

COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FRR
AU 31 MARS 2018

ACTIONS

Encours sous gestion dans la poche **10 214 309 794 €**

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2018	Ratio d'emprise
21ST CENTURY SHS A	19 540	582 934,99 €	0,0019%
3M	17 655	3 151 299,43 €	0,0030%
4IMPRINT GROUP	389 323	6 994 225,22 €	1,3862%
A2A	763 310	1 186 565,40 €	0,0244%
AAC TECHNO HOLD NV	136 523	2 002 813,52 €	0,0112%
AAREAL BANK	90 928	3 522 550,72 €	0,1519%
AARHUSKARLSHAMN AB	65 000	4 651 083,76 €	0,1537%
ABB ADR SPONS.	55 861	1 078 294,21 €	0,0026%
ABB LTD NOM.	45 360	875 077,86 €	0,0021%
ABBOTT LABO.	31 700	1 544 468,02 €	0,0018%
ABBVIE	42 957	3 305 996,71 €	0,0027%
ABC-MART	31 700	1 698 977,52 €	0,0384%
ABERTIS INFRAES.A	811 745	14 789 993,90 €	0,0820%
ABIOMED	2 315	547 743,10 €	0,0052%
ABN AMRO GROUP	826 962	20 235 760,14 €	0,0880%
ACADEMEDIA AB	641 496	3 388 177,62 €	0,6101%
ACCENTURE PLC-CL	1 305	162 879,62 €	0,0002%
ACCESSO TECHNOLOGY	134 544	3 522 054,07 €	0,4979%
ACCIONA	353 318	21 806 786,96 €	0,6170%
ACCOR	1 677	73 536,45 €	0,0006%
ACCSYS TECHNOLOGIE	1 218 531	1 057 684,91 €	1,0927%
ACERINOX	356 300	4 042 223,50 €	0,1291%
ACKERMANS HAAREN	77 181	10 975 138,20 €	0,2304%
ACS ACT.CONSTR.	72 679	2 300 290,35 €	0,0231%
ACTIVISION	134 105	7 355 956,66 €	0,0176%
ADDTECH B	244 935	3 995 153,28 €	0,3770%
ADECCO NOM.	17 500	1 010 444,09 €	0,0102%
ADIDAS NOM.	177 907	34 985 411,55 €	0,0850%
ADIENT PLC	102 786	4 994 504,50 €	0,1101%
ADOBE SYSTEMS	48 681	8 553 067,84 €	0,0099%
ADP (PROMESSE)	159 865	28 296 105,00 €	0,1615%
ADVAN	104 200	788 702,59 €	0,1936%
ADVANCE AUTO PARTS	84 400	8 135 642,56 €	0,1140%
AEGON	5 701 866	31 223 418,22 €	0,2721%
AENA	95 546	15 636 102,90 €	0,0637%
AEON	11 900	172 821,04 €	0,0014%
AERCAP HOLDINGS NV	219 222	9 040 891,03 €	0,1490%
AETNA	6 950	955 035,17 €	0,0021%
AFLAC	4 420	157 270,56 €	0,0006%
AFRICA OIL	2 125 760	1 599 518,43 €	0,4517%
AGEAS	625 805	26 258 777,80 €	0,3082%
AGILENT TECHN.	8 487	461 666,30 €	0,0027%
AHLSSELL AB	1 071 286	5 465 771,43 €	0,2455%
AIA GROUP LTD	584 778	4 022 819,46 €	0,0048%
AIB GROUP PLC	2 022 705	9 895 072,86 €	0,0745%
AIR FRANCE	73 432	661 622,32 €	0,0171%
AIR LIQUIDE	128 268	12 760 100,64 €	0,0300%
AIR LIQUIDE 2020	175 201	17 428 995,48 €	0,0409%

AIRBUS SE	575 950	54 024 110,00 €	0,0742%
AISIN SEIKI	124 200	5 488 577,31 €	0,0421%
AJINOMOTO CO	10 100	148 649,16 €	0,0018%
AKAMAI TECHN.	19 364	1 117 580,78 €	0,0113%
AKKA TECHNOLOGIES	60 817	3 004 359,80 €	0,2997%
AKZO NOBEL	158 656	12 175 261,44 €	0,0627%
ALBEMARLE	19 146	1 443 753,34 €	0,0173%
ALD INTERNATIONAL	446 215	5 894 500,15 €	0,1104%
ALEXANDRIA REAL	2 610	265 042,81 €	0,0025%
ALEXION PHARMA. INC	26 665	2 416 620,64 €	0,0120%
ALFA LAVAL	139 081	2 662 182,98 €	0,0332%
ALIBABA SPON.ADR	87 062	12 992 933,67 €	0,0034%
ALIGN TECHNOLOGY	1 334	272 396,98 €	0,0017%
ALIM.COUCHE SUB.	3 586	130 426,73 €	0,0008%
ALLERGAN PLC	12 404	1 697 336,39 €	0,0037%
ALLIANCE DATA SYS.	1 248	216 001,37 €	0,0023%
ALLIANZ	277 200	50 838 480,00 €	0,0630%
ALLSTATE	145 605	11 223 607,77 €	0,0414%
ALLY FINANCIAL	9 200	203 097,94 €	0,0021%
ALNYLAM PHARM.	22 031	2 133 505,79 €	0,0219%
ALPES (COMPAGNIE)	101 391	2 996 104,05 €	0,4153%
ALPHA FINANCIAL	1 332 227	2 438 946,44 €	1,3079%
ALPHABET CL. A	22 764	19 197 019,94 €	0,0076%
ALPHABET CL. C	28 375	23 805 375,66 €	0,0081%
ALS LTD	273 216	1 264 391,87 €	0,0557%
ALSTOM REGROUPT	1 037 899	37 997 482,39 €	0,4669%
ALTAREA	3 043	625 336,50 €	0,0190%
ALTEN	199 990	15 649 217,50 €	0,5912%
ALTICE CL.A	670 482	4 490 888,44 €	0,0574%
ALTICE CL.B	11 072	74 127,04 €	0,0049%
ALTRAN TECHN.	1 189 097	14 292 945,94 €	0,4626%
ALTRAN TECHN. DS 18	1 011 058	1 375 241,09 €	0,5751%
AMADEUS IT HOLDING	281 971	16 912 620,58 €	0,0643%
AMAZON COM	39 853	46 900 712,31 €	0,0082%
AMBEA AB	521 829	3 044 920,79 €	0,7717%
AMER SPORTS OYJ	221 303	5 548 066,21 €	0,1899%
AMERICAN AIRLINES	80 779	3 412 836,39 €	0,0173%
AMERICAN EXPRESS	277 128	21 019 229,86 €	0,0322%
AMERICAN INTL GRP	87 961	3 892 212,56 €	0,0039%
AMERICAN WATER WKS	220 500	14 725 100,62 €	0,1238%
AMERIPRISE FCIAL	3 850	463 120,71 €	0,0027%
AMERISOURCEBERGEN	4 371	306 398,27 €	0,0020%
AMERISUR RESOURCES	5 784 449	1 017 408,51 €	0,4768%
AMGEN	13 923	1 929 985,80 €	0,0021%
AMP	705 005	2 194 140,36 €	0,0244%
AMPHENOL CL.A	9 267	648 995,17 €	0,0031%
AMS AG	7 000	593 546,74 €	0,0083%
AMUNDI	90 621	5 913 926,46 €	0,0450%
ANADARKO PETROLE.	235 000	11 543 155,67 €	0,0456%
ANALOG DEVICES	6 583	487 790,21 €	0,0018%
ANDEAVOR	42 777	3 497 707,14 €	0,0283%
ANDRITZ AG	160 018	7 264 817,20 €	0,1539%
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €	0,0000%
ANHEUSER BUSCH S	204 274	18 237 582,72 €	0,0101%
ANSELL	19 708	310 489,96 €	0,0139%
ANSYS	2 691	342 848,96 €	0,0032%
ANTHEM INC	42 445	7 582 360,86 €	0,0166%
ANTOFAGASTA	18 671	196 144,53 €	0,0019%
AOI ELECTRONICS	76 600	2 401 170,39 €	0,6383%
AP MOELLER MAERS.B	313	392 362,76 €	0,0031%
APA GROUP ST.SECU.	1 790 038	8 797 517,35 €	0,1517%
APPLE	215 222	29 361 261,27 €	0,0044%
APPLEGREEN	544 010	3 177 018,40 €	0,5935%
APPLIED MATERIALS	91 075	4 118 128,84 €	0,0090%
APPLUS SERVICES	715 317	7 568 053,86 €	0,5002%
APTIV PLC	20 679	1 428 706,45 €	0,0078%

ARCELORMITTAL SA	96 151	2 471 080,70 €	0,0094%
ARCHER DANIELS	396 600	13 985 886,08 €	0,0709%
ARCONIC	89 107	1 669 329,82 €	0,0185%
ARIAKE JAPAN	5 200	338 729,71 €	0,0158%
ARISTA NETWORKS	874	181 430,42 €	0,0012%
ARISTOCRAT LEISURE	74 969	1 124 990,89 €	0,0117%
ARIX BIOSCIENCE PLC	1 121 312	2 506 868,39 €	0,8321%
ARKEMA	92 679	9 823 974,00 €	0,1211%
AROUNDTOWN SA	1 040 716	6 556 510,80 €	0,0988%
ASAHI GLASS	85 000	2 862 695,73 €	0,0366%
ASAHI GROUP HOLDIN L	79 800	3 457 533,97 €	0,0165%
ASAHI INTEC	99 300	3 200 053,06 €	0,0768%
ASAHI KASEI	697 000	7 455 226,54 €	0,0497%
ASCENDAS REAL EST	1 247 703	2 034 760,89 €	0,0426%
ASCENTIAL PLC	1 350 323	6 419 694,60 €	0,3370%
ASCOM HOLDING	287 740	4 959 770,74 €	0,7993%
ASHTREAD GROUP	518 152	11 465 893,47 €	0,1058%
ASM PACIFIC TECHN.	214 561	2 436 311,28 €	0,0531%
ASML HOLDING	61 150	9 793 172,50 €	0,0142%
ASML HOLDING	9 700	1 566 070,66 €	0,0022%
ASOS PLC	111 431	8 846 352,92 €	0,1332%
ASR NEDERLAND	55 151	1 914 842,72 €	0,0375%
ASSA ABLOY AB	66 644	1 166 945,35 €	0,0063%
ASSICURAZ.GEN.ORD.	1 005 308	15 707 937,51 €	0,0642%
ASSOCIATED BRITISH	17 029	483 851,25 €	0,0022%
ASSURANT	1 678	124 719,26 €	0,0027%
ASSYSTEM	47 969	1 335 936,65 €	0,3062%
ASTELLAS PHARMACEUTI	148 400	1 831 250,61 €	0,0075%
ASTRAZENECA	105 285	5 879 123,05 €	0,0083%
ASX	38 806	1 356 824,37 €	0,0200%
AT AND T	633 119	18 352 394,47 €	0,0103%
ATCO LTD CLASS.I	1 419	37 032,18 €	0,0014%
AT-GROUP	49 100	1 052 991,12 €	0,1396%
ATLANTIA	213 417	5 367 437,55 €	0,0258%
ATLAS COPCO AB	10 954	384 143,77 €	0,0013%
ATLAS COPCO S.B	27 922	879 699,90 €	0,0033%
ATOS ORIGIN	332 866	36 981 412,60 €	0,3152%
AUCKLAND INTL ARPT	487 206	1 749 003,24 €	0,0405%
AURELIUS	193 729	10 965 061,40 €	0,6296%
AURIZON HLDGS LTD	586 783	1 548 066,29 €	0,0295%
AURUBIS AG	88 956	6 073 915,68 €	0,1979%
AUS.NZL BKG GROUP	406 392	6 808 051,35 €	0,0140%
AUSNET SERVICES	1 210 528	1 264 623,69 €	0,0335%
AUTODESK INC	4 136	422 327,02 €	0,0019%
AUTOGRILL	110 000	1 149 500,00 €	0,0432%
AUTOLIV SWED.DEPOS	17 006	1 986 282,97 €	0,0195%
AVACTA	607 429	245 964,75 €	0,8805%
AVALONBAY COMMUN.	2 492	333 239,27 €	0,0018%
AVANZA HOLDING BK	270 076	11 542 751,54 €	0,9004%
AVERY DENNISON	3 625	313 173,35 €	0,0041%
AVEVA GROUP PLC	118 425	2 581 386,73 €	0,0735%
AVIATION LATECOERE	58 180	289 445,50 €	0,0616%
AVIVA	676 117	3 824 414,52 €	0,0169%
AVNET	21 423	727 425,69 €	0,0182%
AXA	3 209 142	69 317 467,20 €	0,1323%
AXEL SPRINGER	122 802	8 350 536,00 €	0,1138%
AXWAY SOFTWARE	30 000	540 000,00 €	0,1414%
B&S GROUP SA	282 735	4 156 204,50 €	0,3359%
BAKER HUGUES	7 374	166 504,84 €	0,0018%
BAKKAFROST	100 000	4 443 063,54 €	0,2047%
BAKKAVOR GROUP PLC	1 576 065	3 128 040,49 €	0,2720%
BALL	7 676	247 846,45 €	0,0022%
BALOISE HOLDING	23 251	2 884 411,23 €	0,0476%
BALYO	49 043	305 047,46 €	0,1735%
BANCA GENERALI	249 226	6 529 721,20 €	0,2133%
BANCA POP.EMILIA	389 073	1 762 500,69 €	0,0808%

BANCO BILBAO VIZC.	3 137 675	20 172 112,59 €	0,0471%
BANCO BPM S.P.A	1 631 803	4 596 789,06 €	0,1077%
BANCO SABADELL	3 760 686	6 246 499,45 €	0,0668%
BANDO CHEM.IND.	97 700	910 560,11 €	0,2069%
BANK AMERICA	2 222 262	54 190 053,57 €	0,0219%
BANK IRELAND	1 018 373	7 240 632,03 €	0,0944%
BANK N.Y. MELLON	46 497	1 948 197,27 €	0,0046%
BANK OF EAST ASIA	307 658	997 663,28 €	0,0110%
BANK OF MONTREAL	11 699	718 054,16 €	0,0018%
BANK QUEENSLAND	52 465	358 634,36 €	0,0132%
BANKIA S.A	286 711	1 043 341,33 €	0,0093%
BANKINTER	1 049 521	8 769 797,48 €	0,1168%
BARCLAYS	1 287 910	3 033 573,80 €	0,0075%
BARRATT DEV.	455 513	2 755 835,46 €	0,0450%
BARRICK GOLD	121 526	1 230 208,16 €	0,0104%
BARRY CALLEBAUT N.	104	164 958,82 €	0,0019%
BASF SE	396 999	32 740 507,53 €	0,0432%
BASIC-FIT	321 434	7 553 699,00 €	0,5880%
BASTIDE LE CONFORT	45 412	2 100 305,00 €	0,6186%
BASWARE	127 316	5 563 709,20 €	0,8840%
BAXTER INTL	32 494	1 718 428,88 €	0,0060%
BAYER	486 671	44 671 531,09 €	0,0567%
BAYER.MOTO.PRIV.	100 405	7 645 840,75 €	0,1806%
BB AND T	374 676	15 854 078,98 €	0,0481%
BBA AVIATION	1 167 850	4 268 040,83 €	0,1131%
BCA MARKETPLACE	1 904 572	3 519 341,44 €	0,2388%
BCA MEDIOLANUM	467 264	3 308 229,12 €	0,0631%
BCO ESPIRITO SANTO	3 323 765	- €	0,0591%
BCO SANT.CENT.HISP	10 579 725	56 019 643,89 €	0,0656%
BCP BCO COMERCIAL	1 218 383	331 400,18 €	0,0081%
BE SEMICONDUCTOR	53 694	4 459 286,70 €	0,0671%
BECTON DICKINSON	72 997	12 862 096,92 €	0,0273%
BEIERSDORF NOM.	133 815	12 313 656,30 €	0,0531%
BELC	47 100	2 203 853,30 €	0,2257%
BELIER	30 597	1 808 282,70 €	0,4649%
BELIMO HOLDING	3 752	12 313 390,51 €	0,6101%
BEND.AND ADEL.BANK	28 747	176 424,66 €	0,0059%
BENETEAU	176 668	3 119 956,88 €	0,2134%
BERKELEY UNIT	62 501	2 701 223,78 €	0,0466%
BERKSHIRE HATHAWAY B	79 888	12 957 725,12 €	0,0059%
BERTRANDT	40 000	3 706 000,00 €	0,3944%
BEST BUY	24 820	1 412 490,79 €	0,0088%
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €	0,0000%
BHP BILLITON	88 879	1 563 773,72 €	0,0028%
BIC	134 673	10 888 312,05 €	0,2888%
BIG YELLOW	1 185 046	11 530 104,23 €	0,7469%
BILFINGER BERGER	12 961	479 557,00 €	0,0293%
BIOGEN IDEC	15 439	3 437 416,74 €	0,0073%
BIOMERIEUX	456 194	30 564 998,00 €	0,3854%
BIOTAGE AB	600 000	4 159 324,26 €	0,9272%
BLACKBERRY	11 719	109 459,13 €	0,0022%
BLACKROCK	5 017	2 209 870,50 €	0,0031%
BMW	299 004	26 357 202,60 €	0,0497%
BNP PARIBAS	1 522 695	91 620 558,15 €	0,1218%
BOC AVIATION LTD	264 800	1 279 796,94 €	0,0382%
BOC HKG HOLD.	521 420	2 063 585,59 €	0,0049%
BOEING	81 640	21 765 356,10 €	0,0140%
BOIRON	46 788	3 204 978,00 €	0,2410%
BOLIDEN AB	55 954	1 589 023,52 €	0,0205%
BOLLORE INVEST.	3 494 208	15 129 920,64 €	0,1197%
BOLLORE NV 17	11 333	48 845,23 €	0,3115%
BONDUELLE	160 565	5 515 407,75 €	0,4974%
BONGRAIN	2 721	237 271,20 €	0,0194%
BOOKING HOLDINGS INC	13 614	23 029 173,85 €	0,0283%
BOOZT AB	619 499	4 450 877,55 €	1,0996%
BORG WARNER	66 386	2 711 362,18 €	0,0316%

BOSHIWA INTL	122 000	- €	0,0059%
BOSSARD HOLDING AG	15 910	2 647 839,01 €	0,2392%
BOSTON PROPERTIES	2 824	282 939,61 €	0,0018%
BOSTON SCIENTIFIC	116 843	2 595 561,06 €	0,0085%
BOUYGUES	871 831	35 492 240,01 €	0,2387%
BP	1 324 345	7 239 561,32 €	0,0066%
BP PLC SPONSORED	529 148	17 442 501,05 €	0,0159%
BPOST - PROMESSES	242 567	4 453 530,12 €	0,1213%
BRAMBLES	629 793	3 920 126,07 €	0,0396%
BREMBO SPA	977 795	12 261 549,30 €	0,2928%
BRENNTAG	214 727	10 371 314,10 €	0,1390%
BRIDGESTONE	241 400	8 534 251,63 €	0,0317%
BRIGHTHOUSE FIN INC	1 678	70 129,85 €	0,0014%
BRIGHTOIL PETRO HLD	508 000	- €	0,0050%
BRISTOL MYERS ORD.	32 013	1 646 397,73 €	0,0020%
BRITISH LAND	415 298	3 041 192,15 €	0,0423%
BRITISH SKY BROAD.	77 409	1 145 639,08 €	0,0045%
BROADCOM	32 098	6 150 257,10 €	0,0000%
BROADRIDGE FINL	16 506	1 472 165,83 €	0,0140%
BROOKFIELD ASSET	4 427	140 214,39 €	0,0004%
BROTHER INDUSTRIES	282 500	5 341 373,17 €	0,1077%
BT GROUP	576 345	1 495 591,28 €	0,0058%
BUNZL	24 918	595 451,24 €	0,0074%
BURBERRY GROUP	221 991	4 294 476,28 €	0,0531%
BURCKHARDT COMPRES	3 859	998 746,03 €	0,1135%
BUREAU VERITAS	1 776 327	37 498 262,97 €	0,4019%
BUZZI UNICEM ORD.	243 522	4 629 353,22 €	0,1473%
C. UYEMURA & CO	88 500	5 548 396,32 €	0,8959%
CA	4 955	136 581,29 €	0,0012%
CADENCE DESIGN SYS	7 373	220 437,62 €	0,0026%
CAFE DE CORAL HOLD	684 137	1 389 218,60 €	0,1168%
CAIRN ENERGY	658 401	1 547 058,36 €	0,1117%
CAIRN HOMES LTD	1 434 218	2 595 934,58 €	0,1883%
CALTEX AUSTRALIA	279 983	5 483 185,95 €	0,1074%
CAMECO	40 883	301 929,82 €	0,0103%
CAMPBELL SOUP	29 365	1 034 108,35 €	0,0098%
CAN.NAT.RAILWAY	13 998	831 263,67 €	0,0019%
CANADIAN IMBK COMM	8 872	636 304,14 €	0,0020%
CANADIAN PACIFIC	2 553	365 818,37 €	0,0018%
CANCOM SE	100 916	8 441 623,40 €	0,5759%
CANON	19 300	568 547,39 €	0,0014%
CAP GEMINI	564 279	57 105 034,80 €	0,3343%
CAPITACOMM.REIT	1 868 035	2 119 739,60 €	0,0499%
CAPITAL ONE FCIAL	37 232	2 900 817,37 €	0,0077%
CAPITALAND	684 400	1 515 041,85 €	0,0164%
CAPITAMALL TRST FD	3 572 352	4 607 485,68 €	0,1007%
CARDINAL HEALTH	159 165	8 111 934,14 €	0,0512%
CARGOTEC B	66 898	2 894 007,48 €	0,1212%
CARL ZEISS MEDITEC	60 000	3 111 000,00 €	0,0671%
CARLSBERG PREF.S.B	4 737	458 066,76 €	0,0040%
CARNIVAL	12 445	650 143,72 €	0,0069%
CARREFOUR	1 277 744	21 529 986,40 €	0,1649%
CASINO GUICHARD	430 732	17 147 440,92 €	0,3895%
CATERPILLAR	10 594	1 269 539,96 €	0,0018%
CATHAY PAC.AIRWAYS	218 000	305 806,42 €	0,0055%
CATTOLICA ASSICUR.	27 002	233 567,30 €	0,0155%
CBOE GLOBAL MARKETS	1 881	174 510,79 €	0,0017%
CBRE GP A	7 990	306 775,46 €	0,0024%
CBS CL.B	31 848	1 330 787,26 €	0,0093%
CDW CORP (NEW)	3 002	171 623,06 €	0,0020%
CECONOMY AG	686 521	6 418 971,35 €	0,2118%
CELANESE SER.A	88 340	7 198 074,07 €	0,0650%
CELGENE	14 383	1 043 304,00 €	0,0020%
CELLECTIS	33 000	851 400,00 €	0,0778%
CELLNEX TELECOM	423 340	9 182 244,60 €	0,1827%
CEMEX ADR OPC A-B	196 506	1 057 746,65 €	0,0130%

