204 177 €
UNILEVER N 0,375 223	13 809 000	13 684 428 €
UNILEVER NV 1 0227	3 938 000	3 887 699 €
UNION PAC 4% 21	3 000 000	2 987 746 €
UNIONE BCHE 2,875%19	3 600 000	3 786 560 €
UNIT TECH 1,125% 21	1 780 000	1 847 540 €
UNITED PARC 2,45% 22	1 850 000	1 731 173 €
UNITED REN 4,625 723	4 000 000	3 879 044 €
UNITEDHEALTH 3,10%26	1 125 000	1 042 285 €
UNITEDHEALTH 3,75%25	4 825 000	4 736 008 €
UNITYMEDHN 4 25	4 213 000	4 412 308 €
UNITYMEDHN 5,50% 22	1 000 000	846 379 €
URENCO FIN, 2,25% 22	5 000 000	5 440 755 €
US AIR 3,95%13-2025	10 000 000	8 144 135 €
US BANCORP	1 545 000	1 480 091 €
US BANCORP 1,95% 18	3 300 000	3 120 717 €
US BANCORP 2,20%19	2 580 000	2 451 833 €
US BANCORP 2,95 22	3 200 000	3 035 102 €
US BANCORP 3,10% 26	1 050 000	975 552 €
US BANK NA 1,4% 19	4 420 000	4 119 823 €
US TREA 1875 0322	1 275 000	1 189 695 €
US TREAS 0,75% 19	1 000 000	922 735 €
US TREAS 2000 151126	2 847 000	2 592 887 €
US TREAS 2875 151146	1 800 000	1 654 196 €
USTREASURY 2250 0227	29 525 000	27 349 273 €
UTD HEALTH 2,87 22	5 000 000	4 759 559 €
UTD HEALTH 2,875% 23	1 500 000	1 407 406 €
VALEO SA 0625 110123	8 500 000	8 440 964 €
VALEO SA 1625 0326	8 600 000	8 790 126 €
VALEO SA 3,25% 24	4 100 000	4 743 325 €
VALERO ENE 3,65% 25	3 080 000	2 856 643 €
VALIDUS HLDGS	3 435 000	4 505 791 €
VEOLIA ENV 0,67 22	2 200 000	2 208 053 €
VEOLIA ENVR 0,314 23	11 100 000	10 706 009 €
VEOLIA ENVRNMT	11 900 000	12 064 312 €
VEOLIA ENVT 4,45%49	6 800 000	7 333 576 €
VEREIT OP 4,87 26	3 600 000	3 565 471 €
VERISK A 4,125 08/22	3 500 000	3 418 797 €
VERISK ANAL 4% 25	1 900 000	1 824 363 €
VERIZON 4,125 27	2 785 000	2 651 985 €
VERIZON 4,5% 0920	5 500 000	5 487 453 €
VERIZON COM 0,50% 22	12 448 000	12 363 051 €
VERIZON COM 0,875%25	10 000 000	9 680 960 €
VERIZON COM 1,75% 21	4 000 000	3 587 417 €
VERIZON COM 2,375%22	4 774 000	5 180 060 €
VERIZON COM 2,625%20	3 200 000	3 035 589 €
VERIZON COM 2,625%31	5 127 000	5 436 991 €
VERIZON COM 2,946%22	10 430 000	9 751 508 €
VERIZON COMM 3% 2021	8 375 000	7 960 172 €
VERIZON COMM 3,65%18	1 600 000	1 537 034 €
VERIZON COMM 5,15%23	8 700 000	8 978 770 €
VERIZON COMM INC	13 730 000	12 329 045 €
VESTEDA FI 1,75 19	2 250 000	2 346 646 €
VF 0,625% 16-2023	3 750 000	3 701 339 €
VIACOM 5875 280257	3 310 000	3 153 616 €
VIACOM INC 3,45%26	3 765 000	3 339 960 €
VIACOM INC 3,875% 24	1 700 000	1 582 683 €
VIENNA INSU 5,5% 43	1 900 000	2 247 497 €