Cenovus Energy	19 550	135 257,00 €	0,0016%
CENTENE	2 900	252 000,65 €	0,0014%
CENTERPOINT ENERGY	7 617	169 700,21 €	0,0018%
CENTRAL JAP.RAILW.	33 500	5 155 834,09 €	0,0163%
CENTRICA	403 157	653 917,25 €	0,0072%
CENTURY LEAS. SYS.	133 800	6 741 427,68 €	0,1255%
CENTURYTEL	9 913	132 431,26 €	0,0009%
CERNER	5 984	282 206,77 €	0,0018%
CERV INFO SOL	1 203 724	12 193 724,12 €	0,6164%
CFG LTD	223 873	- €	0,0061%
CHALLENGER FCIAL	77 740	559 528,24 €	0,0127%
CHAMPION REIT	2 089 318	1 210 006,75 €	0,0358%
CHARGEURS	191 839	4 550 421,08 €	0,8163%
CHARGEURS	1 847	40 634,00 €	1,5252%
CHARTER CIONS CL A	3 930	994 507,14 €	0,0017%
CHEUNG KONG PROPER	272 634	1 859 975,54 €	0,0074%
CHEVRON CORP	329 273	30 532 416,90 €	0,0172%
CHINA EVERBRIGHT	930 000	1 059 856,51 €	0,0207%
CHINA HIGH PRECIS.	152 000	- €	0,0147%
CHINA MENGNIU	597 437	1 665 006,12 €	0,0152%
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	- €	0,0000%
CHINA MILK PROD TP	239 000	- €	0,0000%
CHINA TRAVEL INTL	3 492 000	1 005 750,99 €	0,0640%
CHNA ANIM HLTH CRE	167 770	- €	0,0085%
CHOCOL.LINDT SPRUN	5	295 066,66 €	0,0037%
CHOCOLAD.LINDT BP	48	241 487,65 €	0,0045%
CHOW TAI FOOK JEWL	1 993 420	1 846 323,38 €	0,0199%
CHR. HANSEN HOLD.	203 265	14 207 279,98 €	0,1542%
CHUBB LTD	27 058	3 009 084,57 €	0,0058%
CI FINANCIAL	8 100	140 993,95 €	0,0030%
CIE AUTOMOTIVE	219 723	6 371 967,00 €	0,1703%
CIGNA	154 705	21 100 310,35 €	0,0636%
CIMIC GROUP LTD	16 180	448 763,28 €	0,0050%
CINCINNATI FCIAL	4 086	246 718,19 €	0,0025%
CINEWORLD GROUP	2 000 000	5 379 263,15 €	0,1459%
CISCO SYSTEMS	1 196 330	41 721 017,76 €	0,0254%
CITIGROUP	390 199	21 415 971,46 €	0,0153%
CITY DEVELOPMENTS	216 698	1 746 805,98 €	0,0238%
CK HUTCHISON	320 835	3 121 179,67 €	0,0083%
CLARIANT NOM.	188 715	3 655 081,22 €	0,0569%
CLARKSON	160 000	5 511 577,51 €	0,5292%
CLEAN HARBORS	20 700	821 536,77 €	0,0368%
CLOETTA	880 688	2 720 793,43 €	0,3113%
CLOROX	3 337	361 172,56 €	0,0026%
CNA HONGXING SPRT	449 000	- €	0,0160%
CNH INDUSTRIAL NV	1 038 731	10 418 471,93 €	0,0765%
CNP ASSURANCES	1 072 857	21 993 568,50 €	0,1563%
COATS GROUP PLC	3 947 065	3 448 673,19 €	0,2768%
COBHAM	231 623	324 700,21 €	0,0097%
COCA COLA EUR	346 369	11 731 234,47 €	0,0714%
COCA-COLA	527 421	18 624 949,40 €	0,0124%
COCA-COLA AMATIL	667 845	3 611 323,88 €	0,0922%
COCA-COLA HBC	96 088	2 886 914,47 €	0,0261%
COCHLEAR	18 188	2 060 251,70 €	0,0316%
COFACE	143 817	1 336 059,93 €	0,0915%
COGNEX	2 994	126 566,70 €	0,0017%
COGNIZANT TECHN.A	12 246	801 563,61 €	0,0021%
COLGATE PALMOLIVE	35 315	2 058 282,88 €	0,0040%
COLRUYT	426 540	19 160 176,80 €	0,2840%
COM HEM HOLDING	277 753	3 645 933,70 €	0,1565%
COMCAST CL.A	630 603	17 520 595,60 €	0,0137%
COMERICA	18 336	1 430 233,35 €	0,0107%
COMFORTDELGRO	1 349 108	1 714 932,35 €	0,0623%
COMMERZBANK NV	2 515 017	26 518 339,25 €	0,2008%
COMPASS GROUP PLC	107 392	1 782 925,25 €	0,0068%
COMPUGROUP MEDICAL	148 264	6 514 720,16 €	0,2786%

COMPUTERSHARE	201 287	2 173 123,75 €	0,0371%
COMSYS HOLDINGS	80 000	1 737 075,44 €	0,0567%
COMW.BK AUSTRALIA	148 262	6 686 515,87 €	0,0084%
CONAGRA FOODS	42 919	1 287 029,08 €	0,0109%
CONCHO RESOURCES	13 797	1 686 468,28 €	0,0093%
CONOCOPHILLIPS	671 685	32 381 350,29 €	0,0574%
CONSOL.EDISON	7 220	457 557,26 €	0,0023%
CONSORT MEDICAL	584 480	7 466 837,01 €	1,1859%
CONSTELLAT SFTWRE	378	208 393,48 €	0,0018%
CONSTELLATION CL.A	12 602	2 335 445,66 €	0,0075%
CONTACT ENERGY	46 658	143 685,18 €	0,0065%
CONTINENTAL	57 548	12 908 016,40 €	0,0288%
CONVATEC GROUP	2 157 358	4 899 395,21 €	0,1100%
COOPER NV	970	180 465,67 €	0,0020%
COSMOS PHARMA.	15 800	2 608 075,03 €	0,0790%
COSTAR GROUP	670	197 581,49 €	0,0018%
COSTCO WHOLESALE	902	138 198,85 €	0,0002%
COTY CL A	14 178	210 966,70 €	0,0019%
COVESTRO AG	325 946	26 049 604,32 €	0,1610%
CRANEWARE	133 414	2 682 128,15 €	0,5004%
CRANSWICK	100 000	3 243 983,12 €	0,1957%
CREATE SD HOLDINGS	112 000	2 368 539,06 €	0,1676%
CREDIT AGRICOLE	1 573 776	20 781 712,08 €	0,0552%
CREDIT AGRICOLE PF	213 503	2 819 307,12 €	0,0000%
CREDIT SUISSE GRP	145 802	1 979 599,20 €	0,0057%
CREST NICHOLSON HG	390 174	2 022 300,29 €	0,1519%
CRH	39 247	1 082 039,79 €	0,0047%
CRH PLC	50 452	1 395 598,68 €	0,0060%
CRITERIA CAIXACORP	2 559 647	9 910 953,19 €	0,0428%
CRODA INTERNATIO PLC	32 185	1 676 982,78 €	0,0244%
CROWN	211 541	1 674 279,03 €	0,0307%
CROWN CASTLE INTER	54 955	4 897 847,34 €	0,0132%
CSL	40 257	3 903 298,23 €	0,0089%
CSR	534 966	1 728 333,73 €	0,1061%
CSX	17 029	771 383,17 €	0,0019%
CTS EVENTIM	471 247	17 935 660,82 €	0,4909%
CUMMINS	29 864	3 935 972,48 €	0,0181%
CVS CAREMARK	207 550	10 498 585,60 €	0,0204%
CVS GROUP	193 278	2 152 799,90 €	0,2748%
CYBERAGENT	29 300	1 185 041,73 €	0,0232%
CYBERDYNE INC	118 900	1 369 043,28 €	0,0866%
DAH SING BANKING	600 661	1 065 380,23 €	0,0428%
DAH SING FINANCIAL	150 058	771 102,78 €	0,0448%
DAI NIPPON PRINT.	44 100	741 099,69 €	0,0136%
DAICEL CHEM.IND.	120 000	1 066 099,47 €	0,0343%
DAIDO METAL	186 500	1 745 302,08 €	0,4148%
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	82 100	1 219 311,12 €	0,0069%
DAIKIN INDUSTRIES	12 500	1 121 510,79 €	0,0043%
DAIKYONISHIKAWA	160 000	2 133 422,23 €	0,2165%
DAIMLERCHRYSLER	641 074	44 214 873,78 €	0,0599%
DAINIPPON PHARM.	81 400	1 111 517,26 €	0,0205%
DAISEKI	52 300	1 167 202,30 €	0,1216%
DAITO TRUST CONST.	1 300	182 782,85 €	0,0017%
DAIWA HOUSE IND.	202 800	6 357 145,61 €	0,0304%
DAIWA SECU.GRP	615 000	3 191 268,29 €	0,0362%
DALATA HOTEL GROUP	908 420	5 632 204,00 €	0,4930%
DANAHER	179 728	14 308 385,97 €	0,0257%
DANSKE BANK	44 967	1 359 748,03 €	0,0050%
DARDEN RESTAURANTS	17 293	1 198 705,74 €	0,0140%
DASSAULT AVIATION	6 114	9 482 814,00 €	0,0736%
DASSAULT SYSTEMES	514 398	56 789 539,20 €	0,1971%
DAVIDE CAMPARI	1 977 293	12 160 351,95 €	0,1702%
DAVITA	4 930	264 328,33 €	0,0028%
DBS GROUP HOLDINGS	179 127	3 054 500,22 €	0,0070%
DCC	20 000	1 496 521,04 €	0,0224%
DE LONGHI	182 705	4 406 844,60 €	0,1222%

DECHRA PHARMACEUT	373 271	11 189 188,88 €	0,3648%
DEERE	4 843	611 631,30 €	0,0015%
DELL TECHNOLOGIE INC	26 231	1 561 468,07 €	0,0132%
DELTA AIR LINES	76 393	3 404 561,80 €	0,0109%
DELTA PLUS GROUP	6 670	333 500,00 €	0,0906%
DENA	60 500	888 110,40 €	0,0401%
DENSO	120 300	5 353 021,21 €	0,0151%
DERICHEBOURG	234 761	1 677 367,35 €	0,1433%
DERWENT LONDON	56 357	1 994 061,98 €	0,0505%
DEU.LUFTHANSA NOM.	391 360	10 151 878,40 €	0,0830%
DEUTSCHE BANK NOM.	1 519 031	17 204 545,10 €	0,0735%
DEUTSCHE BORSE	149 882	16 576 949,20 €	0,0777%
DEUTSCHE POST NOM.	666 508	23 674 364,16 €	0,0540%
DEUTSCHE TELEKOM	2 081 269	27 576 814,25 €	0,0437%
DEUTSCHE WOHN.POR.	380 831	14 433 494,90 €	0,1074%
DEUTZ	568 229	4 233 306,05 €	0,4701%
DEVOTEAM	10 690	919 340,00 €	0,1282%
DEXCOM	12 359	745 248,15 €	0,0140%
DEXUS PTY.UNIT	651 082	3 784 628,59 €	0,0640%
DIA	1 531 142	5 277 846,48 €	0,2460%
DIAGEO	216 227	5 948 893,85 €	0,0088%
DIAMONDBACK ENERGY	25 345	2 607 350,00 €	0,0257%
DIASORIN	75 387	5 510 789,70 €	0,1347%
DIGITAL REALTY TRUST	2 890	247 630,36 €	0,0014%
DIGNITY PLC	335 000	3 341 593,48 €	0,6699%
DIRECT ENERGIE	37 387	1 144 042,20 €	0,0822%
DIRECT LINE INSU GRP	330 781	1 438 654,00 €	0,0241%
DISCOVER FINANCIAL	52 117	3 048 156,93 €	0,0149%
DISCOVERY COM CL A	3 700	64 472,09 €	0,0024%
DISCOVERY COM CL C	3 147	49 948,73 €	0,0009%
DISNEY WALT-DISNEY	182 721	14 922 549,28 €	0,0123%
DNA LTD	156 194	2 753 700,22 €	0,1181%
DOLLAR GENERAL	146 600	11 151 303,00 €	0,0548%
DOLLAR TREE	4 329	334 042,44 €	0,0018%
DOMAIN HOLDINGS	116 091	235 317,15 €	0,0200%
DOMETIC GROUP	680 566	5 038 292,92 €	0,2301%
DOMINOS PIZZA ENT	4 013	104 445,37 €	0,0047%
DOMINO'S PIZZA UK	1 000 000	3 769 818,64 €	0,2094%
DOWA HOLDINGS	146 300	4 261 668,40 €	0,2360%
DOWDUPONT INC	409 151	21 195 276,02 €	0,0176%
DOWNER EDI	253 069	1 011 739,35 €	0,0426%
DSV	12 411	789 715,23 €	0,0066%
DTS	108 600	3 055 540,16 €	0,4306%
DUERR	65 200	5 811 928,00 €	0,1884%
DULUX GROUP	1 093 539	5 033 409,94 €	0,2809%
DUNELM GROUP	603 600	3 628 347,21 €	0,2989%
DXC TECHNOLOGY CIEA	47 960	3 920 330,77 €	0,0168%
E TRADE FINANCIAL	7 800	351 423,34 €	0,0030%
E.ON	3 269 139	29 487 633,78 €	0,1485%
EAGLE INDUSTRY	275 700	3 933 315,26 €	0,5541%
EAST JAPAN RAILWAY	9 000	678 606,26 €	0,0023%
EATON CORP	57 955	3 765 649,51 €	0,0133%
EBAY	62 516	2 045 488,34 €	0,0063%
ECOLAB	11 425	1 273 346,14 €	0,0040%
EDENRED	984 597	27 805 019,28 €	0,4115%
EDF	1 302 209	15 313 977,84 €	0,0445%
EDF PF 20 N	269 457	3 168 814,32 €	0,0092%
EDISON INTL	49 359	2 554 940,80 €	0,0151%
EDP ENERG.PORTUGAL	13 892 847	42 901 111,54 €	0,3799%
EDP RENOVAVEIS	1 711 050	13 619 958,00 €	0,1962%
EDWARDS LIFESCIEN.	4 315	489 514,01 €	0,0020%
EI TOWERS	80 963	3 687 864,65 €	0,2865%
EIFFAGE	181 534	16 788 264,32 €	0,1816%
ELECTROLUX B	63 819	1 626 494,57 €	0,0212%
ELECTRONIC ARTS A	66 636	6 569 052,03 €	0,0217%
ELEKTA S.B	1 315 397	11 373 990,32 €	0,3569%

ELEMENTIS	1 104 700	3 722 235,43 €	0,2381%
ELI LILLY ORD	269 411	16 948 675,91 €	0,0247%
ELIOR	705 041	12 451 024,06 €	0,4007%
ELIS	1 186 152	23 841 655,20 €	0,5407%
ELISA CORP.S.A	193 346	7 109 332,42 €	0,1155%
EMERSON ELECTRIC	11 674	648 318,25 €	0,0019%
EMS CHEMIE HOL.NOM	387	198 149,78 €	0,0017%
ENAGAS	988 102	21 965 507,46 €	0,4139%
ENBRIDGE	29 846	762 714,38 €	0,0018%
ENEL ENERG.ELET.	2 251 223	11 188 578,31 €	0,0221%
ENERGEN CORP	22 766	1 163 614,07 €	0,0234%
ENERGIZER HLDG INC	179 809	8 710 834,83 €	0,3013%
ENI	82 248	1 175 159,42 €	0,0023%
ENTERGY	247 752	15 870 148,85 €	0,1276%
ENTERTAINMENT ONE	1 100 000	3 525 721,46 €	0,2387%
EOG RESOURCES	154 996	13 267 007,29 €	0,0268%
EQUIFAX	2 166	207 485,84 €	0,0018%
EQUINIX INC	5 485	1 864 859,86 €	0,0069%
EQUITABLE CORP	36 664	1 416 356,99 €	0,0138%
EQUITY RESIDENTIAL	12 478	625 193,61 €	0,0034%
ERAMET	5 108	571 074,40 €	0,0192%
ERSTE BANK OSTERR.	293 880	11 990 304,00 €	0,0684%
ESPRIT HOLDINGS	2 662 941	736 621,25 €	0,1411%
ESSENTRA PLC	712 009	3 441 877,65 €	0,2708%
ESSILOR INTL	263 552	28 885 299,20 €	0,1203%
ESSITY AKTIEBOLAG	39 431	882 816,44 €	0,0062%
EURAZEO	190 997	14 277 025,75 €	0,2448%
EUROFINS SCIENT.	51 604	22 138 116,00 €	0,2918%
EURONEXT	72 279	4 293 372,60 €	0,1033%
EUROPCAR GROUP	624 051	5 635 180,53 €	0,3875%
EUTELSAT COMM.PROM	921 209	14 831 464,90 €	0,3958%
EVEREST REINS.GRP	9 462	1 975 875,79 €	0,0231%
EVONIK INDUSTRIES	532 497	15 250 714,08 €	0,1143%
EXEDY	18 400	471 976,85 €	0,0379%
EXELON	51 571	1 635 796,81 €	0,0053%
EXOR NV	5 116	295 295,52 €	0,0021%
EXPEDIA	2 820	253 166,00 €	0,0021%
EXPEDITORS INTL	3 304	170 055,86 €	0,0019%
EXPERIAN	193 930	3 401 019,46 €	0,0211%
EXPRESS SCRIPTS	12 710	713 913,73 €	0,0023%
EXTRA SPACE STORAGE	2 019	143 415,73 €	0,0016%
EXXON MOBIL	49 388	2 996 169,19 €	0,0012%
FACEBOOK CL A	184 102	23 919 712,63 €	0,0077%
FAIRFAX MEDIA	578 937	243 728,74 €	0,0252%
FAROE PETROLEUM	526 703	639 228,92 €	0,1413%
FAST RETAILING	16 300	5 388 695,48 €	0,0154%
FASTENAL	9 823	436 018,68 €	0,0034%
FAURECIA	351 593	23 106 691,96 €	0,2547%
FCC	60 000	1 371 158,05 €	0,1140%
FDM GROUP	293 111	3 410 211,25 €	0,2710%
FE NEW N.V.	29 817	2 908 350,18 €	0,0158%
FEDEX	4 574	893 005,76 €	0,0017%
FERGUSON PLC	36 003	2 198 700,38 €	0,0147%
FERMENTALG	62 678	218 746,22 €	0,3656%
FERROVIAL	453 805	7 698 801,84 €	0,0620%
FIAT CHRYSLER	2 759 394	45 552 692,39 €	0,1780%
FIDELITY NATIONAL	6 939	543 339,19 €	0,0021%
FIELMANN	103 165	6 777 940,50 €	0,1228%
FIFTH THIRD BCP	535 100	13 814 225,31 €	0,0781%
FIGEAC AERO	34 000	557 600,00 €	0,1068%
FINANCIERE ODET	5 073	5 149 095,00 €	0,0770%
FINECOBANK	1 126 854	11 007 109,87 €	0,1852%
FINMECCANICA	427 331	4 007 510,12 €	0,0739%
FIRESTONE DIAMONDS	4 352 694	354 987,59 €	0,8441%
FIRST CAPITAL	2 430	31 187,25 €	0,0010%
FIRST PACIFIC	3 236 366	1 431 716,21 €	0,0745%

FISERV	10 156	588 872,11 €	0,0025%
FISHER PAYKEL HEA.	206 324	1 597 534,49 €	0,0361%
FISHER PLC	275 000	4 930 991,22 €	0,5471%
FLEETCOR TECHN	2 100	345 773,87 €	0,0023%
FLETCHER BUILDING	176 495	624 275,49 €	0,0207%
FLEXTRONICS INTL	89 010	1 181 878,52 €	0,0169%
FLIGHT CENTRE	46 739	1 661 306,40 €	0,0462%
FLIR SYSTEMS	5 562	226 170,36 €	0,0041%
FMC	32 027	1 993 989,01 €	0,0238%
FNAC DARTY	95 928	8 350 532,40 €	0,3598%
FOCUS HOME INT	15 521	619 287,90 €	0,2969%
FONC.DES REGIONS	225 548	20 220 378,20 €	0,3009%
FONC.FIN.PARTICIP.	63 060	6 318 612,00 €	0,2515%
FORD MOTOR	78 429	706 584,80 €	0,0020%
FORTESCUE METALS	760 168	2 052 906,38 €	0,0244%
FORTIS	7 219	198 003,48 €	0,0017%
FORTIVE	33 386	2 104 388,93 €	0,0096%
FOSTER ELECTRIC	112 600	2 237 458,67 €	0,4181%
FOXCONN INTERC TEC	379 000	140 962,99 €	0,0056%
FP	63 800	3 404 759,60 €	0,1441%
FRANCO NEVADA	4 957	274 798,37 €	0,0027%
FRAPORT AG	201 349	16 128 054,90 €	0,2177%
FRASERS CENTREPOIN	149 800	185 775,41 €	0,0051%
FREENET AG	15 791	390 195,61 €	0,0123%
FREEMPORT MCMORAN	25 261	360 886,10 €	0,0017%
FRESENIUS	189 929	11 786 993,74 €	0,0342%
FRESENIUS MED.CARE	157 683	13 084 535,34 €	0,0512%
FST QUANTUM MINE.	12 796	145 988,67 €	0,0019%
FUCHS PETR.ORD.DEM	45 541	1 883 120,35 €	0,0655%
FUCHS PETROLUB PF	13 610	600 201,00 €	0,0196%
FUGRO	81 524	874 752,52 €	0,0964%
FUJI ELECTRIC HOLD	200 000	1 107 079,77 €	0,0268%
FUJI RG REGISTRED	205 700	3 277 497,42 €	0,2103%
FUJIFILM HOLDINGS	7 900	256 398,30 €	0,0015%
FUJIKURA	150 000	828 016,15 €	0,0507%
FUJITSU	477 000	2 388 016,93 €	0,0230%
FUJITSU GENERAL	60 000	872 972,15 €	0,0549%
FUKUI COMPUTER HOL	6 900	124 289,58 €	0,0300%
FUKUOKA FIN.GRP.	442 000	1 936 365,09 €	0,0514%
FURUKAWA ELECTRIC	27 000	1 178 718,84 €	0,0382%
GALAXY	709 698	5 238 776,71 €	0,0164%
GALLIFORD TRY	200 000	1 904 870,54 €	0,1802%
GALLIFORD TRY DS18	66 666	212 917,53 €	0,2403%
GALP ENERGIA CL.B	776 567	11 885 357,95 €	0,0936%
GAMA AVIATION	475 414	1 320 443,81 €	0,7474%
GAMESA CORPORACION	223 479	2 910 813,98 €	0,0328%
GAP	6 446	163 528,24 €	0,0017%
GARMIN	26 842	1 286 172,35 €	0,0142%
GAS NATURAL SDG	740 723	14 362 618,97 €	0,0740%
GAZTRANSPORT TECHN	37 244	1 895 719,60 €	0,1004%
GEA GROUP	131 391	4 539 559,05 €	0,0683%
GEBERIT NOM.	2 033	729 166,34 €	0,0055%
GECINA NOM.	216 717	30 578 768,70 €	0,2873%
GEMALTO	196 466	9 754 536,90 €	0,2173%
GEN.PROPERTY TRUST	1 221 152	3 610 104,14 €	0,0677%
GENERAL ELECTRIC	1 633 262	17 901 672,37 €	0,0188%
GENERAL MILLS	10 870	398 261,74 €	0,0018%
GENERAL MOTORS	50 717	1 498 602,09 €	0,0036%
GENMAB	12 280	2 138 374,03 €	0,0200%
GENTING SINGAPORE	1 648 400	1 103 907,73 €	0,0137%
GENUINE PARTS	3 999	292 125,19 €	0,0027%
GENUS PLC	294 104	7 816 383,26 €	0,4779%
GEORGE WESTON	929	60 769,35 €	0,0007%
GETINGE B	101 044	931 393,23 €	0,0398%
GGP INC	10 420	173 348,94 €	0,0011%
GILEAD SCIENCES	221 199	13 559 533,77 €	0,0170%

GIVAUDAN NOM.	437	807 431,43 €	0,0047%
GJENSIDIGE FORSIKR	90 000	1 338 511,73 €	0,0180%
GK SPARK PLUG	28 700	562 394,23 €	0,0137%
GKN (NEW)	82 927	437 951,42 €	0,0018%
GL EVENTS	48 079	1 175 531,55 €	0,2054%
GLANBIA	201 889	2 826 446,00 €	0,0682%
GLAXOSMITHKLINE	392 403	6 239 418,07 €	0,0079%
GLOBAL PAYMENTS	41 991	3 807 648,34 €	0,0263%
GLORY LTD	33 700	977 804,50 €	0,0491%
GOLDMAN SACHS	28 997	5 938 272,48 €	0,0077%
GOODYEAR TIRE RUB.	41 240	891 295,04 €	0,0172%
GPE BRUXEL.LAMBERT	99 915	9 272 112,00 €	0,0619%
GPE EUROTUN.REGPT	1 259 541	14 610 675,60 €	0,2290%
GRAINCORP	51 231	270 637,46 €	0,0224%
GRAINGER (W.W.)	6 806	1 562 084,50 €	0,0121%
GRANDVISION NV	115 015	2 130 077,80 €	0,0452%
GREAT EAGLE HOLD.	187 464	772 987,36 €	0,0271%
GREAT-WEST LIFECO	9 451	195 981,89 €	0,0010%
GREEN REIT PLC	1 941 165	2 938 923,81 €	0,2796%
GREGGS PLC	452 902	6 348 996,90 €	0,4477%
GRENKELEASING AG	65 424	5 633 006,40 €	0,1476%
GRIFOLS CL.B	586 459	10 134 011,52 €	0,2243%
GRIFOLS CL A	1 060 642	24 405 372,42 €	0,2489%
GROUPE CRIT	13 310	1 163 294,00 €	0,1183%
GROUPE DANONE	627 572	41 250 307,56 €	0,0917%
GROUPE OPEN	12 440	421 716,00 €	0,1452%
GUERBET	80 264	5 193 080,80 €	0,6385%
GUOTAI JUNAN INTER	1 093 002	255 918,00 €	0,0142%
GVC HOLDINGS	600 652	6 296 329,28 €	0,1039%
GYM GROUP PLC	1 200 727	3 115 836,58 €	0,9361%
HAITONG INTERNATIO	592 773	280 657,11 €	0,0105%
HAKUTO	95 400	1 139 304,35 €	0,3952%
HALLIBURTON	45 658	1 742 640,58 €	0,0052%
HALMA	563 991	7 584 640,01 €	0,1486%
HAMAMATSU	110 600	3 399 315,95 €	0,0670%
HAMMERSON	39 541	242 017,81 €	0,0050%
HANESBRANDS	63 087	944 881,52 €	0,0175%
HANG LUNG GROUP	472 000	1 254 298,23 €	0,0347%
HANG LUNG PROPERT.	664 073	1 257 660,59 €	0,0148%
HANG SENG BANK	152 450	2 868 234,87 €	0,0080%
HANNOVER RUCK.NOM.	98 755	10 951 929,50 €	0,0819%
HANWA	21 400	732 996,90 €	0,0506%
HARLEY-DAVIDSON	25 921	903 762,64 €	0,0156%
HARMONIC DRIVE SYS	9 100	425 101,81 €	0,0094%
HARRIS	12 073	1 583 228,39 €	0,0102%
HARTFORD FINANCIAL	33 163	1 389 240,77 €	0,0093%
HARVEY NORMAN	149 972	345 150,27 €	0,0135%
HASBRO	1 651	113 167,70 €	0,0013%
HASEKO	414 700	5 133 236,06 €	0,1379%
HCA HOLDINGS	34 670	2 734 471,68 €	0,0099%
HCP	354 911	6 703 730,16 €	0,0755%
HEALTHSCOPE LTD	674 845	814 435,45 €	0,0388%
HEINEKEN	191 524	16 720 045,20 €	0,0333%
HEINEKEN HOLDING	302 488	25 318 245,60 €	0,1050%
HELMERICH PAYNE	10 978	594 133,98 €	0,0101%
HENDERSON LAND	318 538	1 686 372,79 €	0,0072%
HENKEL PF	148 808	15 900 134,80 €	0,0835%
HENKEL POR	281 375	28 784 662,50 €	0,1083%
HERA	3 364 542	10 006 147,91 €	0,2259%
HERMES INTL	50 777	24 449 125,50 €	0,0481%
HERSHEY FOODS	14 433	1 161 352,75 €	0,0097%
HESS	5 172	212 876,89 €	0,0017%
HEWLETT PACKARD	251 455	4 481 760,86 €	0,0156%
HEWLETT PACKARD ENT	108 064	1 541 198,16 €	0,0071%
HEXAGON B	4 792	230 765,99 €	0,0014%
HI LEX	160 300	3 506 402,22 €	0,4194%

HIKMA PHARMACEUT.	85 033	1 172 149,89 €	0,0352%
HILL & SMITH HLDGS	334 594	5 072 150,40 €	0,4251%
HILTON FOOD GROUP	247 877	2 346 731,04 €	0,3047%
HILTON WORLDWIDE	60 681	3 886 031,27 €	0,0202%
HISCOX	250 000	4 151 933,39 €	0,0869%
HITACHI	2 119 000	12 487 716,04 €	0,0438%
HKG AND CHINA GAS	3 143 281	5 249 521,07 €	0,0204%
HKG EXCHANGES	60 455	1 598 395,81 €	0,0048%
HOCHTIEF	36 211	5 493 208,70 €	0,0563%
HOLLYFRONTIER	12 269	487 428,01 €	0,0069%
HOLOGIC	5 900	179 228,36 €	0,0022%
HOME DEPOT	78 785	11 418 171,65 €	0,0068%
HONDA MOTOR	252 400	7 062 863,09 €	0,0139%
HOPEWELL HOLDINGS	673 000	2 088 254,03 €	0,0774%
HOPEWELLE HIGHWAY	4 875 509	2 419 507,17 €	0,1582%
HOSHIZAKI ELECTRIC	43 600	3 113 463,06 €	0,0602%
HOST HOTELS	13 474	204 216,25 €	0,0018%
HOWDEN	1 073 098	5 640 282,40 €	0,1747%
HOYA	19 600	794 971,96 €	0,0051%
HSBC HOLDINGS	1 189 922	9 031 300,32 €	0,0059%
HUFVUDSTADEN LIB.A	275 000	3 308 090,00 €	0,1355%
HUGO BOSS	82 285	5 822 486,60 €	0,1169%
HUHTAMAKI	536 046	19 104 679,44 €	0,4974%
HUMANA	20 084	4 390 114,01 €	0,0146%
HUTCHISON	11 907 087	610 635,66 €	0,0738%
HUTCHISON PORT HOL	2 852 000	684 099,69 €	0,0327%
HYPO REAL ESTAT.BK	18 977	240 059,05 €	0,0141%
HYPOPORT	7 500	1 023 000,00 €	0,1155%
HYSAN DEVELOPMENT	363 685	1 563 669,35 €	0,0348%
IBERDROLA	5 087 043	30 379 820,79 €	0,0790%
IBM	87 763	10 948 877,58 €	0,0096%
IBSTOCK PLC	1 155 793	3 717 732,70 €	0,2844%
ICA GRUPPEN AB	3 079	88 306,67 €	0,0015%
ICADE	225 387	17 783 034,30 €	0,3041%
ID LOGISTICS	22 464	3 257 280,00 €	0,4002%
IDEX	1 456	168 715,34 €	0,0019%
IG GROUP HOLDINGS	611 822	5 565 507,53 €	0,1663%
IGM FINANCIAL	1 578	37 489,44 €	0,0007%
IHI	136 700	3 454 222,67 €	0,0884%
IHS MARKIT	10 055	394 400,29 €	0,0025%
IIDA GROUP HOLDING	145 800	2 216 073,99 €	0,0495%
ILIAD	135 464	22 757 952,00 €	0,2296%
ILLINOIS TOOL WRK	9 290	1 183 373,09 €	0,0027%
ILLUMINA	4 432	851 984,75 €	0,0030%
ILUKA RESOURCES	148 616	978 816,20 €	0,0352%
IMA INDUSTRIA	188 533	14 903 533,65 €	0,4802%
IMCD	201 740	10 070 860,80 €	0,3836%
IMERYS	112 123	8 846 504,70 €	0,1407%
IMMOFINANZ	116 638	246 572,73 €	0,0104%
IMPLENIA	75 101	4 830 517,75 €	0,4066%
INABA DENKISANGYO	38 800	1 395 730,94 €	0,1386%
INABATA	206 600	2 552 595,66 €	0,3254%
INCITEC PIVOT	306 502	670 983,89 €	0,0185%
INCYTE	33 552	2 273 357,05 €	0,0158%
INDITEX	311 637	7 924 928,91 €	0,0100%
INDUSTRIVARDEN S.C	3 642	68 580,88 €	0,0022%
INFINEON TECHN.	482 637	10 492 528,38 €	0,0425%
INFOGRAMES REGPT	424 148	299 024,34 €	0,1663%
INFORMA	195 000	1 598 346,07 €	0,0237%
ING GROEP	1 546 064	21 181 076,80 €	0,0398%
INGENICO	308 914	20 351 254,32 €	0,4953%
INGERSOLL-RAND	20 793	1 445 712,43 €	0,0084%
INNOGY SE	76 601	2 946 840,47 €	0,0138%
INPEX HOLDINGS	153 000	1 539 421,94 €	0,0105%
INSUR.AUSTRAL.GRP	422 015	1 968 797,95 €	0,0178%
INTACT FINANCIAL	3 590	219 190,15 €	0,0026%

INTAGE HOLDINGS IN	18 600	167 520,74 €	0,0449%
INTEGRAFIN HLDG	1 600 000	4 690 315,96 €	0,4829%
INTEL	120 973	5 122 798,59 €	0,0026%
INTER PARFUMS	29 000	1 084 600,00 €	0,0742%
INTERCONTINENTALEX	117 416	6 923 615,34 €	0,0203%
INTERPUBLIC GROUP	7 272	136 174,46 €	0,0019%
INTERTEK GROUP	38 104	2 025 375,16 €	0,0236%
INTERTRUST	175 000	2 947 000,00 €	0,1902%
INTESA SA.EPAR.NCV	4 108 264	12 645 236,59 €	0,0259%
INTESA SANPAOLO	5 727 435	16 915 979,27 €	0,0361%
INTL CONSOL.AIRL	768 456	5 394 561,12 €	0,0377%
INTL FLAVORS	2 427	270 179,75 €	0,0031%
INTRUM JUSTITIA	120 801	2 776 144,73 €	0,0918%
INTUIT	45 631	6 431 787,50 €	0,0178%
INTUITIVE SURGICAL	46 745	15 691 131,73 €	0,0413%
INVESCO	43 848	1 141 256,64 €	0,0107%
INVESTEC	20 412	127 962,07 €	0,0030%
INVESTOR SIE B	9 155	328 165,83 €	0,0020%
INWIT	1 222 053	7 857 800,79 €	0,2037%
ION BEAM APPLICAT.	277 156	4 542 586,84 €	0,9241%
IPSEN PROMESSE	382 689	48 276 217,35 €	0,4568%
IPSOS	80 000	2 553 600,00 €	0,1800%
IQVIA HOLDINGS INC	2 882	229 908,54 €	0,0014%
IRISH CONTINENTAL	643 188	3 679 035,36 €	0,3382%
IRISO ELECTR	5 300	264 605,83 €	0,0216%
ISS AS TEMP	13 318	399 504,27 €	0,0072%
ISUZU MOTORS	480 000	5 989 240,38 €	0,0566%
ITOCHU	1 138 600	17 989 410,87 €	0,0685%
J.FRONT RETAILING	150 000	2 074 627,73 €	0,0554%
J.HARD.CHESS UNITS	197 516	2 817 345,51 €	0,0447%
JACANA MINERALS LMTD	8 609	- €	0,0000%
JACQUES BOGART	24 777	209 613,42 €	0,1581%
JACQUET METAL SCE	123 247	3 617 299,45 €	0,5129%
JARDIN.MATHES.HOLD	5 400	270 559,82 €	0,0007%
JARDINE CYCLE	34 717	742 690,21 €	0,0088%
JARDINE STRATEGIC	284 200	8 859 802,41 €	0,0257%
JCDECAUX	359 165	10 150 002,90 €	0,1688%
JERON.MARTINS ESC.	681 507	10 089 711,15 €	0,1083%
JFE HOLDINGS	312 600	5 122 981,81 €	0,0509%
JGC	261 600	4 628 192,84 €	0,1010%
JOHN LAING GRP	1 087 786	3 342 643,41 €	0,2216%
JOHN WOOD CONSO	157 766	971 753,62 €	0,0233%
JOHNSON CTRLS INTL	491 612	14 086 601,52 €	0,0531%
JOHNSON ELECTRIC LTD	451 339	1 377 081,36 €	0,0514%
JOHNSON JOHNSON	303 882	31 664 412,97 €	0,0113%
JOHNSON MATTHEY PL	75 737	2 627 945,19 €	0,0391%
JPMORGAN CHASE	513 859	45 947 940,17 €	0,0151%
JSP	190 100	4 847 170,62 €	0,6052%
JSR	13 600	248 823,82 €	0,0060%
JTC PLC	882 211	3 079 235,38 €	0,8253%
JUMBO	214 767	3 114 121,50 €	0,1578%
JUPITER FUND MANAG	650 000	3 496 521,04 €	0,1420%
JUST EAT	916 555	7 301 494,37 €	0,1347%
JX HOLDING INC 1 SEC	2 214 600	10 899 062,84 €	0,0646%
K S HOLDINGS	220 000	2 474 262,12 €	0,0948%
K&S NOM	315 863	7 403 828,72 €	0,1650%
KAKAKU.COM	31 900	454 130,54 €	0,0151%
KANAMOTO	17 300	468 230,52 €	0,0479%
KANEKA	160 000	1 290 573,65 €	0,0457%
KANSAI PAINT	66 400	1 257 997,37 €	0,0244%
KANSAS CITY SOUTHN	17 553	1 567 831,08 €	0,0171%
KAO	47 100	2 874 011,95 €	0,0095%
KARDEX	45 422	4 990 750,45 €	0,5876%
KAUFMAN ET BROAD	66 000	2 819 520,00 €	0,3019%
KAWASAKI HEAVY	84 800	2 230 307,00 €	0,0508%
KBC BANCASSURANCE	176 787	12 502 376,64 €	0,0422%

KDDI	161 000	3 343 843,46 €	0,0064%
KENMARE RESOURCES	992 982	2 559 757,41 €	0,9060%
KEPPEL	257 400	1 240 155,02 €	0,0142%
KERING	129 882	50 498 121,60 €	0,1029%
KERLINK	32 998	679 758,80 €	0,6488%
KERRY GROUP CL.A	523 739	43 156 093,60 €	0,2971%
KERRY LOGISTIC	1 051 606	1 263 812,02 €	0,0619%
KERRY PROPERTIES	451 120	1 652 163,17 €	0,0311%
KESKO CL.B	67 032	3 121 009,92 €	0,0982%
KEYCORP	122 126	1 941 345,12 €	0,0115%
KEYENCE	7 500	3 786 855,03 €	0,0062%
KH NEOCHEM CO LTD	50 000	1 221 381,17 €	0,1357%
KIKKOMAN	2 700	88 352,31 €	0,0014%
KIMBERLY CLARK	19 991	1 790 144,19 €	0,0057%
KIMCO REALTY	14 439	169 062,57 €	0,0034%
KINDER MORGAN	94 422	1 156 234,76 €	0,0043%
KINPOLIS GROUP NV	54 728	2 949 839,20 €	0,2000%
KINGSPAN GROUP	567 014	19 505 281,60 €	0,3153%
KINTETSU WORLD EXP	110 300	1 684 928,00 €	0,1532%
KION GROUP	73 932	5 599 609,68 €	0,0626%
KIRIN HOLDINGS CO LT	15 100	327 007,13 €	0,0017%
KITZ	150 000	1 048 208,81 €	0,1494%
KIWI PROPERTY	589 995	463 745,48 €	0,0415%
KLA TENCOR	5 181	459 227,39 €	0,0033%
KLEPIERRE	525 933	17 224 305,75 €	0,1673%
KLOCKNER	15 512	158 222,40 €	0,0156%
KOHL S	5 260	280 182,62 €	0,0031%
KOITO MFG	30 400	1 715 300,83 €	0,0189%
KOKUYO	75 000	1 200 164,69 €	0,0583%
KOMATSU	61 400	1 665 098,43 €	0,0063%
KON.BAM GROEP	1 221 381	4 621 705,70 €	0,4381%
KON.BOSKALIS	236 110	5 619 418,00 €	0,1744%
KON.DSM NOM.	259 284	20 908 661,76 €	0,1429%
KON.PHILIPS ELEC.	1 811 857	56 466 523,42 €	0,1906%
KONE B	324 081	13 135 002,93 €	0,0717%
KONECRANES A	97 806	3 446 683,44 €	0,1239%
KONICA	180 800	1 260 676,38 €	0,0360%
KONINK. AHOLD DELHAI	2 321 461	44 669 552,56 €	0,1862%
KONINKLIJKE KPN	5 117 943	12 472 427,09 €	0,1218%
KONINKLIJKE VOPAK	203 343	8 103 218,55 €	0,1591%
KORIAN PROMESSES	501 427	13 789 242,50 €	0,6192%
KOSE	3 500	595 934,62 €	0,0058%
KROGER	740 028	14 405 228,54 €	0,0920%
KRONES HERMANN ORD	35 000	3 829 000,00 €	0,1108%
KUBOTA	90 400	1 286 940,47 €	0,0073%
KUREHA	65 000	3 443 950,84 €	0,3124%
KYB	60 000	2 316 610,29 €	0,2330%
KYOWA EXEO	103 800	2 258 617,04 €	0,0881%
LABORATORY AMERICA	19 036	2 503 616,71 €	0,0186%
LAGARDERE	393 709	9 134 048,80 €	0,3002%
LAM RESEARCH	10 753	1 776 297,50 €	0,0066%
LAND SECURITIES GRP	140 966	1 506 778,13 €	0,0190%
LANXESS	10 559	656 769,80 €	0,0115%
LAR ESPANA REAL ES	314 907	3 070 343,25 €	0,3400%
LAS VEGAS SANDS	21 786	1 273 662,15 €	0,0028%
LAUDER ESTEE CL.A	39 596	4 820 354,62 €	0,0177%
LBRTY BROADBAND CORP	2 912	202 894,08 €	0,0019%
LE NOBLE AGE	26 797	1 516 710,20 €	0,2761%
LEAR CORP	1 654	250 268,62 €	0,0025%
LEG IMMOBILIEN	126 969	11 597 348,46 €	0,2009%
LEGAL GL GROUP	411 705	1 210 648,44 €	0,0069%
LEGRAND PROMESSES	483 196	30 779 585,20 €	0,1807%
LEKOIL LTD	394 486	79 419,16 €	0,0735%
LEM HDG SA REGISTER	6 711	9 060 448,33 €	0,5887%
LEND LEASE	219 568	2 370 488,09 €	0,0380%
LENNAR CL.A	4 783	229 223,09 €	0,0017%

LENNAR CL.B	95	3 683,82 €	0,0003%
LEONI	8 997	467 124,24 €	0,0275%
LEOPALACE21	111 000	752 760,72 €	0,0439%
LI AND FUNG LTD	2 321 512	923 578,03 €	0,0274%
LIBERTY SIRIUS XM C	5 900	195 971,05 €	0,0027%
LIBERTY GLOBAL CL A	11 100	274 645,69 €	0,0019%
LIBERTY GLOBAL INC-A	2 518	64 104,22 €	0,0012%
LIBERTY INTERACT.	8 177	167 349,75 €	0,0018%
LIBERTY LATIN AMC	12 502	194 058,77 €	0,0103%
LIBERTY SERIUSXM A	2 221	74 222,95 €	0,0022%
LINCOLN NATIONAL	5 070	301 186,49 €	0,0023%
LINDE	81 567	13 295 421,00 €	0,5490%
LINDE AG O.N. Z.UMT.	25 197	4 311 206,70 €	0,0147%
LINEDATA SERVICES	82 483	2 598 214,50 €	1,1309%
LION	4 200	68 814,79 €	0,0014%
LISI	186 280	6 091 356,00 €	0,3442%
LIXIL GROUP	56 800	1 031 822,81 €	0,0181%
LKQ	7 600	234 516,40 €	0,0025%
LLOYDS BANKING GRP	455 071	1 376 480,16 €	0,0025%
LLOYDS TSB GROUP	4 290 606	3 164 487,10 €	0,0060%
LOBLAW	4 048	166 173,26 €	0,0011%
L'OCCITANE INTL	1 111 702	1 670 043,67 €	0,0753%
LOEW'S	286 926	11 602 089,67 €	0,0899%
LONDON STOCK EXCH.	54 121	2 547 088,47 €	0,0156%
LONZA GROUP NOM.	4 638	886 879,17 €	0,0062%
LOOMIS	280 000	8 166 411,81 €	0,3897%
L'OREAL PF 20 N	211 308	38 743 321,80 €	0,0376%
LOWES	32 956	2 351 416,03 €	0,0040%
LULULEMON ATHLETIC	21 338	1 546 239,43 €	0,0169%
LUNDBECK	26 745	1 212 028,58 €	0,0134%
LUNDIN PETROLEUM	50 000	1 017 500,42 €	0,0147%
LUXOTTICA GROUP	214 903	10 852 601,50 €	0,0443%
LVMH MOET VUITTON	261 866	65 518 873,20 €	0,0518%
M AND T BANK	3 231	484 341,31 €	0,0022%
MABUCHI MOTOR	25 000	1 001 570,78 €	0,0365%
MACAU LEGEND DEVEL	1 391 000	165 728,20 €	0,0222%
MACQUARIE ATLAS ROAD	399 958	1 441 829,44 €	0,0597%
MACQUARIE GROUP	32 548	2 088 869,68 €	0,0096%
MAEDA	325 000	3 118 440,33 €	0,1642%
MAGELLAN FINANCIAL	13 773	204 788,92 €	0,0078%
MAGNA INTL CL.A	3 729	170 669,48 €	0,0011%
MAISONS DU MONDE	396 980	11 774 426,80 €	0,8775%
MAISONS FRANCE	42 000	2 171 400,00 €	0,6054%
MAKINO MILLING MACHI	200 000	1 526 057,47 €	0,1607%
MAKITA	4 100	163 003,73 €	0,0015%
MAN ORD.	249 872	23 675 372,00 €	0,1772%
MANI	13 000	420 430,36 €	0,0365%
MANITOU BF	42 407	1 463 041,50 €	0,1070%
MANPOWER	2 665	249 413,75 €	0,0040%
MANULIFE FINANCIAL	42 454	640 451,36 €	0,0021%
MAPFRE	354 676	957 979,87 €	0,0115%
MARATHON OIL	15 350	201 321,71 €	0,0018%
MARATHON PETROLEUM	50 059	2 975 821,03 €	0,0108%
MARIE BRIZARD	90 000	796 500,00 €	0,3176%
MARINE HARVEST	18 567	302 287,03 €	0,0038%
MARKS SPENCER GRP	451 291	1 390 884,32 €	0,0278%
MARR	315 724	7 621 577,36 €	0,4746%
MARRIOTT INTL CL.A	6 000	663 397,98 €	0,0017%
MARSHAALLS	750 000	3 577 620,62 €	0,3762%
MARUBENI	446 400	2 627 658,11 €	0,0257%
MARUI GROUP	125 000	2 071 951,77 €	0,0559%
MASTERCARD CL.A	87 704	12 491 143,34 €	0,0085%
MAXIM INTEGRATED	41 941	2 053 654,53 €	0,0150%
MAZDA MOTOR	105 900	1 138 796,30 €	0,0168%
MBB	34 670	3 116 833,00 €	0,5253%
MC CARTHY AND STONE	2 511 469	4 139 469,27 €	0,4674%