VIER GAS T 2,87 25	1 300 000	1 541 038 €
VIER GAS TRANS 2%20	1 620 000	1 745 362 €
VISA INC 2,2% 20	6 500 000	6 137 386 €
VISA INC 2,80 122022	1 000 000	950 842 €
VISA INC 3,15% 12/25	1 500 000	1 422 083 €
VIVENDI 0,75%16-2021	6 000 000	6 087 449 €
VIVENDI 1,125%16-23	4 300 000	4 324 846 €
VODAFONE 0,50% 24	6 450 000	6 212 450 €
VODAFONE 0375 221121	2 650 000	2 627 973 €
VODAFONE 1,60% 2031	6 237 000	5 900 511 €
VODAFONE 2,50% 2022	2 552 000	2 323 834 €
VODAFONE 2,95% 2023	2 350 000	2 166 050 €
VODAFONE GROUP	3 500 000	3 636 986 €
VOLKS IF 3,30% 2033	2 500 000	2 751 366 €
VOLKS IF EI03M 2018	1 940 000	1 940 407 €
VOLKS LEAS 2,625% 24	11 802 000	12 925 496 €
VOLKS LEAS 3,25 %18	27	2 871 524 €
VOLKSW F 1,875 0327	4 400 000	4 437 267 €
VOLKSW INTL 2,5% 22	2 500 000	2 475 123 €
VOLKSW INTL 3,5% 30	1 965 000	1 857 590 €
VOLKSW LEAS 2,375%22	800 000	870 422 €
VOLKSWA 1,125 1023	6 800 000	6 818 950 €
VOLKSWAG 0,5 321	6 900 000	6 906 188 €
VOLKSWAGEN 0,75%20	1 900 000	1 931 978 €
VOLKSWAGEN 2,125% 22	6 650 000	7 083 510 €
VOLKSWAGEN 3,875% 18	11 500 000	12 170 433 €
VOLKSWAGEN 4,625% 26	4 658 000	4 914 976 €
VOLKSWAGEN BK 1,5%19	2 000 000	2 055 272 €
VOLVO CAR 3,25% 21	1 550 000	1 672 989 €
VOLVO T AB 2,375% 17	5 543 000	5 913 993 €
VONOVIA 0875 100622	4 700 000	4 777 558 €
VONOVIA 1,25 16-24	11 100 000	11 163 399 €
VONOVIA FIN 2,25% 23	3 400 000	3 691 582 €
VOYA FIN 3650 0626	1 959 000	1 818 978 €
VRGN EL&PWR 2,95% 26	385 000	353 557 €
VW 3,25% 2019	7 500 000	7 973 246 €
VW FIN SER 0,75% 21	960 000	970 581 €
WACHOVIA BK 6% 11/17	3 100	3 040 650 €
WALBOOTS3,3%11/2021	1 600 000	1 549 315 €
WALG BOOT 3,8%11/24	3 540 000	3 419 891 €
WAL-MART 3,25% 20	1 500 000	1 482 770 €
WAL-MART 3,30% 2024	1 500 000	1 474 912 €
WATSON PHA 3,25%2022	3 871 000	3 642 410 €
WELLCAR HP 5,75 20	3 500	3 439 039 €
WELLPOINT 7%19	3 755	3 849 870 €
Wells Fa 2,625 0822	2 650	2 969 135 €
WELLS FA 2500 0321	2 000 000	1 866 659 €
WELLS FAR 1,625% 25	7 539 000	7 870 500 €
WELLS FAR 1375 1026	1 700 000	1 705 957 €
WELLS FAR 3,5% 03/22	11 100 000	10 754 250 €
WELLS FAR 5,875% 25	2 305 000	2 358 213 €
WELLS FARG 3000 0426	1 500 000	1 362 353 €
WELLS FARGO 1% 2027	6 100 000	5 836 142 €
WELLS FARGO 1,125%21	3 873 000	4 011 210 €
WELLS FARGO 1,5% 18	3 300 000	3 091 030 €
WELLS FARGO 1,5%22	6 236 000	6 562 608 €
WELLS FARGO 2% 26	1 100 000	1 181 517 €
WELLS FARGO 2,15%20	4 700 000	4 413 364 €
WELLS FARGO 2,25% 23	5 685 000	6 287 885 €
WELLS FARGO 2,25%20	5 000 000	5 400 541 €
WELLS FARGO 3% 2026	5 745 000	5 199 497 €
WELLS FARGO 4,10% 26	1 750 000	1 690 908 €
WELLS FARGO 4,6%2021	8 000	8 039 576 €
WELLS FARGO 7,98% 18	3 289 000	3 214 346 €
WENDEL SA 1% 0423	2 700 000	2 647 074 €
WESFARMERS 1,25% 21	6 560 000	6 874 215 €