MCDONALDS	6 531	830 440,93 €	0,0008%
MCKESSON	22 178	2 540 321,88 €	0,0110%
MEDIASET	166 741	518 897,99 €	0,0141%
MEDIAWAN	243 658	3 131 005,30 €	0,8549%
MEDIAWAN BSA	137 500	137 500,00 €	0,4824%
MEDIBANK	614 212	1 110 933,23 €	0,0223%
MEDICLINIC	18 010	123 463,10 €	0,0024%
MEDIOBANCA	521 837	4 982 499,68 €	0,0589%
MEDTRONIC HOLDINGS	224 572	14 648 262,67 €	0,0166%
MEGGITT	297 889	1 467 189,11 €	0,0384%
MEIJI HOLDINGS	108 400	6 713 123,75 €	0,0710%
MEKONOMEN AB	170 155	2 355 795,33 €	0,4739%
MELCO CROWN ADR	3 901	91 922,58 €	0,0008%
MELCO CROWN ENTER	2	- €	0,0000%
MELCO INTL DEV.	444 571	1 050 140,52 €	0,0289%
MELEXIS	75 000	6 075 000,00 €	0,1856%
MERCADOLIBRE	11 278	3 268 176,13 €	0,0255%
MERCIALYS	43 082	672 510,02 €	0,0468%
MERCK AND CO. NEW	780 389	34 563 392,95 €	0,0290%
MERCK KGAA	289 813	22 576 432,70 €	0,2242%
MERCURY NZ LIMITED	1 725 643	3 259 367,94 €	0,1267%
MERIDIAN ENERGY	2 789 048	4 670 771,97 €	0,1088%
MERLIN ENTERTAINMENT	865 082	3 420 068,68 €	0,0846%
MERLIN PROPERTIES	550 000	6 842 000,00 €	0,1171%
MERSEN	78 951	2 917 239,45 €	0,3826%
METHANEX CORP	34 200	1 686 571,53 €	0,0416%
METLIFE	18 469	689 142,91 €	0,0018%
METRO AG	640 627	9 218 622,53 €	0,1779%
METROPOLE TV	31 000	648 520,00 €	0,0245%
METSO	289 572	7 415 938,92 €	0,1926%
METTLER TOLEDO	655	306 252,51 €	0,0026%
MGI COUTIER	10 883	333 019,80 €	0,0407%
MGM CHINA HOLDINGS	404 314	848 233,16 €	0,0106%
MGM MIRAGE	8 199	233 466,67 €	0,0015%
MICHELIN	338 963	40 641 663,70 €	0,1887%
MICRO FOCUS INTL	20 661	232 557,03 €	0,0047%
MICRO FOCUS PLC	8 217	93 805,49 €	0,0019%
MICROCHIP TECHN.	3 907	290 233,38 €	0,0017%
MICRON TECHNOLOGY	49 838	2 112 902,65 €	0,0043%
MICROSOFT	723 051	53 659 279,41 €	0,0094%
MINEBEA	79 100	1 374 026,67 €	0,0185%
MINTH GROUP	206 000	762 982,72 €	0,0180%
MIRAI INDUSTRY	59 500	1 000 806,23 €	0,2324%
MIRVAC GROUP	3 183 235	4 268 534,79 €	0,0858%
MITSU.UFJ LEASE	238 500	1 137 845,58 €	0,0266%
MITSUB UF J FINA GP	2 675 500	14 257 654,47 €	0,0192%
MITSUB.ELECTRIC	530 300	6 898 647,15 €	0,0247%
MITSUBISHI	634 000	13 872 963,36 €	0,0399%
MITSUBISHI GAS	120 000	2 338 629,55 €	0,0518%
MITSUBOSHI BELTING	128 000	1 151 852,28 €	0,1963%
MITSUI	153 200	2 134 699,04 €	0,0088%
MITSUI CHEMICALS	245 000	6 284 474,39 €	0,1198%
MITSUI FUDOSAN	16 000	315 792,97 €	0,0016%
MITSUI MINING	70 000	2 584 970,09 €	0,1222%
MIURA	87 200	2 236 759,86 €	0,0696%
MIZUHO FCIAL GRP	437 100	639 636,28 €	0,0017%
MOBILEONE	990 060	1 068 211,32 €	0,1070%
MOHAWK INDUSTRIES	1 142	215 632,18 €	0,0015%
MOLSON COORS CL.B	22 642	1 386 853,57 €	0,0116%
MONCLER SPA	336 000	10 382 400,00 €	0,1315%
MONDELEZ INTL	491 723	16 684 636,98 €	0,0333%
MONDI	17 375	379 526,92 €	0,0047%
MONSANTO	10 048	953 369,21 €	0,0023%
MONSTER BEVERAGE	63 751	2 965 560,61 €	0,0113%
MOODY S	1 436	188 337,44 €	0,0007%
MORGAN STANLEY	174 635	7 662 157,66 €	0,0099%

MORI SEIKI	65 000	987 961,65 €	0,0516%
MORITA	74 300	1 144 085,90 €	0,1584%
MOTOROLA SOLTN-ED	144 115	12 339 154,77 €	0,0889%
MPC CONTAINER SHIP	189 319	980 368,70 €	0,2459%
MPC CONTAINER SHIP	189 390	980 736,37 €	1,6118%
MS&AD INSURA GP HOLD	42 200	1 082 468,65 €	0,0071%
MTR	885 028	3 869 375,70 €	0,0147%
MTU AERO ENGINES	130 773	17 889 746,40 €	0,2515%
MUNCHENER RUCKVERS	121 370	22 920 724,50 €	0,0812%
MURATA MFG	61 600	6 861 998,46 €	0,0273%
MUSASHI SEIMITSU I	103 700	2 850 283,14 €	0,3321%
MUSASHINO BANK	72 200	1 851 996,13 €	0,2136%
NABALTEC	81 277	2 056 308,10 €	0,9236%
NAFCO	150 800	2 100 680,80 €	0,5063%
NAKANISHI	375 900	6 225 025,43 €	0,3988%
NAT.AUSTRALIA BANK	337 325	5 993 943,47 €	0,0124%
NATIONAL GRID RG	102 948	941 997,10 €	0,0031%
NATIONAL OILWELL	6 852	205 083,64 €	0,0018%
NATIXIS	2 137 446	14 231 115,46 €	0,0681%
NATUREX	22 561	3 023 174,00 €	0,2360%
NCC GROUP PLC	3 000 000	6 436 637,39 €	1,0805%
NEKTAR THERAPEUT.	1 500	129 601,17 €	0,0009%
NEOPOST	49 074	1 050 183,60 €	0,1420%
NESTE OY	740 447	41 909 300,20 €	0,2888%
NESTLE NOM.	223 908	14 377 110,43 €	0,0072%
NETAPP	54 987	2 758 180,29 €	0,0205%
NETFLIX INC	39 269	9 430 498,96 €	0,0090%
NEURONES	124 446	3 335 152,80 €	0,5133%
NEW WORLD DEV.	1 350 065	1 549 765,10 €	0,0132%
NEWCREST MING	262 805	3 206 078,40 €	0,0342%
NEWELL RUBBERMAID	9 510	197 027,93 €	0,0020%
NEWMONT MINING	46 979	1 492 433,65 €	0,0088%
NEXANS	354 607	14 893 494,00 €	0,8150%
NEXITY	149 125	7 761 956,25 €	0,2657%
NEXON CO LTD	600 800	8 084 495,87 €	0,0676%
NEXT GROUP	9 379	509 121,26 €	0,0067%
NEXTEER AUTOMOTIVE	229 000	280 429,95 €	0,0091%
NEXTERA ENERGY INC	47 478	6 305 306,94 €	0,0101%
NEXUS	115 529	2 934 436,60 €	0,7334%
NGK INSULATORS	54 300	761 394,11 €	0,0166%
NHK SPRING	160 000	1 376 204,13 €	0,0656%
NIBE INDUSTRIER B	505 800	3 880 513,22 €	0,1135%
NIDEC	37 400	4 686 632,59 €	0,0125%
NIFCO	110 800	3 075 082,26 €	0,1031%
NIKE CL.B	26 114	1 410 752,66 €	0,0020%
NIKON	80 000	1 159 681,35 €	0,0200%
NINTENDO	6 300	2 257 112,39 €	0,0044%
NIP.SUISAN KAISHA	254 000	1 071 971,27 €	0,0813%
NIPPON LIGHT METAL	1 000 000	2 178 989,87 €	0,1613%
NIPPON SEIKI	154 800	2 285 407,15 €	0,2542%
NIPPON TELEG.TEL.	262 500	9 834 125,35 €	0,0125%
NISHIO RENT ALL	99 800	2 483 658,53 €	0,3515%
NISSAN MOTOR	43 200	364 639,05 €	0,0010%
NISSHIN FUDOSAN	408 100	2 390 043,01 €	0,8692%
NITTA CORP	114 000	3 447 161,98 €	0,3766%
NN GROUP N.V.	879 049	31 680 925,96 €	0,2627%
NOBLE ENERGY	52 571	1 295 199,66 €	0,0109%
NOBLE GROUP	3 571 761	172 752,13 €	0,2691%
NOHMI BOSAI	60 000	1 044 997,67 €	0,0986%
NOKIA	3 288 817	14 750 344,25 €	0,0584%
NOKIAN RENKAAT	190 738	7 038 232,20 €	0,1387%
NOMURA HOLDINGS	453 600	2 133 881,57 €	0,0124%
NOMURA RL ESTATE	160 000	3 072 910,91 €	0,0833%
NORDEA BANK	206 606	1 787 285,57 €	0,0051%
NORDSTROM	29 772	1 171 901,06 €	0,0178%
NORFOLK SOUTHERN	62 000	6 845 029,88 €	0,0219%

NORMA GROUP AG	82 638	5 024 390,40 €	0,2594%
NORTHROP GRUMMAN	49 030	13 918 244,99 €	0,0281%
NOVARTIS	146 127	9 586 288,55 €	0,0057%
NOVO NORDISK AS	65 905	2 630 364,57 €	0,0034%
NOVOZYMES B NV	180 184	7 551 580,58 €	0,0741%
NSK LTD	175 000	1 907 954,12 €	0,0317%
NTT DOCOMO	57 800	1 200 460,57 €	0,0015%
NUFARM	621 349	3 274 643,12 €	0,1896%
NUTRIEN	42 652	1 638 702,74 €	0,0067%
NVIDIA	35 874	6 755 343,88 €	0,0059%
NVR	65	147 985,53 €	0,0018%
NWS HOLDINGS	1 704 000	2 513 917,48 €	0,0437%
NXP SEMICONDUCTORS	20 460	1 946 432,49 €	0,0059%
O REILLY AUTOMOT.	2 127	427 838,57 €	0,0026%
OAKLEY CAPITAL INV	1 490 592	2 907 394,00 €	0,7278%
OBARA GROUP INC	37 600	1 811 084,64 €	0,1802%
OBAYASHI	50 000	444 972,67 €	0,0069%
OBIC	4 400	297 718,83 €	0,0044%
OBRASCON HUARTE	89 024	308 290,11 €	0,0311%
OC OERLIKON CORP.	176 420	2 524 137,73 €	0,0519%
OCADO GROUP	355 320	2 151 292,99 €	0,0530%
OCCIDENTAL PETROL.	225 530	11 912 370,45 €	0,0295%
OENEO	99 020	1 006 043,20 €	0,1567%
OIL SEARCH	529 969	2 363 350,71 €	0,0348%
OKINAWA CELLULAR	155 700	4 660 480,88 €	0,5695%
OLD MUTUAL	171 765	468 841,85 €	0,0035%
OMNICOM GROUP	4 291	253 548,78 €	0,0019%
OMRON	46 900	2 244 695,98 €	0,0219%
OMV	467 729	22 114 227,12 €	0,1429%
ON THE BEACH GROUP	344 325	2 101 219,06 €	0,2640%
ONCIMMUNE HOLDINGS	543 674	858 889,57 €	0,8822%
ONEOK	6 825	315 875,11 €	0,0017%
ONO PHARMACEUTICAL	157 600	3 969 082,81 €	0,0290%
ONTEX GROUP AIW	42 000	912 240,00 €	0,0510%
OPEN HOUSE CO	65 000	3 279 953,18 €	0,1130%
OPHIR ENERGY PLC	1 308 874	785 294,54 €	0,1851%
ORACLE	417 348	15 525 203,07 €	0,0102%
ORANGE	3 085 485	42 533 410,74 €	0,1160%
OREAL	98 393	18 040 356,55 €	0,0175%
ORICA	286 977	3 178 789,11 €	0,0759%
ORIENT OVERSEAS	204 000	1 500 582,77 €	0,0326%
ORIGIN ENTERPRISES	165 819	887 131,65 €	0,1320%
ORION CL.B	347 107	8 632 551,09 €	0,3333%
ORIX	1 100 100	15 783 055,57 €	0,0831%
ORKLA S.A	38 542	335 862,86 €	0,0038%
ORORA LTD	904 074	1 860 756,67 €	0,0749%
ORPEA	288 979	29 837 081,75 €	0,4474%
ORSTED	12 303	647 005,10 €	0,0029%
OSAKA GAS	81 800	1 313 044,77 €	0,0196%
OSRAM LICHT AG	101 728	6 079 265,28 €	0,0972%
OTSUKA	23 000	942 546,92 €	0,0121%
OVERS.CHINESE BKG	257 700	2 048 560,80 €	0,0062%
OVS	685 387	3 414 598,03 €	0,3019%
OW BUNKER AS	41 498	- €	0,1129%
OWENS CORNING	20 661	1 350 688,62 €	0,0187%
OZ MINERALS	197 907	1 109 666,59 €	0,0663%
P.P.G.INDUSTRIES	6 905	626 578,85 €	0,0028%
PACCAR	6 357	342 027,64 €	0,0018%
PACIFIC INDUSTRIAL	225 000	2 520 173,81 €	0,3672%
PACIFIC METALS	44 900	1 098 516,72 €	0,2293%
PACKAGING AMERICA	2 354	215 713,95 €	0,0025%
PADDY POWER PLC	27 426	2 288 699,70 €	0,0325%
PAL	14 900	335 605,73 €	0,0644%
PALO ALTO NETWORKS	2 000	295 190,47 €	0,0022%
PALTAC	25 000	1 089 494,94 €	0,0393%
PANASONIC	40 000	465 157,00 €	0,0016%

PARGESA HOLDING	1 642	118 092,38 €	0,0021%
PARKER-HANNIFIN	2 480	344 883,03 €	0,0019%
PARQUES REUNIDOS	95 523	1 224 604,86 €	0,1183%
PARROT PROMESSES	47 000	245 340,00 €	0,1558%
PAYCHEX	7 074	354 260,81 €	0,0020%
PAYPAM HOLDING INC	200 216	12 351 415,16 €	0,0169%
PCCW	9 068 440	4 265 401,09 €	0,1175%
PEARSON	349 145	2 982 885,88 €	0,0447%
PEMBINA PPLN INC TR	7 105	180 134,33 €	0,0014%
PEPSICO	14 509	1 287 683,34 €	0,0010%
PERNOD-RICARD	285 443	38 606 165,75 €	0,1075%
PERPETUAL	8 786	255 083,61 €	0,0189%
PERRIGO COMPANY	2 050	138 916,94 €	0,0015%
PERSIMMON	60 580	1 748 230,86 €	0,0195%
PEUGEOT S.A.	1 993 712	38 977 069,60 €	0,2203%
PFIZER	829 611	23 940 232,06 €	0,0142%
PG AND E	17 557	627 132,59 €	0,0034%
PHILLIPS 66	204 002	15 910 779,23 €	0,0438%
PIERRE VACANCES	20 000	727 000,00 €	0,2040%
PINGUELY HAULOTTE	85 758	1 435 588,92 €	0,2734%
PIOLAX	95 000	2 025 007,92 €	0,2420%
PIRELLI & C	89 962	647 726,40 €	0,0090%
PLANT IMPACT	1 297 720	154 684,32 €	1,3718%
PLASTIC OMNIUM	443 173	17 239 429,70 €	0,2935%
PLASTIQUES DU VAL	108 707	1 982 815,68 €	0,4913%
PLATINUM AM	109 638	400 710,19 €	0,0187%
PLAYTECH	588 434	4 918 494,75 €	0,1854%
PNC FIN.SCES GROUP	183 273	22 537 877,40 €	0,0390%
PORR AG	99 468	2 780 130,60 €	0,3419%
PORSHE AUTOMOBILE	265 265	17 905 387,50 €	0,1732%
POSTE ITALIANE	834 871	6 194 742,82 €	0,0639%
POSTNL NV	46 257	140 713,79 €	0,0100%
POWER CORP.CANADA	12 709	235 648,71 €	0,0031%
POWER FINANCIAL	10 259	208 725,62 €	0,0014%
POXEL SA	96 379	585 984,32 €	0,3924%
PRADA	376 925	1 415 579,92 €	0,0147%
PRAXAIR	5 172	606 837,91 €	0,0018%
PRICE T ROWE GROUP	18 855	1 655 302,96 €	0,0078%
PRIMA MEAT PACKERS	712 000	3 320 627,66 €	0,2818%
PRINCIPAL FCIAL	6 860	339 750,86 €	0,0024%
PROACTIS HOLDING	1 397 400	3 108 166,99 €	1,4988%
PROCTER GAMBLE	132 493	8 540 915,59 €	0,0053%
PROGRESSIVE	13 763	681 855,18 €	0,0024%
PROLOGIS	31 718	1 624 520,73 €	0,0060%
PROSEGUR CASH S.A.	2 250 000	5 501 250,00 €	0,1500%
PROSIEBEN NOM.	137 648	3 878 920,64 €	0,0591%
PROTO	16 400	208 770,17 €	0,0783%
PROXIMUS	418 451	10 557 518,73 €	0,1238%
PRUDENTIAL	65 625	1 331 288,50 €	0,0025%
PRUDENTIAL FCIAL	9 301	783 118,71 €	0,0022%
PRYSMIAN	174 474	4 449 087,00 €	0,0741%
PUBLIC SCE ENT.	9 181	375 048,53 €	0,0018%
PUBLICIS GROUPE	386 044	21 842 369,52 €	0,1672%
PULTE GROUP INC	9 100	218 204,66 €	0,0032%
PUMA R.RUDOLF ECH.	15 333	6 079 534,50 €	0,1017%
PVH	12 239	1 506 973,83 €	0,0159%
QANTAS AIRWAYS	14 282	51 931,31 €	0,0008%
QBE INS.GROUP	239 946	1 441 157,56 €	0,0177%
QIAGEN N.V	306 885	8 055 731,25 €	0,1350%
QUALCOMM	271 225	12 219 845,72 €	0,0183%
QUEST DIAGNOSTICS	1 928	157 237,39 €	0,0014%
RAIFFEIS.INTL BK	251 130	7 933 196,70 €	0,0763%
RAISIO YHTYMAE V	640 000	2 316 800,00 €	0,4813%
RALPH LAUREN A	2 168	197 082,90 €	0,0039%
RAMSAY HEALTH CARE	83 976	3 264 031,13 €	0,0416%
RANDGOLD RESOURCES	17 432	1 169 556,57 €	0,0185%

RANDSTAD PROV.DIV.	79 456	4 244 539,52 €	0,0433%
RATHBONE BROTHERS	104 991	2 922 071,86 €	0,2042%
RATIONAL	26 611	13 598 221,00 €	0,2340%
RAYMOND JAMES FIN.	3 317	241 145,64 €	0,0023%
RAYSEARCH LABS B	250 000	2 985 509,36 €	0,9679%
REAL GOLD MINING LTD	90 500	- €	0,0100%
REALESTATE.COM.AU	23 540	1 162 942,21 €	0,0179%
RECKITT BENCKISER	43 568	2 998 623,38 €	0,0062%
RECORDATI IND.CHI.	381 476	11 436 650,48 €	0,1824%
RECRUIT HOLDINGS	88 000	1 779 248,45 €	0,0052%
RED ELECTRICA CORPOR	1 259 266	21 067 520,18 €	0,2327%
RED HAT	45 385	5 517 348,74 €	0,0255%
REGENCY CENTERS	1 891	90 686,82 €	0,0011%
REGENERON PHARM.	317	88 760,52 €	0,0003%
REGENERESIS	572 378	447 221,32 €	0,8945%
REGIONS FINANCIAL	1 251 337	18 904 615,58 €	0,1114%
REINSU GRP AMERICA	1 494	187 076,47 €	0,0023%
RELO HOLDINGS	84 500	1 903 267,38 €	0,0552%
RELX N.V.	952 117	16 024 129,11 €	0,0952%
RELX PLC	71 310	1 191 618,00 €	0,0068%
REMY COINTREAU	89 994	10 421 305,20 €	0,1792%
RENAISSANCE RE HLD	978	110 145,77 €	0,0024%
RENAULT	323 048	31 820 228,00 €	0,1092%
RENESAS ELECTRO	266 000	2 176 084,55 €	0,0160%
RENISHAW PLC	196 730	10 111 387,93 €	0,2703%
REPSOL YPF	1 227 249	17 690 794,34 €	0,0788%
REPUBLIC SCES	24 995	1 346 033,13 €	0,0076%
RESONA HOLDINGS	840 300	3 610 613,75 €	0,0362%
RESTAURANT BRANDS	35 600	1 647 641,58 €	0,0143%
REXEL PROMESSES	1 375 554	18 913 867,50 €	0,4526%
REZIDOR HOTEL	898 977	2 042 385,67 €	0,5155%
RHEINMETALL ORD.	4 912	566 599,20 €	0,0113%
RIGHTMOVE	225 000	11 156 324,85 €	0,2480%
RINNAI	22 100	1 706 569,58 €	0,0428%
RIO TINTO	1 138	51 599,84 €	0,0003%
RIZAP GROUP	36 800	447 920,80 €	0,0144%
RM2 INTERNATIONAL	2 319 568	46 301,40 €	0,0478%
ROBERTET	4 058	2 029 000,00 €	0,1878%
ROCHE HOLDING BJ	45 976	8 553 402,06 €	0,0065%
ROCKWELL AUTOMAT.	21 502	3 045 614,02 €	0,0171%
ROCKWELL COLLINS	3 467	380 147,94 €	0,0021%
ROGERS CIONS CL.B	33 357	1 210 495,57 €	0,0083%
ROHM	7 200	557 637,91 €	0,0065%
ROLLS ROYCE HOLDIN	124 862	1 241 356,45 €	0,0067%
ROPER TECHNOLOGIES	13 828	3 155 979,44 €	0,0134%
ROSS STORES	101 970	6 465 520,67 €	0,0269%
ROTHSCHILD & CO	42 246	1 263 155,40 €	0,0545%
ROTORK PLC	2 796 810	9 069 614,27 €	0,3213%
ROYAL BANK CANADA	46 633	2 926 914,83 €	0,0032%
ROYAL BK SCOT. GRP	643 796	1 900 472,27 €	0,0054%
ROYAL CARIBBEAN	3 121	298 789,72 €	0,0015%
ROYAL DUTCH SHELL	207 344	5 282 340,88 €	0,0045%
ROYAL DUTCH SHELL	248 848	6 463 178,93 €	0,0066%
ROYAL DUTCH SHELL	91 788	4 762 363,12 €	0,0040%
ROYAL MAIL PLC	120 606	743 968,58 €	0,0121%
ROYAL UNIBREW	102 261	5 490 320,93 €	0,2005%
RPS GROUP PLC	1 437 800	4 182 034,90 €	0,6381%
RTL GROUP	155 273	10 442 109,25 €	0,1003%
RUBIS	384 527	22 552 508,55 €	0,4039%
RYANAIR HOLDINGS	91 972	1 471 552,00 €	0,0079%
RYMAN HEALTHCARE G	37 273	231 535,12 €	0,0075%
RYOHIN KEIKAKU	2 100	573 189,02 €	0,0075%
S AND P GLOBAL INC.	37 627	5 845 440,19 €	0,0150%
SA SA INTERNATIONAL	2 091 209	879 619,63 €	0,0688%
SAFESTORE HOLDING	1 324 428	7 417 521,93 €	0,6306%
SAFEWAY PDC LLC CVR	60 198	- €	0,0000%

SAFRAN	345 223	29 682 273,54 €	0,0828%
SAINSBURY	77 534	211 191,05 €	0,0035%
SAINT MARC HOLDINGS	60 400	1 422 322,26 €	0,2652%
SAINT-GOBAIN	613 682	26 302 410,52 €	0,1109%
SAIPEM	1 497 335	4 764 519,97 €	0,1481%
SAKATA INKS	16 000	190 588,98 €	0,0256%
SAKATA SEED	8 900	256 191,87 €	0,0184%
SALESFORCE.COM	106 760	10 095 692,98 €	0,0144%
SALVATORE FERRAGAM	233 757	5 240 831,94 €	0,1385%
SALZGITTER	40 435	1 679 669,90 €	0,0673%
SAMPO A	285 643	12 928 202,18 €	0,0515%
SAMSONITE INTL SA	574 690	2 125 559,64 €	0,0403%
SAN A	45 700	2 141 840,01 €	0,1429%
SAN.AV.ADR SPONS.	205 500	6 697 109,40 €	0,0082%
SANDS CHINA	353 142	1 543 950,10 €	0,0044%
SANDVIK	159 942	2 367 354,35 €	0,0128%
SANKYU	111 500	4 492 580,16 €	0,1710%
SANOFI AVENTIS	1 723 931	112 624 412,23 €	0,1380%
SANTOS	43 719	138 245,13 €	0,0021%
SAP SYSTEME ORD.	396 853	33 720 599,41 €	0,0323%
SARTORIUS PRIV.	104 290	11 836 915,00 €	0,2786%
SARTORIUS STEDIM BIO	346 601	25 457 843,45 €	0,3760%
SATO HOLDINGS	41 700	1 072 831,40 €	0,1194%
SAVANNAH PETROLEUM	4 633 082	1 498 207,77 €	0,5671%
SBA COMMUNICATIONS	2 844	395 248,59 €	0,0025%
SBI	316 300	5 883 715,34 €	0,1409%
SCANDI STANDARD	608 950	3 393 648,39 €	0,9218%
SCHAEFFLER PREF.	22 241	278 790,94 €	0,0134%
SCHEIN HENRY	250 850	13 708 686,83 €	0,1629%
SCHIBSTED CLASS A	121 786	2 762 273,73 €	0,1128%
SCHIBSTED CLASS B	129 191	2 657 276,43 €	0,0989%
SCHINDLER HOLD.BP	1 926	336 890,55 €	0,0047%
SCHINDLER HOLD.NOM	1 614	274 093,57 €	0,0024%
SCHLUMBERGER ORD	264 604	13 937 510,36 €	0,0191%
SCHNEIDER ELECTRIC	983 470	70 160 749,80 €	0,1711%
SCHOELLER BLECKM.	31 687	2 831 233,45 €	0,1980%
SCHROEDERS	40 000	1 456 370,48 €	0,0177%
SCHWAB CHARLES	246 695	10 474 783,83 €	0,0183%
SCOR REGPT	621 512	20 671 489,12 €	0,3230%
SCOTT.SOUTH.ENERGY	19 487	283 625,09 €	0,0019%
SCOUT 24	148 277	5 610 801,68 €	0,1378%
SEAGATE TECHNOLOGIE	5 442	258 946,90 €	0,0019%
SEALED AIR	37 487	1 304 279,98 €	0,0233%
SEB	147 075	22 826 040,00 €	0,2932%
SEB PRIM FID 2020	42 819	6 645 508,80 €	0,0000%
SEEK	35 560	412 521,28 €	0,0101%
SEGRO NV09	86 593	593 814,44 €	0,0086%
SEIBU HOLDINGS INC	58 400	826 921,31 €	0,0171%
SEKISUI CHEMICAL	136 100	1 931 285,37 €	0,0276%
SEKISUI HOUSE	135 900	2 017 804,26 €	0,0197%
SEMBCORP MARINE	273 597	381 715,91 €	0,0131%
SEMICONDUCTOR MANUF	1 205 300	1 281 191,22 €	0,0244%
SEMPRA ENERGY	36 898	3 336 826,08 €	0,0140%
SERIA	11 000	452 465,34 €	0,0145%
SERVICENOW	63 247	8 508 530,43 €	0,0358%
SES GLOBAL FDR	1 093 265	12 009 516,03 €	0,2851%
SEVERN TRENT	54 162	1 139 212,13 €	0,0229%
SGS NOM.	358	713 750,53 €	0,0047%
SHAFTESBURY	907 387	10 163 728,00 €	0,2953%
SHANGRI LA ASIA	538 269	881 105,46 €	0,0150%
SHAW CIONS CL.B	68 805	1 077 030,84 €	0,0143%
SHERWIN-WILLIAMS	7 246	2 310 282,98 €	0,0077%
SHIKOKU CHEMICALS	204 000	2 450 285,58 €	0,3461%
SHIMA SEIKI MFG	20 100	1 135 666,59 €	0,0549%
SHIMANO	11 800	1 383 941,46 €	0,0127%
SHIN-ETSU CHEMICAL	123 600	10 399 653,50 €	0,0289%

SHINSEI BANK	101 200	1 265 826,44 €	0,0391%
SHIONOGI	144 300	6 057 984,07 €	0,0445%
SHIRE	59 663	2 429 870,44 €	0,0065%
SHISEIDO	7 100	369 834,22 €	0,0018%
SHIZUOKA GAS	18 300	133 897,78 €	0,0240%
SHOP APOTHEKE EUR	61 957	2 366 757,40 €	0,5154%
SHOPIFY A	19 776	2 003 408,42 €	0,0213%
SHOWA DENKO KK	50 000	1 720 255,16 €	0,0334%
SHUI ON LAND	4 123 721	909 997,74 €	0,0511%
SHUN TAK HOLDINGS	390 474	131 071,59 €	0,0129%
SIA ENGINEERING	579 730	1 143 139,70 €	0,0518%
SIEMENS	534 024	55 282 164,48 €	0,0628%
SIIX	124 200	2 230 565,42 €	0,2464%
SIKA POR.	1 352	8 592 782,54 €	0,0628%
SIMCORP	321 345	18 097 750,33 €	0,7897%
SIMPLYBIZ GROUP	1 646 461	3 192 635,68 €	2,1531%
SIMS	286 016	2 575 901,11 €	0,1411%
SINGAPORE AIRPORT	632 307	2 011 369,08 €	0,0567%
SINGAPORE EXCHANGE	389 757	1 781 180,06 €	0,0364%
SINGAPORE POST	2 633 320	2 237 023,87 €	0,1163%
SINGAPORE PRESS	1 428 854	2 232 722,82 €	0,0894%
SINGAPORE TECHN.	478 900	1 066 069,94 €	0,0153%
SINGAPORE TELECOM.	1 482 325	3 097 560,15 €	0,0091%
SINO LAND	1 351 200	1 777 848,69 €	0,0205%
SINTOKOGIO	12 100	102 502,74 €	0,0222%
SJM HLDGS LTD	1 367 749	966 411,79 €	0,0242%
SK KAKEN	25 000	2 140 761,98 €	0,1595%
SKANDINAV. ENSK. A	319 580	2 713 082,86 €	0,0147%
SKANSKA S.B	26 164	433 494,66 €	0,0065%
SKF S.B LIBRE	18 784	310 946,58 €	0,0045%
SKY CITY ENTERT.	73 719	168 643,89 €	0,0108%
SL GREEN REALTY	13 169	1 036 837,23 €	0,0149%
SLIGRO FOOD GROUP	87 071	3 865 952,40 €	0,1967%
SMC	26 600	8 759 248,76 €	0,0395%
SMCP SAS	76 402	1 508 939,50 €	0,1044%
SMITH NEPHEW	199 019	3 021 492,97 €	0,0228%
SMITHS GROUP	26 397	455 707,31 €	0,0067%
SMS CO	9 200	318 988,83 €	0,0212%
SMUCKER	11 137	1 122 981,97 €	0,0098%
SNAM RETE GAS	8 015 072	29 920 263,77 €	0,2310%
SNAP CL A	103 010	1 329 242,34 €	0,0109%
SNAP ON	1 081	129 683,08 €	0,0019%
SOCIETE GENERALE A	1 564 859	69 104 173,44 €	0,1937%
SOCIETE LDC	13 029	1 667 712,00 €	0,0768%
SODEXHO ALLIANCE	161 946	13 263 377,40 €	0,1074%
SODEXO PF 2020	10 000	819 000,00 €	0,0000%
SODEXO PRI FID 2019	41 800	3 423 420,00 €	0,0000%
SODEXO PRIME	79 083	6 476 897,70 €	0,0000%
SOFTBANK	139 000	8 448 746,52 €	0,0126%
SOITEC SA	66 424	3 912 373,60 €	0,2100%
SOL MELIA	90 000	1 034 100,00 €	0,0392%
SOLOCAL GROUPE	880 000	1 012 000,00 €	0,1510%
SOLUTIONS 30	48 509	1 489 226,30 €	0,2006%
SOLVAY	10 000	1 128 500,00 €	0,0094%
SOMFY NV	67 048	5 531 460,00 €	0,1812%
SOMPO HOLDING	216 400	7 084 582,65 €	0,0521%
SONIC HEALTHCARE	215 130	3 069 931,33 €	0,0507%
SONOVA HOLDING NOM	2 522	325 073,96 €	0,0039%
SOPHOS GROUP	649 878	3 208 249,09 €	0,1379%
SOPRA GROUP	76 832	12 731 062,40 €	0,3739%
SOUTHWEST AIRLINES	322 517	15 021 160,11 €	0,0556%
SPARK NEW ZEALAND	475 507	931 601,00 €	0,0259%
SPECTRIS	201 383	6 188 271,95 €	0,1698%
SPIE	775 777	13 940 712,69 €	0,5035%
SPIRAX-SARCO ENG PLC	30 647	2 011 788,35 €	0,0416%
SPIRIT AEROSYSTEMS	44 172	3 006 217,35 €	0,0388%

SPRINT NEXTEL CORP	21 538	85 462,00 €	0,0005%
SQUARE CL A	13 230	529 264,54 €	0,0046%
SRA HOLDINGS	25 100	586 266,78 €	0,1647%
SRP GROUP	118 000	920 400,00 €	0,3410%
ST. JAMES S PLACE	1 238 164	15 344 646,82 €	0,2339%
STABILUS GMBH	71 961	5 580 575,55 €	0,2913%
STANDARD CHARTERED	254 816	2 071 488,11 €	0,0077%
STANDARD LIFE BK PLC	205 717	844 033,37 €	0,0069%
STANLEY BLACK DECKER	110 108	13 715 937,39 €	0,0714%
STANLEY ELECTRIC	40 800	1 225 922,64 €	0,0232%
STARBUCKS	4 105	193 225,56 €	0,0003%
STARHUB	1 158 142	1 651 718,61 €	0,0669%
STARTS	220 700	4 881 587,96 €	0,4087%
STATE STREET	222 929	18 077 577,90 €	0,0610%
STATOILHYDRO	53 567	1 024 405,42 €	0,0016%
STEEL DYNAMICS	65 752	2 364 152,90 €	0,0279%
STEF TFE	44 900	4 579 800,00 €	0,3410%
STEMMER IMAGING AG	48 806	1 719 191,35 €	0,7509%
STMICROELECTRONICS	1 857 866	33 413 720,02 €	0,2039%
STOCKLAND	1 995 908	5 016 689,58 €	0,0820%
STORA ENSO S.R	1 558 469	23 260 149,84 €	0,2545%
STRATEC BIOMEDICAL	90 571	6 647 911,40 €	0,7598%
STRAUMANN HOLDING	4 987	2 549 184,00 €	0,0314%
STRYKER	39 977	5 230 799,56 €	0,0107%
SUBARU CORP	11 200	298 593,48 €	0,0015%
SUDZUCKER	416 726	5 746 651,54 €	0,2041%
SUEZ ENVIRON.COMP.	1 674 418	19 707 899,86 €	0,2695%
SUMCO	90 000	1 919 804,76 €	0,0307%
SUMI MITSUI FIN GP	710 700	24 223 490,97 €	0,0502%
SUMI MITSUI TRU HLG	103 800	3 418 082,79 €	0,0266%
SUMITOMO	238 400	3 264 466,30 €	0,0191%
SUMITOMO REALTY	30 000	902 560,54 €	0,0063%
SUMITOMO ELECTRIC	234 600	2 911 995,18 €	0,0295%
SUMITOMO FORESTRY	208 300	2 716 931,25 €	0,1141%
SUMITOMO SEIKA	30 000	1 167 479,84 €	0,2147%
SUMMIT INTERNAT	1 149 116	- €	0,0140%
SUN ART RETAIL GRO	1 672 500	1 582 006,79 €	0,0175%
SUN FRONT.FUDOSAN	250 000	2 240 154,50 €	0,5128%
SUN HUNG KAI PROP.	317 300	4 076 272,37 €	0,0110%
SUN LIFE FINANCIAL	4 394	146 623,70 €	0,0007%
SUNCOR ENERGY	30 958	868 643,68 €	0,0019%
SUNCORP GROUP	187 556	1 560 480,89 €	0,0144%
SUNTRUST BANKS	10 824	598 825,03 €	0,0023%
SURUGA BANK	339 200	3 809 675,55 €	0,1461%
SUZUKI MOTOR	168 900	7 399 367,94 €	0,0344%
SVB FINANCIAL GROUP	7 042	1 374 273,63 €	0,0133%
SVENSKA CELLULOS.B	489 000	4 221 644,21 €	0,0767%
SVENSKA HANDEL FONDE	107 362	1 086 154,55 €	0,0056%
SWATCH GROUP NOM.	3 148	213 974,19 €	0,0025%
SWECO B	299 534	5 016 589,24 €	0,2709%
SWIRE PACIFIC CL.A	176 500	1 447 328,34 €	0,0195%
SWIRE PACIFIC CL.B	1 035 000	1 441 156,21 €	0,0347%
SWIRE PROPERTIES	847 526	2 414 666,53 €	0,0145%
SWISS LIFE HO.NOM.	2 406	695 221,02 €	0,0070%
SWISS RE	50 071	4 135 948,78 €	0,0143%
SWISSCOM NOM.	7 142	2 872 082,20 €	0,0138%
SWORD GROUP	107 350	3 762 617,50 €	1,1247%
SYDNEY AIRPORT UNITS	564 633	2 362 982,15 €	0,0251%
SYMRISE	218 694	14 293 839,84 €	0,1685%
SYNCHRONY FCIAL	566 736	15 451 199,80 €	0,0751%
SYNERGIE	122 900	6 280 190,00 €	0,5045%
SYNOPSISYS	2 238	151 474,67 €	0,0015%
SYSCO	33 823	1 649 003,60 €	0,0065%
SYSMEX	22 400	1 650 955,64 €	0,0107%
T AND D	416 000	5 370 376,67 €	0,0635%
T&K TOKA	152 900	1 517 373,62 €	0,6102%

TABCORP HOLDINGS	917 701	2 512 681,20 €	0,0456%
TADANO	67 500	823 142,10 €	0,0521%
TAISEI	3 800	156 887,27 €	0,0017%
TAIYO INK MFG	50 300	1 757 496,78 €	0,1746%
TAKAMATSU	55 100	1 270 133,20 €	0,1417%
TAKE TWO INTERACT.	2 020	160 601,37 €	0,0018%
TAKEAWAY.COM B.V.	178 478	7 710 249,60 €	0,4133%
TAKEDA PHARMA.	40 800	1 616 782,96 €	0,0051%
TAKKT	333 910	6 177 335,00 €	0,5089%
TALANX AG	192 219	6 793 019,46 €	0,0760%
TARGET	184 661	10 424 859,31 €	0,0346%
TARKETT SA	561 399	15 281 280,78 €	0,8810%
TAYLOR WIMPEY	154 360	325 024,02 €	0,0047%
TD AMERITRADE HLDG	90 107	4 339 584,18 €	0,0159%
TDC	54 453	366 136,88 €	0,0067%
TDK	145 800	10 690 216,06 €	0,1125%
TE CONNECTIVITY LTD	56 281	4 571 672,89 €	0,0161%
TECHNICOLOR	697 333	958 135,54 €	0,1683%
TECHNIPFMC P.L.C.	1 011 550	23 905 465,32 €	0,2191%
TECHNO ASSOCIE	16 900	169 265,46 €	0,0843%
TECHNOGYM SPA	510 776	4 903 449,60 €	0,2541%
TECHTRONIC INDUST.	562 570	2 666 484,76 €	0,0307%
TED BAKER	107 128	3 054 864,83 €	0,2405%
TEIJIN	70 000	1 070 916,18 €	0,0354%
TEIKOKU SEN I	37 500	578 292,44 €	0,1380%
TEL.ERICSSON S.B	601 144	3 088 671,13 €	0,0196%
TELE COLUMBUS	950 021	8 331 684,17 €	0,7448%
TELE2 AB-B	29 953	291 249,10 €	0,0062%
TELECOM ITAL.EPAR.	14 757 363	9 981 880,32 €	0,2448%
TELECOM ITAL.ORD.	14 050 576	10 832 994,10 €	0,0924%
TELEFLEX	818	169 592,75 €	0,0018%
TELEFONICA	2 824 073	22 671 658,06 €	0,0544%
TELEFONICA DEUTSCH	2 827 205	10 788 614,28 €	0,0950%
TELEKOM AUSTRIA	813 373	6 295 507,02 €	0,1224%
TELENET GROUP HOLD	214 530	11 638 252,50 €	0,1824%
TELENOR	178 798	3 277 639,27 €	0,0119%
TELEPERFORMANCE	324 347	40 867 722,00 €	0,5613%
TELEPIZZA GROUP	727 589	3 892 601,15 €	0,7224%
TELSTRA	2 301 349	4 506 960,96 €	0,0193%
TELUS CORP	11 252	321 039,66 €	0,0000%
TENARIS	760 778	10 612 853,10 €	0,0644%
TERNA	5 384 337	25 570 216,41 €	0,2679%
TERUMO	5 900	252 158,82 €	0,0016%
TESCO	556 143	1 306 146,28 €	0,0057%
TESLA MOTORS	21 457	4 643 128,35 €	0,0126%
TESSI	16 831	2 903 347,50 €	0,6016%
TEXAS INSTRUMENTS	2 087	176 296,65 €	0,0002%
TF1	42 499	468 763,97 €	0,0202%
THALES	240 185	23 763 903,90 €	0,1128%
THE LINK REIT	380 369	2 640 288,33 €	0,0177%
THE MOSAIC	8 924	176 179,79 €	0,0023%
THE STAR ENTER GP	382 674	1 262 572,40 €	0,0417%
THERMO FISHER	3 975	667 299,67 €	0,0010%
THK	38 100	1 281 704,78 €	0,0285%
THOMSON REUTERS	5 335	167 526,27 €	0,0008%
THULE GROUP AB	373 707	6 552 730,33 €	0,3621%
THYSSENKRUPP	281 304	5 960 831,76 €	0,0452%
TIFFANY	2 656	210 907,80 €	0,0021%
TIME WARNER	15 048	1 157 246,69 €	0,0019%
TINGYI HOLDING	1 271 833	2 145 141,42 €	0,0226%
TJX COS	100 544	6 667 779,52 €	0,0161%
T-MOBILE US	50 200	2 491 529,86 €	0,0059%
TOCALO	94 400	936 100,17 €	0,1494%
TOKAI CORP	55 900	955 211,82 €	0,1551%
TOKAI TOKYO SECU.	470 700	2 645 098,74 €	0,1740%
TOKIO MARINE HOLD.	451 600	16 348 739,29 €	0,0604%