WESFARMERS 2,75% 22	6 250 000	7 069 118 €
WESTERN GA 5,375% 21	1 610 000	1 644 191 €
WESTERN GAS 4%2022	800 000	773 660 €
WESTP BKGN 1,60 19	5 000 000	4 632 951 €
WESTPAC BANK 2,85%26	3 375 000	3 068 824 €
WFI WSTUKF 3,75 24	2 800 000	2 649 352 €
WHOLE FOODS 5,2%25	1 100 000	1 108 816 €
WILL PART 4,30% 24	2 350 000	2 262 163 €
WILL PART 5,25% 2020	1 141	1 150 491 €
WILLIAMS PAR 3,9%25	6 975 000	6 549 324 €
WILLOW NO,2 3,375%22	6 730 000	7 895 611 €
WLLS FRG CO 3,069 23	6 550 000	6 184 594 €
WOLTERS 1500 0327	2 547 000	2 572 902 €
WOLTERS K 6,375%18	2 600	2 930 082 €
WOLTERS KW 2,87% 23	3 900 000	4 408 812 €
WOODSIDE FIN,3,70%26	2 800 000	2 554 401 €
WPP FINAN 0,75% 19	3 800 000	3 872 609 €
WPP FINANC 3,625%22	3 100 000	2 965 106 €
WPP FINANCE 1,625%30	8 200 000	7 959 672 €
WYNDHAM WORLDWID	6 219 000	5 870 775 €
XEROX 2,75% 19	2 840 000	2 666 761 €
YORKSH BLD 2,125%19	11 473 000	11 921 920 €
YORKSHRE BLD 1,25%22	3 900 000	3 916 710 €
ZF NA CAP 2,75% 23	3 200 000	3 485 687 €
ZF NA CAPIT 4,5 0422	1 900 000	1 884 367 €
ZF NORTH A 2,25% 19	1 500 000	1 585 041 €
ZIMMER BIO 2,425%26	2 576 000	2 697 239 €
ZIMMER BIOM 1,414%22	4 753 000	4 865 644 €
ZIMMER HLDGS 2,70%20	1 850 000	1 741 064 €
ZOETIS 3,25%13-2023	6 000 000	5 690 100 €
ZUERCH KBK 2,625%27	12 800 000	13 283 865 €
ZURICH 7,50%09-2039	100	6 030 109 €

TCN

Encours sous gestion dans la poche	1 676 112 069 €
---	------------------------

Libellé des valeurs	Quantité	Valeur des titres au 31/03/2017
CR01 -0,5% 30/12/16	15 000 000	15 054 458 €
CR01 -0,6% 29/03/17	26 000 000	26 035 512 €
CR01 -0,7% 24/02/17	10 000 000	10 010 528 €
CR01 -0,7% 27/01/17	10 000 000	10 004 952 €
CR01 -0,5% 03/03/17	725 000	728 409 €
CR07 -0,3% 31/03/17	8 500 000	8 512 660 €
CR07 07/04/16	800 000 000	800 044 751 €
CR07 14/11/16	150 000 000	150 328 037 €
CR07 15/04/16	210 000 000	210 024 783 €
CR16 0,02% 07/04/16	250 000 000	250 012 299 €
CR16 -0,2% 22/03/17	3 000 000	3 005 062 €
CR16 -0,3% 20/02/17	15 000 000	15 002 800 €
CR16 -0,3% 21/02/17	20 000 000	19 999 083 €
CR16 -0,3% 24/02/17	1 500 000	1 500 795 €
CR16 -0,3% 27/02/17	6 000 000	6 003 532 €
CR16 -0,3% 31/01/17	7 000 000	7 007 994 €
CR16 -0,4% 08/03/17	20 000 000	20 001 770 €
CR16 -0,4% 21/02/17	15 000 000	15 010 626 €
CR16 -0,5% 31/03/17	7 500 000	7 504 415 €
CR36 07/03/17	100 000 000	100 319 600 €

OPC**Encours sous gestion dans la poche****7 370 924 629 €**

Libellé des valeurs	Quantité	Valeur des titres au 31/03/2017
ABERDEN GL EMERG MKT	18 609 337	162 865 408 €
ACADIAN GLBL EQTY	410 000	7 474 300 €
ALLIANZ EURO HIGH	25 275	54 892 076 €
ALLIANZ GIF GBL EQ I	146 588	14 428 684 €
AMUNDI CASH INSTITUT	124 478	1 244 583 970 €
AVIVA I EMERG, MARKT	75 258	101 893 514 €
AXA WORLD FUNDS	1 371 259	285 444 463 €
BAER LOC,EM,C 3DEC	1 651 178	489 973 099 €
BNP PARIBAS AQUA I	265	9 971 195 €
BNP PARIBAS INVEST3M	161	162 007 385 €
BNPP MOIS	2 541	58 826 485 €
BNY MELLON GL-EMM	82 016 644	120 300 791 €
BRSF SIC	1 269 742	139 041 852 €
CARMIGNAC EMR PATRIM	521 260	64 568 444 €
CIP EM,TOT,OPP A7C	7 299 270	86 569 343 €
COMGEST EMERG 3DEC	7 498 824	254 085 720 €
DIMENSIONAL EMERG	12 292 702	265 399 438 €
FIDELITY FDS EMERG	20 234 951	230 434 954 €
FIDELITY FUNDS HIGH	11 234 616	128 884 799 €
FIRST STATE WORLDW	3 340 000	6 076 796 €
FISHER EMERG MRKTS	1 751 021	220 243 450 €
FRANK TEMP INV EMKT	18 803 141	474 847 203 €
GOLDMAN SACHS N-11SM	6 421 803	54 578 268 €
GROUPAMA CASH 4DEC	4 204	169 997 480 €
HENDERSON GLOBAL	7 900 000	15 041 600 €
HSBC EU,C,H,I	2 254 254	100 798 978 €
HSBC GIF GL	2 439 468	90 236 691 €
JANUS CAP FUND HIGH	723 377	88 099 803 €
JUPITER ECOLOGY CL,I	2 980 000	13 857 888 €
NEUBER BERGMAN	16 762 862	350 757 663 €
PARVEST ENVIRT OPPO	104 000	19 625 840 €
PICTET CLEAN ENERG	245 000	20 455 050 €
PICTET FUND LUX	1 279 148	223 107 836 €
PICTET FUNDS LUX -EM	243 515	96 652 491 €
PICTET WATER CL,I	29 900	9 941 451 €
PIMCO EMERGING	10 756 526	124 405 803 €
PIONEER FUNDS EUR HG	42 120	81 940 374 €
QUONIAM-EM MKT EQUIT	219 608	261 323 022 €
SCHRODER INTL FUND	904 860	144 810 523 €
SCHRODER SICAV	830 000	13 624 616 €
SCHRODERS INTL EMERG	22 818 133	387 559 137 €
SPARINVEST ETHICAL	79 500	13 776 555 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2 182 601	256 043 169 €
SWISSCANTO LU EQ FD	52 000	9 583 080 €
THRE,EUR,H,Y, EUR	21 851 446	61 625 447 €
TOBAM A/B EM MK EQ-A	18 871	165 433 623 €
VONTOBEL NEW POWER I	137 500	14 834 875 €

CAPITAL INVESTISSEMENT**Encours sous gestion dans la poche****406 528 196 €**

Libellé des valeurs	Valeur des titres au 31/03/2017
ANTIN INFRASTRUCT, A	10 632 591 €
AXA SEC, FUND IV LP	41 995 021 €
FPS IMMO DURABLE	23 943 757 €
LP ACCESS CAPITAL PA	102 195 167 €
MERIDIAM TRANSIT A	1 548 687 €
NEUBERGER BERMAN EUR	93 267 879 €
PANTHEON FRR EUROPE	132 945 094 €

FONDS DE PRETS A L'ECONOMIE**Encours sous gestion dans la poche****698 539 288 €**

Libellé des valeurs	Valeur des titres au 31/03/2017
BNPP FPS FPE I PLU	97 135 091 €
CMCIC PR VRN FCT	78 919 963 €
FCT CERIA DETTE	35 112 660 €
FCT IDINVEST 2	76 493 818 €
FCT NOVO 1	76 852 789 €
FCT NOVO 2	39 690 527 €
FCT SP EUROCREANCES	13 922 198 €
IDINVEST FCT 24	42 775 353 €
IDS 3 FCT	102 085 226 €
NOVI 1	33 482 102 €
NOVI 2	64 248 820 €
TIKEHAU CLL EURIB 28	37 820 743 €