TOKYO ELECTRON	18 400	2 815 683,07 €	0,0111%
TOKYO GAS	7 200	155 318,40 €	0,0016%
TOKYO SEIMITSU	97 100	3 188 546,46 €	0,2335%
TOKYO STEEL MFG	479 100	3 131 862,15 €	0,3090%
TOKYU FUDOSAN HOLD	400 000	2 370 129,34 €	0,0624%
TOLL BROTHERS	5 019	176 502,62 €	0,0033%
TOMOKU	61 800	1 003 583,10 €	0,3195%
TOMRA SYSTEMS	85 700	1 455 626,33 €	0,0579%
TOMTOM	571 000	4 273 364,00 €	0,2426%
TOPCON	40 400	641 546,61 €	0,0374%
TOPRE	249 100	5 865 901,91 €	0,4611%
TORAY INDUSTRIES	27 000	207 772,42 €	0,0017%
TORCHMARK	3 352	229 408,33 €	0,0030%
TORONTO DOMIN BANK	58 380	2 691 827,57 €	0,0032%
TOSHIBA	75 000	176 612,86 €	0,0012%
TOTAL FINA	2 157 327	99 517 494,51 €	0,0811%
TOTAL SYSTEM SERV.	3 978	279 011,49 €	0,0022%
TOWNGAS CHINA	4 478 476	3 169 001,12 €	0,1618%
TOYOTA INDUSTRIES	111 800	5 504 755,36 €	0,0343%
TOYOTA MOTOR	143 700	7 498 420,23 €	0,0044%
TOYOTA TSUSHO	40 600	1 119 029,81 €	0,0115%
TPR CO LTD	146 500	3 444 237,54 €	0,4058%
TRACTOR SUPPLY	24 313	1 245 847,27 €	0,0199%
TRANSCANADA	15 511	521 207,16 €	0,0017%
TRANSURBAN UNIT	511 723	3 644 791,63 €	0,0230%
TRAVELERS COS.	1 439	162 474,72 €	0,0005%
TRAVIS PERKINS	20 617	290 194,80 €	0,0082%
TREASURY WINE EST	205 174	2 157 503,75 €	0,0285%
TREEHOUSE FOODS	188 900	5 878 117,66 €	0,3354%
TREND MICRO	41 100	1 995 381,31 €	0,0293%
TRIGANO	24 582	3 606 179,40 €	0,1271%
TRYGVESTA A/S NV	118 220	2 228 321,71 €	0,0391%
TSUBAKI NAKASHIMA	64 900	1 367 521,81 €	0,1606%
TSUBAKIMOTO CHAIN	150 000	993 160,65 €	0,0784%
TSUKADA GLOBAL HOL	147 400	699 841,09 €	0,3011%
TSURUHA	9 400	1 090 244,20 €	0,0191%
TUI NOM.	21 051	366 657,66 €	0,0036%
TV BROADCASTS	579 159	1 560 064,65 €	0,1322%
TWENTY FST CENTUR B	7 954	235 221,35 €	0,0010%
TWITTER	11 961	282 138,97 €	0,0016%
TYMAN	735 169	2 498 920,52 €	0,3746%
TYSON FOODS CL.A	120 477	7 169 745,60 €	0,0405%
U S BANCORP	325 672	13 372 717,00 €	0,0198%
UBI BANCA	1 592 506	5 909 789,77 €	0,1392%
UBI SOFT ENTERTAIN	316 247	21 669 244,44 €	0,2831%
U-BLOX HOLDING	30 000	4 381 421,41 €	0,4280%
UBM REALITAETEN AG	25 850	1 057 265,00 €	0,3459%
UBS NOM.	321 426	4 583 807,15 €	0,0083%
UCB	338 947	22 431 512,46 €	0,1743%
ULTA SALON COS&FRA	4 948	821 830,27 €	0,0082%
UMICORE	673 925	28 931 600,25 €	0,2735%
UNI CHARM	89 800	2 079 629,47 €	0,0145%
UNIBAIL	54 143	10 051 647,95 €	0,0542%
UNICREDIT SPA	1 529 537	25 983 774,56 €	0,0686%
UNILEVER	83 993	3 789 600,91 €	0,0069%
UNILEVER	529 718	24 298 164,66 €	0,0309%
UNION PACIFIC ORD.	26 949	2 945 687,74 €	0,0035%
UNIPER SE	124 238	3 074 890,50 €	0,0642%
UNIPOL	265 658	1 056 787,52 €	0,0370%
UNIPOLSAI S.P.A.	897 702	1 735 257,96 €	0,0317%
UNIPRES	125 000	2 299 407,74 €	0,2611%
UNI-PRESIDENT CHINA	3 123 000	2 196 914,71 €	0,0723%
UNITED DRUG	350 574	3 470 950,52 €	0,1410%
UNITED OVS BK LCL	146 601	2 499 862,03 €	0,0088%
UNITED PARCEL CL.B	54 312	4 621 940,82 €	0,0079%
UNITED RENTALS	16 659	2 339 723,60 €	0,0199%

UNITED TECHNO.	170 443	17 437 198,25 €	0,0213%
UNITED THERAPEUTIC	383	34 991,16 €	0,0009%
UNITED UTILITIES	54 427	444 132,27 €	0,0080%
UNITEDHEALTH GROUP	105 449	18 348 649,02 €	0,0110%
UNIV.HEAL.SCE CL.B	1 628	156 743,90 €	0,0019%
UNIVERSAL DISPLAY	7 751	636 541,85 €	0,0165%
UOL GROUP	20 800	110 274,69 €	0,0025%
UPM KYMMENE	995 006	29 949 680,60 €	0,1864%
UTD INTERNET NOM.	82 391	4 210 180,10 €	0,0402%
VALEO	460 375	24 694 515,00 €	0,1921%
VALLOUREC	995 529	4 284 756,81 €	0,2174%
VALMET OY	176 086	2 866 680,08 €	0,1175%
VARIAN MEDICAL SYS	15 035	1 499 404,60 €	0,0164%
VENTAS	6 371	256 580,58 €	0,0018%
VENTURE CORP.	120 879	2 106 968,87 €	0,0421%
VEOLIA ENVIRON.	767 372	14 768 074,14 €	0,1362%
VEREIT	40 777	230 766,29 €	0,0042%
VERIZON CIONS	799 227	31 076 176,07 €	0,0193%
VERMILION ENERGY	19 906	521 503,05 €	0,0132%
VERTEX PHARM.	81 777	10 837 106,52 €	0,0321%
VESTAS WIND SYST.	24 325	1 402 587,21 €	0,0118%
VETO PROMESSES	32 165	1 775 508,00 €	0,2707%
VIACOM CL.B	7 180	181 331,71 €	0,0020%
VICAT	35 845	2 199 090,75 €	0,0798%
VICINITY CENTERS	452 274	679 814,35 €	0,0117%
VICTORIA	216 017	1 828 272,09 €	0,1836%
VICTREX PLC	154 589	4 528 168,72 €	0,1795%
VIDRALA	54 300	4 968 450,00 €	0,2190%
VIENNA INSUR.GROUP	214 992	5 843 482,56 €	0,1680%
VILMORIN CLAUSE	5 994	423 775,80 €	0,0288%
VINCI	742 340	59 312 966,00 €	0,1245%
VIRBAC	17 000	2 029 800,00 €	0,2010%
VIRGIN AUS INT HLG	441 960	- €	0,0000%
VISA INC LTD	222 212	21 613 204,41 €	0,0124%
VISCOFAN	84 833	4 759 131,30 €	0,1820%
VITROLIFE	74 356	4 266 549,77 €	0,0685%
VIVENDI UNIVERSAL	1 561 571	32 792 991,00 €	0,1201%
VMWARE A	41 785	4 120 231,70 €	0,0393%
VOCUS COMMUNICATIO	65 657	90 908,75 €	0,0106%
VODAFONE GROUP	1 229 991	2 724 864,29 €	0,0046%
VOESTALPINE	193 402	8 233 123,14 €	0,1097%
VOLKSWAGEN ORD.	8 985	1 460 961,00 €	0,0030%
VOLKSWAGEN PF	59 754	9 643 100,52 €	0,0290%
VOLVO S.B	178 479	2 638 260,90 €	0,0108%
VONOVIA	511 111	20 572 217,75 €	0,1000%
VORNADO REALTY	3 123	170 897,18 €	0,0016%
VOYAGEURS DU MONDE	3 961	400 061,00 €	0,1073%
VTECH HOLDINGS	280 153	2 876 340,99 €	0,1114%
VULCAN MATERIALS	166 337	15 441 472,77 €	0,1258%
VZ HOLDING	26 994	5 936 525,43 €	0,3374%
WACKER CHEMIE	22 050	2 940 367,50 €	0,0423%
WALGREEN	3 598	191 536,42 €	0,0004%
WALLIX GROUP	32 927	790 248,00 €	0,5903%
WALMART	230 053	16 642 529,91 €	0,0078%
WANT WANT CHINA	2 865 465	1 867 313,31 €	0,0230%
WARTSILA	476 139	8 546 695,05 €	0,0805%
WASH TEC	55 533	4 326 020,70 €	0,3973%
WASTE CONNECTIONS	75 450	4 401 173,32 €	0,0286%
WASTE MANAGEMENT	15 900	1 087 537,50 €	0,0037%
WATERS	8 563	1 383 127,98 €	0,0109%
WAYFAIR A	9 298	510 545,14 €	0,0159%
WEC ENERGY GROUP	144 200	7 351 579,46 €	0,0457%
WELLS FARGO	611 058	26 040 207,98 €	0,0125%
WELLTOWER INC	2 272	100 552,88 €	0,0006%
WENDEL INVEST.	80 019	10 138 407,30 €	0,1730%
WESFARMERS	262 298	6 798 955,24 €	0,0231%

WEST JAPAN RAILWAY	3 000	170 442,88 €	0,0015%
WESTERN DIGITAL	5 158	386 981,06 €	0,0017%
WESTPAC BANKING	372 452	6 648 315,24 €	0,0109%
WESTROCK CO	43 019	2 244 606,44 €	0,0168%
WEYERHAEUSER	54 051	1 538 224,17 €	0,0071%
WH GROUP	1 606 416	1 391 347,90 €	0,0109%
WHARF HOLDINGS	458 613	1 280 491,11 €	0,0151%
WHARF REAL ESTATE	214 613	1 136 183,20 €	0,0071%
WHEELOCK	194 881	1 157 908,81 €	0,0095%
WHIRLPOOL	30 000	3 734 845,71 €	0,0424%
WIENERBERGER	288 968	5 871 829,76 €	0,2459%
WILLIAMS COMPANIES	14 805	299 266,01 €	0,0018%
WILLIS TOWERS WATSON	19 360	2 395 738,02 €	0,0147%
WILMAR INTL	212 800	419 609,35 €	0,0034%
WING TAI HOLDINGS	111 600	143 245,49 €	0,0144%
WIRECARD	148 812	14 274 047,04 €	0,1204%
WIZZ AIR HOLDINGS	114 946	4 266 388,55 €	0,1580%
WM.MORRIS.SUPERM.	642 101	1 563 688,42 €	0,0273%
WOLTERS KLUWER	229 033	9 891 935,27 €	0,0789%
WOODSIDE PETROLEUM	15 278	278 622,09 €	0,0016%
WOOLWORTHS	420 486	6 894 674,86 €	0,0320%
WORKDAY CL A	21 700	2 242 783,27 €	0,0148%
WORLDLINE	391 525	16 154 321,50 €	0,2942%
WORLDPAY INC	40 613	2 715 789,02 €	0,0137%
WORLEYPARSONS	240 458	2 152 101,72 €	0,0881%
WPP PLC	88 675	1 145 482,35 €	0,0070%
WYNDHAM WORLDWIDE	1 990	185 157,30 €	0,0020%
WYNN MACAU LTD	388 719	1 145 748,98 €	0,0075%
XEBIO	46 000	741 376,46 €	0,0960%
XERO LIVE LIMITED	32 524	678 331,34 €	0,0234%
XEROX CORP	4 043	94 611,16 €	0,0016%
X-FAB SILICON FOUN	381 141	3 334 983,75 €	0,2914%
XILAM ANIMATION	26 404	1 235 707,20 €	0,5914%
XILINX	33 015	1 939 263,81 €	0,0130%
XINYI GLASS HLDGS	564 666	691 481,48 €	0,0141%
XL GROUP	350 250	15 737 541,17 €	0,1356%
XXL	409 886	3 413 063,48 €	0,2947%
XYLEM	23 426	1 465 160,73 €	0,0130%
YAKULT HONSHA	20 400	1 227 482,34 €	0,0119%
YAMABIKO CORP	190 000	2 020 649,94 €	0,4308%
YAMATO KOGYO	111 300	2 512 012,92 €	0,1645%
YASKAWA ELECTRIC	11 900	438 990,00 €	0,0045%
YOKOGAWA BRIDGE	70 000	1 205 249,00 €	0,1536%
YONDOSHI HOLDINGS	21 400	451 087,60 €	0,0730%
YUE YUEN IND.	800 439	2 583 198,20 €	0,0488%
YUM BRANDS	54 048	3 741 193,02 €	0,0167%
ZALANDO	144 901	6 416 216,28 €	0,0583%
ZARDOYA OTIS	163 678	1 338 886,04 €	0,0348%
ZENRIN	32 100	551 465,64 €	0,0560%
ZIGEXN CO LTD	140 600	1 053 468,97 €	0,1267%
ZIMMER HOLDINGS	1 366	121 111,22 €	0,0007%
ZIONS BANCORP.	3 701	158 680,92 €	0,0019%
ZOETIS INC	10 356	703 199,22 €	0,0021%
ZURICH FINANC.SCES	14 587	3 881 774,48 €	0,0096%

OBLIGATIONS

Encours sous gestion dans la poche

13 954 368 536 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2018
21ST CEN 3700 150924	1 025 000	844 769,69 €
21ST CENTU 6.15% 37	1 344 000	1 361 776,48 €
2I RETE GAS 1.75 26	800 000	832 560,00 €
A2A SPA 1.75% 2025	3 900 000	3 998 014,48 €
AB 1150 0127	20 250 000	19 981 079,71 €
AB 2000 0135	1 700 000	1 643 948,64 €

ABB FIN 0750 160524	1 200 000	1 217 152,18 €
ABBEY NAT 0.875% 20	9 020 000	9 219 700,44 €
ABBEY NATL 2.625%20	12 270 000	13 200 438,59 €
ABBOTT 2.9% 16-21	2 400 000	1 947 922,10 €
ABBOTT 3.4% 16-23	7 650 000	6 242 954,02 €
ABBOTT 3750 1126	3 685 000	3 014 435,47 €
ABBOTT LAB 4.125%20	1 620	1 367 180,02 €
ABBVIE 2.85 05/23	2 100 000	1 668 669,15 €
ABBVIE INC 0.375% 19	10 080 000	10 159 235,19 €
ABBVIE INC 1.37 24	3 000 000	3 071 579,21 €
ABBVIE INC 2.30 0521	3 000 000	2 395 683,76 €
ABBVIE INC 2.50% 20	2 200 000	1 784 136,37 €
ABBVIE INC 2.9% 2022	1 910 000	1 533 313,97 €
ABBVIE INC 3.2% 26	1 425 000	1 115 708,96 €
ABERTI 1000 270227	7 400 000	7 007 136,97 €
ABERTIS 1.375% 2026	3 500 000	3 487 296,13 €
ABERTIS IN 3.75 23	3 500 000	4 138 938,44 €
ABN AMR BK 4.75% 19	6 780 000	7 117 178,69 €
ABN AMR BK 7.125%22	900 000	1 175 786,09 €
ABN AMRO 2.875%25	6 000 000	6 427 352,16 €
ABN AMRO 5750 1299	1 800 000	1 965 584,25 €
ABN AMRO BK 0.625%22	4 505 000	4 578 499,85 €
ABN AMRO BK 2.5% 23	7 000 000	7 798 414,66 €
ACCOR 1.25% 0124	4 600 000	4 658 912,27 €
ACCOR 2.375% 23	5 000 000	5 434 071,15 €
ACE HLD 3.35% 24	2 500 000	2 054 766,17 €
ACE INA 2.875% 22	4 805 000	3 907 563,32 €
ACE INA HOL 3.35% 26	1 155 000	935 624,97 €
ACEA 3% 16-2026	3 200 000	3 075 039,54 €
ACEA SPA 2.625% 24	3 200 000	3 546 324,75 €
ACEIM 1.5 080627	9 279 000	9 136 018,72 €
ACEIM EU3M+37 080223	5 100 000	5 090 476,46 €
ACHMEA 4.25% 15-2049	2 080 000	2 199 901,53 €
ACHMEA BK 1.125% 22	2 250 000	2 330 686,22 €
ACHMEA BV 2.5% 20	2 970 000	3 180 403,32 €
ACHMEA BV 6% 43	3 895 000	4 540 097,30 €
ACHMEA HYP 2.75% 21	2 740 000	2 946 936,61 €
ACTAVIS FU 3% 0320	4 185 000	3 389 038,42 €
ACTAVIS FU 3.45%2022	6 000 000	4 845 395,78 €
ACTAVIS FUND 3.8% 25	10 225 000	8 172 018,54 €
ACTAVIS FUND 3.85%24	3 925 000	3 187 967,44 €
ADECCO INT 1.50% 22	6 517 000	6 846 499,87 €
ADLER REAL 2.12 24	6 171 000	6 155 128,70 €
ADP 1.5% 07 04 2025	1 600 000	1 691 363,06 €
ADP INC 2.25% 20	3 300 000	2 652 732,04 €
AEGON NV 1% 23	13 550 000	13 826 853,33 €
AEGON NV 4% 2044	1 000 000	1 134 948,73 €
AERC 4625 0722	1 925 000	1 624 709,46 €
AERCA 3650 0727	1 230 000	944 145,14 €
AERCAP 3300 0123	2 582 000	2 047 264,86 €
AERCAP CAP 3.75% 19	1 975 000	1 638 735,32 €
AERCAP IRE 3.50 0522	1 425 000	1 157 747,73 €
AERCAP IRE 4.5 0521	4 980 000	4 220 842,05 €
AERO ROMA 1625 0627	1 850 000	1 899 213,82 €
AEROPORTI 3.25% 21	969 000	1 054 684,42 €
AETNA INC 2.75%22	900 000	713 056,47 €
AGRIUM 3.15% 22	2 350 000	1 896 805,50 €
AGRIUM 3375 150325	1 700 000	1 340 340,49 €
AHO DELH E3M 0321	3 200 000	3 209 888,00 €
AHODELHAI 1.125 0326	4 600 000	4 561 466,49 €
AHOLD DEL 0875 0924	2 450 000	2 454 103,51 €
AIB GRP 1500 0323	7 793 000	7 827 496,29 €
AIG 4200 0428	685 000	562 741,37 €
AIG 6.40 15/12/20	1 722	1 535 413,25 €
AIR LEAS C9 2.5 0321	4 535 000	3 624 302,32 €
AIR LEASE 2.125% 20	1 035 000	830 864,83 €

AIR LEASE 2.75 0123	1 690 000	1 336 086,95 €
AIR LEASE 3.375% 21	1 375 000	1 129 658,34 €
AIR LEASE 3.75% 2022	1 300 000	1 074 161,75 €
AIR LEASE 4.25 24	1 375 000	1 138 398,49 €
AIR LIQ 1.75% 270921	960 000	744 646,26 €
AIR LIQUIDE 2.25% 23	3 045 000	2 344 403,65 €
AIRL 2625 0722	3 250 000	2 567 729,46 €
AKELI 1125 0324	2 200 000	2 146 217,39 €
AKELI 1750 0225	4 700 000	4 695 711,40 €
AKELIUS 3875 051078	3 500 000	3 499 685,00 €
AKELIUS RSDT 1.5% 22	4 000 000	4 107 454,03 €
ALD 0875 0722	22 800 000	22 989 850,51 €
ALD SA E3M 0221	1 700 000	1 695 957,97 €
ALEXAN 4600 010422	2 000 000	1 693 304,96 €
ALEXANDRIA 3.9%2023	2 000 000	1 663 487,42 €
ALFA LAVAL 1.375% 22	3 000 000	3 141 365,80 €
ALFA SAB 5.25% 24	750 000	631 721,35 €
ALIBABA 2800 0623	575 000	456 792,70 €
ALIMEN 3550 0727	2 000 000	1 573 943,07 €
ALIMENT 0.875 042023	2 700 000	2 674 938,82 €
ALLIAND 1625 0625	1 000 000	994 815,33 €
ALLIANZ 025 06/06/23	3 000 000	2 968 783,71 €
ALLIANZ 2.241% 07/45	5 900 000	6 094 647,24 €
ALLIANZ 3.375% 24	1 600 000	1 739 065,31 €
ALLIANZ 5.75% 2041	180	21 555 782,05 €
ALLIANZ FIN 1.375%31	2 100 000	2 122 145,32 €
ALLIANZ SE 4.75%2049	4 200 000	4 907 583,62 €
ALLIANZ SE 5.625%42	1 800 000	2 198 466,58 €
ALLIANZSE 0 07/47	400 000	433 001,25 €
ALLSTATE 5.75% 2053	2 395 000	2 058 289,44 €
ALLY FCIAL 4.125% 20	3 500 000	2 864 498,22 €
ALPHABET 3.375% 24	1 875 000	1 555 391,67 €
ALSTOM S 3% 19	2 000 000	2 119 743,56 €
ALSTRIA 2.125% 23	100 000	108 238,42 €
ALSTRIA OFF 1.5 1127	3 500 000	3 384 651,99 €
AM IN GP 1.875 0627	2 210 000	2 228 500,24 €
AM AIRLN 3.20% 28	1 350 000	1 001 081,76 €
AM TOWER 3375 151026	1 855 000	1 435 658,54 €
AMADEUS 0.125% 20	3 300 000	3 309 708,39 €
AMADEUS CAP 1.625%21	2 800 000	2 949 971,18 €
AMADEUS ZC 190519	3 500 000	3 503 395,35 €
AMAZON 2.8 0824	6 625 000	5 225 925,02 €
AMAZON 3.15 0827	8 790 000	6 920 985,92 €
AMAZON.COM 2.5% 22	4 000 000	3 203 874,00 €
AME TOW 4.40 150226	415 000	344 058,97 €
AMER INTL 3.30% 2021	1 740 000	1 418 815,30 €
AMER INTL 4.875%2022	1 800 000	1 564 128,55 €
AMER INTL GP3.9 0426	3 250 000	2 613 679,86 €
AMER TOWER 5% 24	375 000	324 050,70 €
AMERI EXR 2.375 0520	1 750 000	1 414 582,94 €
AMERIC MOV 1.5 0324	1 465 000	1 518 116,06 €
AMERIC TOW 3.30% 21	7 000 000	5 713 322,76 €
AMERIC TOWER 3.5% 23	374 000	304 061,07 €
AMERICA LIBUS 030519	2 500 000	2 040 659,19 €
AMERICA MO 5.125% 73	1 310 000	1 372 888,25 €
AMERICA MOV 4.125%19	6 983	7 552 976,94 €
america movil 3 0721	2 550	2 833 629,91 €
AMERICAN 0625 221121	6 000 000	6 072 863,38 €
AMERICAN 3000 0623	4 000 000	3 172 332,67 €
AMERICAN 3300 030527	9 275 000	7 411 855,10 €
AMERICAN 3400 270223	2 450 000	1 993 069,07 €
AMERICAN EQUITY	3 632 000	3 002 701,40 €
AMERICAN HONDA F	4 406 000	4 405 241,27 €
AMERICAN TOW 4.7%22	2 000 000	1 700 109,77 €
AMGEN 2.125% 2020	1 775 000	1 430 813,26 €
AMGEN 2.60%17- 2026	2 315 000	1 721 850,60 €

AMGEN INC	4 075 000	3 264 150,97 €
AMGEN INC 3.875% 21	5 000 000	4 212 725,81 €
AMT 5.9% 2021	2 139	1 925 319,34 €
ANADARKO PE 4.85 321	5 000 000	4 229 357,24 €
ANADARKO PE 5.55 326	2 000 000	1 775 037,61 €
ANALOG DEVICES	575 000	458 926,75 €
ANALOG DEVICES	6 800 000	5 473 025,80 €
AND LOG LP 4.25 1227	620 000	496 951,26 €
ANDE LOG LP 3.5 1222	1 066 000	861 522,15 €
ANDEA 6875 0223	1 775 000	1 461 936,48 €
ANDEAVOR 380 0100428	5 265 000	4 118 935,60 €
ANDEAVOR 5.125 26	2 325 000	2 024 253,88 €
ANG AMER 1.625 0925	1 200 000	1 205 022,20 €
ANGLO 4875 0525	4 310 000	3 660 522,64 €
ANGLO AME 4.75 27	1 800 000	1 511 974,22 €
ANHEU 3500 0124	7 695 000	6 287 206,37 €
ANHEU 4000 0428	11 615 000	9 537 078,06 €
ANHEUS 2.5% 07/22	75 000	59 504,00 €
ANHEUS 5.375 20	245	210 561,52 €
ANHEUSER 1.90% 19	6 500 000	5 272 207,54 €
ANHEUSER 2.65% 21	12 165 000	9 843 317,28 €
ANHEUSER 2625 170123	385 000	305 524,32 €
ANHEUSER 3.30% 23	3 075 000	2 511 414,60 €
ANHEUSER-B 0.875% 22	9 500 000	9 711 183,17 €
ANHEUSER-B 1.5% 25	5 730 000	5 942 337,34 €
ANHEUSER-B 2% 28	5 100 000	5 346 722,71 €
ANHEUSER-B 2.75% 36	6 600 000	7 001 820,30 €
ANHEUSER-BUS 3.65%26	19 200 000	15 571 165,04 €
ANNINGTON F 1.65 724	4 100 000	4 160 548,63 €
ANTER 5375 1121	3 560 000	3 002 906,22 €
ANTH 2500 1120	3 303 000	2 665 541,73 €
ANTHEM IN 4.101 0328	615 000	501 596,88 €
ANZ NZ 2.85% 15-2020	2 300 000	1 865 569,58 €
ANZ NZ INTL 0625 122	2 850 000	2 902 478,36 €
ANZ NZ INTL/LDN	6 700 000	6 713 482,60 €
ANZ NZL IN 0.12 23	2 210 000	2 170 415,55 €
AON 2.875% 14-2026	2 000 000	2 239 275,63 €
AON 4%13-2023	2 250 000	1 900 182,95 €
AON PLC 3.50% 24	1 000 000	814 593,02 €
APPLE 1375 0529	1 200 000	1 217 388,29 €
APPLE 2850 0223	6 870 000	5 548 937,10 €
APPLE 3250 0226	11 655 000	9 373 574,01 €
APPLE IN 2850 110524	4 220 000	3 382 044,83 €
APPLE INC	4 435 000	3 493 234,90 €
APPLE INC 0 22	2 900 000	2 391 037,32 €
APPLE INC 0.87 25	3 622 000	3 661 836,10 €
APPLE INC 1.625% 26	14 300 000	15 102 530,01 €
APPLE INC 1.8 2020	5 435 000	4 375 222,51 €
APPLE INC 2.25 21	4 600 000	3 691 033,87 €
APPLE INC 2.75 0125	7 208 000	5 706 820,92 €
APPLE INC 2.85 21	790 000	649 579,65 €
APPLE INC 2450 0826	3 310 000	2 501 414,45 €
APPLE INC 3 24	3 500 000	2 819 807,29 €
APPLE INC 3.2% 05/27	1 435 000	1 151 199,65 €
APPLE L 0.35 110522	7 000 000	5 736 207,64 €
APPLIED M 3,3 010427	1 155 000	921 420,50 €
APRR SA 1.5 0133	7 500 000	7 329 032,87 €
APRR SA 1.625% 0132	4 200 000	4 203 134,73 €
AQUARIUS 4.25%2043	10 452 000	12 104 228,74 €
ARAMARK SERV INC	750 000	602 644,63 €
ARCEL 0950 0123	1 400 000	1 379 783,04 €
ARCELOR 2.875% 2020	5 000 000	5 377 173,29 €
ARCELOR 3.125%2022	1 233 000	1 335 905,34 €
ARES CAP 3.875% 20	4 010 000	3 309 520,26 €
ARION BANK 1 23	3 600 000	3 582 939,45 €
ARKEMA	4 100 000	4 230 722,21 €

ARKEMA 1.50%2025	5 800 000	6 012 241,12 €
AROUN 1000 0125	3 000 000	2 884 530,29 €
AROUND 1625 310128	3 200 000	3 066 714,86 €
AROUNDTOWN 1.50% 24	2 300 000	2 325 672,87 €
ASAHI GP 0.321 0921	5 970 000	5 979 189,74 €
ASB FINA 0500 100622	10 560 000	10 574 282,04 €
ASHTEAD 4.125 150825	2 125 000	1 668 345,73 €
ASML HOLDG 1.625% 27	4 449 000	4 617 745,63 €
ASPA 3.875%16-2026	2 600 000	2 885 736,05 €
ASR NLD 5 PERP	5 800 000	6 586 390,40 €
ASSI GEN 5.125% 0924	5 000	6 453 704,96 €
ASSIC GENER 2.875%20	1 094 000	1 155 919,82 €
ASSICU GEN 7.75%42	8 200 000	10 489 843,04 €
ASSICURA 4.125% 26	1 300 000	1 484 768,73 €
ASSICURAZ 10.125% 42	2 900 000	4 105 970,41 €
ASSICURAZI EI03M 47	1 743 000	2 043 212,76 €
ASSICURAZIONI 5%48	1 850 000	2 124 625,08 €
ASSOC BANC 2.75%2019	4 200 000	3 428 443,31 €
ASSURANT 4200 0923	1 925 000	1 571 962,03 €
ASTRAZE 075 0524	4 350 000	4 354 857,55 €
ASTRAZENEC 2.37 20	3 300 000	2 664 224,94 €
AT & T 5.20% 16-2020	4 803 000	4 075 159,12 €
AT AND T 2.45% 2020	385 000	311 230,38 €
AT AND T 3% 06 2022	6 900 000	5 550 296,38 €
AT AND T 4.3 30	9 736 000	7 809 092,40 €
AT T INC TR-050926	16 248 000	16 687 857,66 €
AT& T INC 3.40% 25	2 000 000	1 585 613,42 €
AT& T INC 2.35 29	2 952 000	3 046 028,92 €
AT&T 1,45% 14-2022	3 000 000	3 152 686,17 €
AT&T 1.30% 2023	7 176 000	7 415 986,75 €
AT&T 2.40% 2024	4 200 000	4 526 733,83 €
AT&T 2.45% 2035	7 500 000	7 086 622,99 €
AT&T 3.9 140827	4 260 000	3 499 474,17 €
AT&T INC	2 000 000	2 066 051,98 €
AT&T INC 2.65% 21	2 000 000	2 175 741,59 €
AT&T INC 3.20 0322	1 480 000	1 199 276,48 €
AT&T INC 3.375% 34	1 100 000	1 198 388,42 €
AT&T INC 3.55% 32	4 420 000	4 954 974,31 €
AT&T INC 3.6% 23	2 024 000	1 658 746,87 €
AT&T INC 4.25 0327	27 280 000	22 437 049,22 €
ATF 1875 0126	2 800 000	2 810 462,59 €
ATF NETH 2125 130323	4 000 000	4 190 650,49 €
ATF NLD 3750 1299	3 100 000	3 220 030,57 €
ATHENE 4000 0122	5 160 000	4 282 296,76 €
ATLANTI 1625 030225	3 543 000	3 597 796,15 €
ATLANTI 1875 130727	2 750 000	2 800 742,76 €
ATLAS COPCO 2.625%19	2 510 000	2 579 532,91 €
ATR DU SUD 2.875%23	2 800 000	3 133 902,24 €
ATRIUM 3.625% 2022	1 580 000	1 766 209,71 €
ATT INC 2.75% 16-23	500 000	563 434,79 €
AUCHAN 0625 070222	3 300 000	3 316 327,42 €
AUST 0625 0223	9 700 000	9 685 253,85 €
AUSTRAL PAC 3.125%23	4 440 000	5 091 979,03 €
AUTO SUD 2.95% 24	4 900 000	5 548 228,78 €
AUTONATIO 4.5 1025	3 692 000	3 044 800,52 €
AUTOROUTE 1250 0127	1 700 000	1 723 568,87 €
AUTOROUTES DU SU	1 700 000	1 686 186,53 €
AUTOSTRDE 1.75 26	3 000 000	3 108 247,64 €
AUTOSTRDE 1.875% 25	4 500 000	4 704 812,32 €
AUTOZONE I 3.75 0627	1 400 000	1 133 134,67 €
AVALONBAY 2.95% 26	2 325 000	1 807 025,75 €
AVALONBAY 4.20% 2018	3 200 000	2 733 965,93 €
AVIATION 2875 0122	7 000 000	5 609 959,78 €
AVIATIONCG 6.75 21	3 250 000	2 993 819,88 €
AVINOR AS 1.25 27	4 130 000	4 181 085,27 €
AVIVA 0.10% 2018	500 000	501 088,42 €

AVIVA PLC 0.625% 23	500 000	499 029,70 €
AVIVA PLC 3.875% 44	4 501 000	5 029 000,64 €
AVNET 3750 1221	1 375 000	1 131 504,01 €
AVNET 4.875% 22	3 110 000	2 664 054,63 €
AXA 3.941%29/11/2049	2 550	2 776 910,08 €
AXA 5.125%13-2043	3 000 000	3 627 855,01 €
AXA SA 3.25 49	9 345 000	9 479 795,73 €
AXA SA 3.375% 47	1 980 000	2 127 703,42 €
AXA VRN 10/99	1 500 000	1 633 629,84 €
B IRELAND 1.25% 2020	3 650 000	3 780 811,50 €
B IRELAND TF/TV 24	4 000 000	4 299 888,77 €
B MONTREAL 1.50 19	7 000 000	5 615 339,27 €
BA AM LIMO 428	2 150 000	1 740 792,42 €
BABCOCK INTL 1.75%22	2 167 000	2 259 009,38 €
BAK HUG 3.337 27	7 500 000	5 888 167,94 €
BALD 1875 0126	1 050 000	1 035 098,99 €
BALL 4.375% 2023	6 000 000	6 846 717,85 €
BALL CORP 4% 23	2 000 000	1 611 405,19 €
BALT GAS ELEC 3.5 21	1 500 000	1 251 404,64 €
BALTIMORE 2.4 08/26	2 125 000	1 592 752,16 €
BAN OF AM 2.151 1120	5 000 000	4 013 635,81 €
BAN SAN 2.125 0228	7 900 000	7 775 606,24 €
BANC SANT 3.125 0223	1 200 000	948 995,95 €
BANCO 0875 0323	2 900 000	2 890 230,42 €
BANCO 1125 0125	15 200 000	15 007 978,23 €
BANCO 6.05% 04/20	20	1 172 062,88 €
BANCO BLB V 0.75 22	2 100 000	2 108 606,28 €
BANCO SA 4250 110427	5 000 000	4 121 948,03 €
BANCO SANT 4.75 25	3 200 000	3 215 920,69 €
BANCO SANTANDER	6 900 000	7 097 942,70 €
BANCO SBDL 5.625 26	1 500 000	1 844 832,74 €
BANK AMER 2.328 21	1 880 000	1 495 194,01 €
BANK AMER 3.666 26	3 125 000	2 486 215,29 €
BANK AME E3M 0523	2 050 000	2 069 737,86 €
BANK AMER 2.738 22	1 960 000	1 578 667,98 €
BANK AMER 4.45% 26	2 425 000	2 019 144,17 €
BANK IRELAND 3.25%19	1 356 000	1 401 472,44 €
BANK OF AM 2.625% 21	3 230 000	2 616 693,52 €
BANK OF AM EI3M 0222	13 625 000	13 778 363,08 €
BANK OF AMER 3.3%30	15 738 000	12 813 915,39 €
BANK OF AMER 4.10%23	4 400 000	3 712 115,03 €
BANK OF AMER 5% 21	1 200	5 223 975,82 €
BANK OF AMER CRP	5 015 000	4 123 828,39 €
BANK OF AMER CRP	700 000	588 842,57 €
BANK OF MTRL 1.75 19	4 000 000	3 208 617,13 €
BANK OF NY M 3 1028	1 800 000	1 369 601,17 €
BANK OF NY MELLO	5 000 000	4 043 162,45 €
BANK OF NY MELLO	2 860 000	2 285 015,43 €
BANKIA SA TF/TV 24	2 000 000	2 141 479,45 €
BARCL PLC 0.625 1123	7 050 000	6 938 753,01 €
BARCLAYS 1.875 0321	5 627 000	5 861 806,48 €
BARCLAYS 1.875 1223	8 765 000	9 100 335,52 €
BARCLAYS 2.625% 2025	3 530 000	3 681 619,73 €
BARCLAYS 2.75% 2019	1 420 000	1 157 610,17 €
BARCLAYS 2000 0228	8 880 000	8 812 311,25 €
BARCLAYS 2650 0121	2 500 000	2 012 270,02 €
BARCLAYS 3.20% 2021	1 900 000	1 532 716,27 €
BARCLAYS 3.25 0121	1 025 000	833 962,12 €
BARCLAYS 5.2 0526	5 790 000	4 846 052,12 €
BARCLAYS BK 5.14%20	9 315	7 987 787,23 €
BARCLAYS BK 6.625%22	2 000	2 409 042,47 €
BARCLS PLC 1375 0126	11 109 000	10 923 713,94 €
BARRICK NO 4.40% 21	235 000	200 269,89 €
BASF SE 0.875 1127	1 440 000	1 416 808,03 €
BASF SE 1.625 1137	8 200 000	8 064 901,53 €
BAWAG 8.125 10/23	2 000 000	2 758 492,05 €

BAXTER INTL 2.60% 26	3 945 000	2 933 246,05 €
BAYER AG 2.375% 75	1 259 000	1 296 539,23 €
BAYER AG 3.75% 74	6 250 000	6 856 003,15 €
BB&T CO 2050 150521	6 725 000	5 332 115,75 €
BB&T CORP 2.15 0221	1 845 000	1 473 558,87 €
BB&T CORPOR 2.45% 20	10 400 000	8 425 182,48 €
BBT CORP 5.25 19	1 610 000	1 384 332,50 €
BBVA 1% 20/01/2021	2 000 000	2 053 388,19 €
BBVA SUB 3.5% 24	7 000 000	7 466 187,16 €
BC SAN ER+0.75 0323	3 700 000	3 718 839,89 €
BCO SAN 6.25% 2019	7 000 000	7 311 286,11 €
BCPE EUR3M 0323	3 000 000	2 992 611,00 €
BECTN 2133 0619	1 370 000	1 109 525,94 €
BECTN 2894 0622	3 500 000	2 784 249,50 €
BECTON 0368 0619	11 595 000	11 667 695,11 €
BECTON DCK 3.70 27	5 025 000	3 982 389,62 €
BECTON DICK.2.675%19	240 000	195 408,22 €
BECTON DICKI 1 1222	3 438 000	3 460 589,72 €
BECTON LIBUS3M 0622	1 750 000	1 427 400,46 €
BELDEN 3375 0727	900 000	880 115,63 €
BELFIUS 0750 0922	5 300 000	5 326 712,96 €
BELFIUS 1000 1024	10 600 000	10 471 674,94 €
BELFIUS BK 3.625% 25	2 600 000	2 448 223,57 €
BELGACOM 2.375% 2024	800 000	876 032,24 €
BEN STABI 2.375 0228	4 600 000	4 561 396,55 €
BENI STAB 1625 1024	3 650 000	3 667 607,50 €
BERKS 0500 0320	4 743 000	4 791 111,43 €
BERKSH HAT 1.125%27	9 150 000	8 992 479,24 €
BERKSHIRE 1.7% 19	3 400 000	2 748 060,33 €
BERKSHIRE 2.20%16-21	6 400 000	5 125 464,09 €
BERKSHIRE 2.75%16-21	5 020 000	4 017 898,03 €
BERKSHIREH 1.30% 24	4 000 000	4 116 249,72 €
BERLIN HP A 1.125 27	1 000 000	988 315,75 €
BERTEL 1.125% 26	7 500 000	7 668 592,47 €
BEVCO LUX SARL	7 042 000	7 046 695,90 €
BFCM 0.25 06/19	4 000 000	4 028 290,40 €
BFCM 0.75 170725	15 900 000	15 569 062,04 €
BFCM 1.25% 25	7 500 000	7 670 545,69 €
BFCM 1.625% 26	300 000	312 747,16 €
BFCM 1.685% 04-2015	3 100 000	2 852 922,77 €
BFCM 1250 0527	4 400 000	4 438 130,74 €
BFCM 1625 1127	4 300 000	4 147 714,11 €
BFCM 2.625% 21	8 700 000	9 347 005,04 €
BFCM 3% 13-2023	1 000 000	1 138 761,36 €
BFCM 3% 14-2024	14 200 000	15 844 151,06 €
BFCM 4.125% 2020	3 000 000	3 368 498,20 €
BFIFTH CIN 2.25 0621	3 900 000	3 106 118,43 €
BG ENERGY 3.625%19	2 000	2 147 952,90 €
BG ENERGY 1.25%11/22	8 430 000	8 784 198,60 €
BG ENERGY 2.25% 29	2 215 000	2 444 005,47 €
BG ENERGY 3% 2018	1 200	1 237 601,59 €
BHARTI AIR 4% 18	3 859 000	3 997 973,16 €
BIMBO 3.875% 24	1 700 000	1 401 694,25 €
BIOGEN INC 3.625% 22	3 900 000	3 207 594,22 €
BIOGEN INC 5.2% 2045	1 200 000	1 064 363,95 €
BK AMER 3.093% 1025	4 025 000	3 144 961,69 €
BK AMERICA 0.75% 23	4 000 000	3 997 031,93 €
BK AMERICA 3.875%25	5 550 000	4 573 322,80 €
BK F C M 2.2625 0327	600 000	629 888,98 €
BK NOVA 2800 210721	6 625 000	5 371 213,97 €
BK NY MELLON 2.60%20	7 960 000	6 437 462,53 €
BK OF A 3248 211027	2 465 000	1 919 378,86 €
BK OF AME 1.625 0922	8 880 000	9 337 636,58 €
BK OF AMER 2.375% 24	10 121 000	11 122 965,79 €
BK OF NY ME 4.95% 20	3 650 000	3 069 853,75 €
BK OFAM CRP L3M 0329	3 915 000	3 193 399,07 €

BK POSTALE 2.75% 26	6 700 000	7 222 232,80 €
BKAMERICA 2.50% 2020	7 584 000	8 133 041,26 €
BKAMERICA 2.62 20	1 400 000	1 139 554,96 €
BKAMERICA 3.50 26	5 400 000	4 373 279,67 €
BKAMERICA 4% 01/25	5 200 000	4 252 972,50 €
BKAMERICA 5.49 19	6 100 000	5 090 029,28 €
BKAMERICA TF/TV 25	6 566 000	6 669 594,58 €
BKMO 3.803% 1232	2 400 000	1 875 108,51 €
BLACK 4.25% 11/23	6 000 000	5 089 893,08 €
BLACK HILLS 3.15% 27	1 075 000	829 227,65 €
BMBG BOND 3%2021	2 800 000	2 870 121,33 €
BMW FI 0.875 030425	2 700 000	2 686 145,15 €
BMW FI NV 0.375 0723	4 100 000	4 059 349,79 €
BMW FIN 0.125% 20	4 550 000	4 571 867,43 €
BMW US 2.70 04/22	4 000 000	3 235 923,08 €
BMW US CA 1.125% 21	4 500 000	4 668 533,73 €
BNP 1125 0626	8 538 000	8 362 591,22 €
BNP 0.75% 16-2022	11 250 000	11 408 056,92 €
BNP 2.375% 20/05/24	5 310 000	5 936 606,28 €
BNP E3M 0624	2 050 000	2 068 529,95 €
BNP E3M 0922	2 000 000	2 036 016,28 €
BNP PAR 2875 1026	3 300 000	3 599 533,47 €
BNP PARI 3.375 0125	2 598 000	2 055 849,57 €
BNP PARI 4250 151024	2 500 000	2 091 176,43 €
BNP PARIB 1.12 23	8 686 000	8 953 317,14 €
BNP PARIB 1.5 11/25	9 070 000	9 256 437,78 €
BNP PARIB 2.625% 27	5 300 000	5 698 338,80 €
BNP PARIB 2.95 22	2 042 000	1 642 603,79 €
BNP PARIB 3.75% 20	4 800 000	5 333 307,67 €
BNP PARIBAS	1 550 000	1 537 997,20 €
BNP PARIBAS	5 140 000	5 155 880,78 €
BNP PARIBAS 1.375%18	2 390 000	2 426 012,39 €
BNP PARIBAS 1.50% 28	970 000	1 005 048,15 €
BNP PARIBAS 2% 2019	4 000 000	4 087 385,75 €
BNP PARIBAS 2.25%27	950 000	976 066,61 €
BNP PARIBAS 2.875%26	11 500 000	12 190 250,78 €
BNP PARIBAS 3.8% 24	4 325 000	3 537 546,90 €
BNP PARIBAS TV08-18	72	3 874 705,74 €
BNP PRBAS 1.125% 23	3 250 000	3 300 412,56 €
BNPP 4,875%PERP	5 512	5 765 948,41 €
BNPP 5% 15/01/2021	5 500	4 741 101,22 €
BNPP CA 4.032% 99	2 600 000	2 853 302,26 €
BNPP CRDIF 1 24	16 400 000	15 861 523,30 €
BNZ INTL FUND/LN	2 726 000	2 193 101,74 €
BNZ INTL FUND/LN	3 563 000	3 524 046,10 €
BOA 3.95% 2025	3 000 000	2 458 824,25 €
BOA 3824 0128	8 000 000	6 475 744,02 €
BOA 4.2% 24	4 005 000	3 310 704,48 €
BOA 4.25% 26	6 105 000	5 077 680,89 €
BOA 5.625% 2020	272	1 182 144,49 €
BOA CORP 1.375% 21	6 225 000	6 495 134,33 €
BOA TV 17 20122023	3 581 000	2 873 228,83 €
BOST PR LP 3.20 0125	1 435 000	1 137 659,48 €
BOSTON PP 3.85% 23	4 000 000	3 329 806,25 €
BOSTON PRO 3.65% 26	2 900 000	2 322 891,18 €
BOSTON PRO 3.8% 24	2 225 000	1 830 556,08 €
BP 3.561ù 2021	9 800	8 203 164,83 €
BP CAP 1953 0325	12 786 000	13 609 708,89 €
BP CAPIT 1.526% 22	7 000 000	7 368 133,93 €
BP CAPIT 3.119% 26	2 125 000	1 687 488,95 €
BP CAPIT MA 1676 519	1 795 000	1 455 358,20 €
BP CAPITAL 1.109%23	1 400 000	1 435 912,56 €
BP CAPITAL 1.573%27	4 000 000	4 095 569,23 €
BP CAPITAL 2.213% 26	1 576 000	1 712 866,71 €
BP CAPITAL PLC	2 425 000	1 894 201,40 €
BP CAPMKTS 1.117 24	7 364 000	7 509 152,46 €

BP CAPMKTS 3.06 22	1 200 000	973 075,64 €
BPCE SA 3500 1027	4 025 000	3 143 435,67 €
BPCE 0,375% 05/10/23	5 700 000	5 618 756,13 €
BPCE 0.625% 20/04/20	2 200 000	2 240 333,76 €
BPCE 0.875 0124	9 600 000	9 525 233,99 €
BPCE 1,125 180123	8 200 000	8 324 979,20 €
BPCE 1.125%15-2022	4 000 000	4 134 404,93 €
BPCE 1.375 0326	6 200 000	6 176 500,48 €
BPCE 2.125% 2021	1 700 000	1 801 552,64 €
BPCE 2.65% 16-2021	6 000 000	4 814 912,39 €
BPCE 2.75% 11/2027	4 300 000	4 630 505,34 €
BPCE 2.875% 24	500 000	564 436,77 €
BPCE 2.875% 26	2 200 000	2 424 047,76 €
BPCE 3% 14-2024	400 000	464 988,91 €
BPCE 4.25% 02/2023	1 700 000	2 014 700,24 €
BPCE 4.625% 23	9 400 000	11 359 057,81 €
BPCE 5.15% 14-2024	4 300 000	3 681 843,31 €
BPCE 5.7% 2023	3 575 000	3 191 154,17 €
BPCE SA 08/07/2026	6 200 000	6 679 682,63 €
BPCE SA 1.625 0128	3 700 000	3 703 326,28 €
BPCM 1077 0625	16 990 000	17 142 088,23 €
BPCM 1637 0629	4 331 000	4 445 729,52 €
BRAMBLES 4.625% 18	5 000	5 231 713,02 €
BRAMBLES U 4.125% 25	1 600 000	1 340 057,19 €
BRANCH BKG 1.45%2019	5 000 000	4 028 823,52 €
BRANDY 3950 1127	3 810 000	3 032 950,90 €
BRANDY OPE 3.95 23	3 000 000	2 465 975,53 €
BRCLYS PLC 3.684% 23	5 179 000	4 205 707,91 €
BREN FIN 1.125 0925	850 000	847 234,48 €
BRIGHTHOUSE FINA	13 178 000	10 064 189,81 €
BRIGHTHOUSE FINA	1 400 000	1 057 773,35 €
BRISA CNCSS 2.375 27	2 300 000	2 496 644,33 €
BRISA CONCES 2% 23	4 100 000	4 366 058,55 €
BRIT SKY 1.875% 2023	2 325 000	2 470 002,00 €
BRIT SKY 2.625% 19	4 701 000	3 809 381,33 €
BRITISH SKY 1.50% 21	7 388 000	7 737 215,79 €
BRITISH TEL 0.625%21	7 575 000	7 659 965,61 €
BRITISH TELECO 1 211	1 519 000	1 499 616,85 €
BRIX OPER 4.125 0626	1 050 000	848 430,91 €
BRIXMOR 3850 010225	2 500 000	1 996 077,89 €
BRIXMOR OP 3.25 0923	5 307 000	4 165 316,45 €
BRK 3.45% 2021	2 600	2 143 750,05 €
BROADCOM 2.375PCT 1	6 900 000	5 562 335,45 €
BROADCOM 2,2PCT 17-1	3 750 000	2 988 670,71 €
BROADCOM 3.875PCT 17	2 890 000	2 301 063,27 €
BROADCOM. 2.65PCT 17	5 000 000	3 914 296,23 €
BROADDRID 3,95% 2020	1 200 000	997 898,39 €
BROOK 4000 0424	4 830 000	3 952 451,71 €
BROOKFIELD 4.25 626	7 150 000	5 909 322,09 €
BRUSSELS 1000 030524	3 400 000	3 463 020,63 €
BT 1.125% 10/06/19	3 080 000	3 152 285,23 €
BTP 2.05 01/08/27	5 000 000	5 171 205,00 €
BUCKEY PA 4.125 1227	750 000	594 340,52 €
BUCKEYE PART 3.95%26	2 075 000	1 622 368,93 €
BUND 0.5 15/08/27	5 000 000	5 046 782,19 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	13 760 000	20 110 481,27 €
BUNGE FIN 3.25% 2026	2 205 000	1 683 415,05 €
BURL NTHN 3.65 0925	2 620 000	2 167 525,02 €
BURLINGTON 3% 0425	1 600 000	1 268 091,78 €
BURLINGTON 305% 0922	1 900 000	1 544 998,26 €
BUZZI 2125 0423	1 000 000	1 060 422,74 €
C SUISSE 3574 090123	1 675 000	1 364 078,45 €
CA ASSUR 4.25% 2025	7 600 000	8 295 165,21 €
CA ASSUR 4.5% 49	6 500 000	7 297 382,95 €
CA LOND 1,25 140426	4 000 000	4 073 244,54 €
CA LONDON 2.375% 21	3 300 000	2 621 403,56 €

CA LONDON 2.375% 24	9 300 000	10 354 044,79 €
CA LONDON 3.125% 23	5 300 000	6 096 339,79 €
CAIXABANK	4 200 000	4 181 751,18 €
CAIXABANK 1.125 0524	9 700 000	9 790 249,37 €
CAIXABANK 1125 0123	2 500 000	2 514 298,49 €
CAIXABANK 2.75 0728	3 500 000	3 736 426,44 €
CAIXABK 3500 150227	3 000 000	3 238 568,22 €
CAJA 2.375% 2019	700 000	732 414,83 €
CALDN EU3M 0323	6 900 000	6 912 971,43 €
CAMPO FOOD 3.37 22	1 500	1 219 873,50 €
CANADIAN NATL RE	1 800 000	1 450 943,61 €
CAPITAL 2350 310120	1 375 000	1 104 877,38 €
CAPITAL FI 2.50 0520	1 500 000	1 212 369,39 €
CAPITAL ON 3.75 0327	4 600 000	3 626 326,79 €
CAPITAL ONE 2.95% 21	4 500 000	3 620 146,76 €
CAPITAL ONE 3.2% 25	1 875 000	1 467 946,64 €
CAPITAL ONE 5.50% 24	4 056 000	3 245 287,37 €
CARDETY SA 2.12 28	4 900 000	4 879 420,67 €
CARDINAL H 3.079 624	4 500 000	3 528 016,83 €
CARGILL INC 2.5% 23	961 000	1 056 820,99 €
CARLI COS 3.5 1224	4 100 000	3 309 935,13 €
CARLSB BR 2.625%2019	2 640 000	2 780 674,77 €
CARLSBERG 2.5% 24	6 100 000	6 794 992,34 €
CARLSBERG BRW 0.5 23	1 400 000	1 388 030,44 €
CARMILA 2.375% 23	4 200 000	4 526 951,78 €
CARMILA 2.375% 24	2 000 000	2 147 165,00 €
CARREFOUR SA	6 200 000	6 104 529,58 €
CASINO 3.248%14-2024	8 100 000	8 588 920,22 €
CASINO 4.407%2019	400 000	431 935,31 €
CASINO 5.976% 21	2 300 000	2 708 701,37 €
CASINO GUI 1.865 622	900 000	904 232,96 €
CATERPILLAR F 2.5 20	2 745 000	2 229 216,82 €
CBL ASSOC LP 5.95 26	3 484 000	2 425 216,41 €
CDT AGRI 4125 100127	3 433 000	2 805 662,53 €
CELA US HL 1.25 0225	4 400 000	4 357 103,62 €
CELANES US 1.125 923	3 688 000	3 727 233,55 €
CELG 3.875% 15/08/25	1 000 000	808 404,82 €
CELGENE 3.55% 2022	2 050 000	1 669 092,43 €
CELGENE 3900 0228	7 025 000	5 624 959,99 €
CEMEX 2.75 12/24	4 100 000	4 097 623,14 €
CENTENE CORP	3 500 000	2 940 500,87 €
CFCM NORD 2.125%26	2 000 000	2 005 493,42 €
CHARL SCH 3.2 012028	7 000 000	5 508 767,56 €
CHART 4200 0328	2 175 000	1 691 047,69 €
CHARTER 3579 230720	1 300 000	1 067 080,47 €
CHARTER COMM OPT	4 830 000	4 046 187,83 €
CHEVRON CORP 2.35%22	3 000 000	2 385 069,32 €
CHORUS LT TF 23	4 399 000	4 475 924,35 €
CHRTER C OT 4.908 25	14 778 000	12 363 164,54 €
CHUBB 0000 0437	7 000 000	5 725 700,27 €
CHUBB 2500 0338	3 610 000	3 672 883,34 €
CHUBB INA HL 1.55 28	7 212 000	7 234 916,43 €
CI D ST GO 1.375 627	15 800 000	15 948 302,64 €
CIE DE ST GOB 1% 325	3 100 000	3 092 711,44 €
CIE FINAN RI 1% 0626	15 002 000	14 940 740,46 €
CIGNA 3050 1027	2 575 000	1 952 338,72 €
CIMAREX EN 3.9% 0527	4 945 000	4 017 156,61 €
CINTAS CORP 3.7 0427	2 470 000	2 004 449,75 €
CINTAS CORP NO.2	1 145 000	916 662,05 €
CISCO SYSTEM 1.85%21	5 000 000	3 917 827,60 €
CISCO SYSTEM 2.5% 26	2 290 000	1 744 304,23 €
CISCO SYSTEMS	1 725 000	1 415 037,20 €
CIT GROUP 3875 0219	1 600 000	1 314 587,78 €
CIT GROUP IC 5.25 25	1 162 000	965 777,57 €
CITI FINAN 4.35 25	1 861 000	1 541 749,13 €
CITIGR IN 1.625 0328	6 897 000	6 909 149,67 €

CITIGR INC e3m 0323	2 600 000	2 599 834,90 €
CITIGR L3MUS 0923	3 265 000	2 725 147,10 €
CITIGRO 3887 100128	12 075 000	9 827 516,33 €
CITIGROU 3700 120126	2 000 000	1 618 433,14 €
CITIGROU I 2.65 1020	8 750 000	7 106 556,30 €
CITIGROUP 0 07/28	335 000	270 697,13 €
CITIGROUP 0.75% 2023	6 611 000	6 571 482,55 €
CITIGROUP 1.375% 21	8 190 000	8 526 584,65 €
CITIGROUP 1.75% 2025	1 767 000	1 839 209,49 €
CITIGROUP 2.125% 26	7 650 000	8 204 177,87 €
CITIGROUP 2.50% 2019	3 800 000	3 088 585,51 €
CITIGROUP 2.70 22	2 150 000	1 710 419,97 €
CITIGROUP 2350 0821	6 000 000	4 755 467,46 €
CITIGROUP 3.375%2023	7 500 000	6 089 035,25 €
CITIGROUP 3.4% 26	5 225 000	4 162 689,79 €
CITIGROUP 5%19EMTN	4 158	4 580 669,61 €
CITIGROUP 5.50% 25	4 095 000	3 623 869,57 €
CITIGROUP I 4.6 0326	5 000 000	4 178 341,54 €
CITIGROUP TV250422	7 140 000	5 875 600,38 €
CITIGROUP7.375%04/19	4 072	4 678 192,19 €
CITIGRP 4.4% 25	4 060 000	3 404 349,23 €
CITIGRP 4.45% 27	4 820 000	3 971 868,30 €
CITIZENS 2250 020320	800 000	640 831,00 €
CITIZENS 2250 1020	3 775 000	3 021 258,49 €
CITIZENS 2550 130521	3 400 000	2 725 298,75 €
CITIZENS BANK 2.5%19	4 400 000	3 568 332,37 €
CITIZENS BK 230 1218	5 240 000	4 279 500,22 €
CITY NATIONAL	2 300	1 967 011,02 €
CITYCON OY 3.75% 20	2 724 000	3 009 095,43 €
CLOVERIE 1.75% 2024	13 369 000	14 197 588,44 €
CM ARKEA 1.25 0524	5 200 000	5 262 730,95 €
CNA 3.95% 05/2024	3 500 000	2 920 982,91 €
CNH CAPITA 4.37 22	4 873 000	4 092 162,79 €
CNH I FIN 1.375 0522	3 000 000	3 101 112,33 €
CNH IND CP 4.375% 20	2 000 000	1 683 627,41 €
CNP ASSU 4% 99	3 100 000	3 398 076,78 €
CNP ASSUR 1.875 1022	5 200 000	5 446 638,59 €
COCA-COLA 0.75%2022	1 450 000	1 471 886,40 €
COCA-COLA 0 090321	1 400 000	1 397 370,10 €
COCACOLA 0.75% 2023	6 430 000	6 527 862,98 €
COCA-COLA 1.125% 27	5 916 000	5 948 531,32 €
COCA-COLA 3.8% 11/25	3 495 000	2 848 093,53 €
COFIROUTE 0375 0225	1 200 000	1 157 850,77 €
COLFAX CP 3250 0525	500 000	510 049,31 €
COLUMBIA PIPELIN	2 850 000	2 371 466,03 €
COM BK AU 1.936 1029	7 701 000	7 795 211,12 €
COM BK AUS 0375 0424	4 220 000	4 194 624,22 €
COM BK AUST 0.5 0722	1 500 000	1 509 448,37 €
COM BK AUST 1.625%19	3 810 000	3 879 748,57 €
COM BK AUST 45 1225	2 450 000	2 037 831,85 €
COMCAST 3.15 150228	2 900 000	2 250 674,47 €
COMCAST 3.375% 2025	4 155 000	3 332 311,01 €
COMCAST 5.15% 2020	4 000 000	3 401 090,47 €
COMCAST 9.455% 02-22	651	685 906,41 €
COMCAST CORP	5 000 000	3 976 609,62 €
COMM 1875 0228	5 600 000	5 573 510,57 €
COMMER AG 8.125 0923	1 500 000	1 422 673,16 €
COMMERZ 1.125 0925	2 000 000	1 974 759,84 €
COMMERZB 4% 0326	9 157 000	10 207 557,60 €
COMMERZBK 0.50% 2023	5 989 000	5 853 557,69 €
COMMERZBK 6.375% 19	4 000	4 241 191,79 €
COMMONW BK 2.55%2021	6 000 000	4 797 780,22 €
COMPASS GRP 1.875%23	3 650 000	3 902 730,68 €
COMPASS GRP 3.125%19	5 307 000	5 482 453,78 €
COMZBK AG 7.75 21	14	1 678 709,13 €
CON /MIDLA3.75 1027	2 930 000	2 328 796,29 €

CONCHO R 4375 150125	1 300 000	1 079 194,15 €
CONOCOPHIL CO	3 000 000	2 365 800,71 €
CONS EDI 2000 150320	970 000	775 408,46 €
CONSTELLATION BR	455 000	362 379,56 €
CONT AIRLN 4% 26 A	6 000	3 989 920,54 €
CONT AIRLN 7.25% 21	605	336 892,30 €
CONTIN 0000 050220	2 703 000	2 705 049,96 €
CONTINE 4500 150423	1 900 000	1 586 199,13 €
CONTL RUB 0.50% 19	3 056 000	3 074 069,33 €
COVENTRY 5.45%11-21	4 225	3 691 451,40 €
COVENTRY BG 2.5%20	1 300 000	1 392 231,05 €
COVIDIEN I 4.20 20	328	276 881,77 €
CPI PROP 2125 1024	4 200 000	4 205 124,38 €
CPL ONE BANK 2.4% 19	7 275 000	5 870 379,11 €
CR AGRICOLE 3.875%19	4 900 000	5 100 352,27 €
CR LOG 1350 1129	4 500 000	4 420 066,32 €
CR MU ARK 1.875 1029	4 000 000	3 972 555,79 €
CR SUISSE 1.375% 19	4 620 000	4 749 320,15 €
CR. AGR. ASSU TV48	3 800 000	4 446 877,76 €
CR36 -0.2% 09/03/18	20 000 000	20 064 615,77 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 085 165,50 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 087 707,90 €
CR36 -0.2% 27/03/18	25 000 000	25 087 707,90 €
CR36 -0.3% 14/03/18	20 000 000	20 032 581,84 €
CR36 -0.3% 23/03/18	9 000 000	9 023 737,95 €
CR36 -0.3% 27/03/18	20 000 000	20 070 166,32 €
CR36 -0.3% 28/03/18	10 000 000	10 035 359,77 €
CR36 -0.4% 21/03/18	5 000 000	5 001 162,48 €
CRD MU ARK 3.25 0626	1 300 000	1 432 849,62 €
CRDAG ASR 2625 0148	7 900 000	7 567 532,12 €
CRDT SUISSE 4.375%20	2 500 000	2 101 737,23 €
CRE SUISSE 1,5% 2026	5 400 000	5 649 045,98 €
CREAGR 0.875% 2022	8 200 000	8 369 235,25 €
CRED AGR 3.875% 24	2 427 000	2 034 810,80 €
CRED SUIS GP 1.25%22	989 000	1 022 042,33 €
CRED SUIS NY 3.62%24	5 025 000	4 064 808,31 €
CRED.AGRIC.8.2% 2018	7 000 000	7 002 590,00 €
CREDI AG 1375 030527	3 100 000	3 159 230,88 €
CREDI AGR 2.625% 27	4 000 000	4 229 284,08 €
CREDIT AG 1.875 1226	6 500 000	6 753 529,48 €
CREDIT AGR 1.375 25	5 800 000	5 858 789,76 €
CREDIT AGR 1125 0325	5 400 000	5 517 158,98 €
CREDIT AGR 1625 0329	8 900 000	9 241 865,80 €
CREDIT SUIS 1% 2023	11 225 000	11 527 329,38 €
CRH FINANCE 3.125%23	5 155 000	5 766 828,47 €
CRITERI S 1.625 22	15	1 571 452,43 €
CRITERIA CXA 1.5 23	2 800 000	2 865 391,05 €
CROWN 3650 0927	6 200 000	4 817 757,90 €
CROWN 3800 0228	2 965 000	2 337 760,38 €
CROWN CASTL 3.222%22	2 000 000	1 616 654,06 €
CROWN CASTL 3.4 0221	7 500 000	6 148 331,10 €
CROWN CASTLE 5.25%23	2 021 000	1 766 232,56 €
CROWN EU 3.375 0525	2 000 000	2 091 382,50 €
CROWN EUROPEAN 4%22	250 000	273 481,94 €
CRWCASTINT 4 0327	4 395 000	3 526 168,90 €
CS AG 5.75% 09/25	1 010 000	1 156 613,40 €
CS GR FDG 3.45% 21	10 500 000	8 671 944,75 €
CS GR FDG 3.80 22	5 825 000	4 781 440,01 €
CS LONDON 1.375%22	14 079 000	14 632 947,95 €
CSAG 1250 0725	7 600 000	7 632 840,03 €
CSC HOLDIN 5.5 0427	1 700 000	1 358 212,25 €
CSNY 3% 29/10/21	4 000 000	3 258 131,75 €
CSTEL BRD 4.75 25	4 000 000	3 473 162,49 €
CSX CORP 2.60 26	500 000	375 366,01 €
CTEFR 0875 0924	10 400 000	10 451 753,06 €
CTEFR 2125 0732	4 300 000	4 509 209,84 €

CUBESMAR L 3.125 926	975 000	737 885,78 €
CVS 3700 0323	16 105 000	13 171 131,74 €
CVS 4300 0328	16 775 000	13 731 352,89 €
CVS 5050 0348	2 500 000	2 138 241,79 €
CVS 4% 05/12/23	1 260 000	1 048 592,43 €
CVS CARRK 2.75% 22	1 390 000	1 096 153,70 €
CVS HEALTH 2.125 621	355 000	280 562,54 €
CVS HEALTH 2.80% 20	3 600 000	2 922 115,71 €
CVS HEALTH 3.50% 22	1 365 000	1 114 072,66 €
CVS HEALTH 3.875% 25	2 115 000	1 716 742,74 €
CVS HEALTH 4.1 25	11 193 000	9 188 328,86 €
CVS HEL CP3.125 0320	1 905 000	1 554 008,70 €
D S SMITH 1.37 24	5 470 000	5 513 997,13 €
D.R. 2250 1220	1 960 000	1 581 049,66 €
DAIML 1000 1127	2 466 000	2 383 141,70 €
DAIMLER 1375 0528	3 274 000	3 255 923,47 €
DAIMLER 2.3 120221	5 150 000	4 101 316,75 €
DAIMLER 2125 0737	1 200 000	1 200 712,05 €
DAIMLER AG 0.85 25	2 500 000	2 486 166,92 €
DAIMLER AG 0.875%21	11 300 000	11 556 934,35 €
DAIMLER BZ 0.50 19	18 834 000	19 042 677,26 €
DAIMLER BZ 2.25% 22	3 000 000	3 235 042,41 €
DAIMLER E3M 0522	3 400 000	3 409 690,00 €
DAIMLER FI 2.25 19	3 000 000	2 429 778,02 €
DAN BANK 2.75% 05/26	2 000 000	2 166 417,38 €
DANFOSS 1.375% 2022	3 577 000	3 708 009,95 €
DANONE	6 300 000	6 248 683,68 €
DANONE 1,25 300524	3 700 000	3 846 633,19 €
DANONE 1.125 25	2 000 000	2 029 961,11 €
DANONE 1.691%16-2019	3 575 000	2 876 675,92 €
DANSKE B 1250 150621	2 460 000	2 585 911,98 €
DANSKE BANK 0.75%23	2 230 000	2 262 045,93 €
DANSKE BK 3.875% 23	5 005 000	5 193 798,20 €
DARDEN 3850 0527	10 635 000	8 676 499,32 €
DBOER 1125 0328	12 045 000	11 942 827,05 €
DBR 2.50% 2044	2 280 000	3 048 627,04 €
DE VOLKS0,125 280920	6 723 000	6 730 666,48 €
DELAIR LI 3.625 0325	3 150 000	2 549 077,03 €
DELL 6020 0626	2 000 000	1 773 679,72 €
DELPHI AUTOM 1.5% 25	1 500 000	1 516 827,45 €
DELT AIR L 2.875 320	1 055 000	853 476,62 €
DELTA 2600 1220	645 000	519 048,24 €
DELTA LL 4.375% 49	4 124 000	4 586 649,25 €
DELTA LLOYD 9% 42	2 983 000	4 054 653,56 €
DEMETER INV 4.375%25	3 185 000	3 610 025,83 €
DEU.BK .4.875%1232	1 775 000	1 361 087,11 €
DEU.TELEK.8.25%30	100	116 639,43 €
DEUT 1000 1227	2 049 000	2 019 100,57 €
DEUT 2700 0720	4 200 000	3 363 141,84 €
DEUT 3150 0121	4 875 000	3 930 888,68 €
DEUT BAHN 0.875%31	4 582 000	4 360 830,00 €
DEUT E3M 1220	5 400 000	5 369 028,60 €
DEUT TEL FI 0.625%23	6 000 000	6 014 155,94 €
DEUT TEL FIN 1.5% 28	1 600 000	1 599 256,63 €
DEUTANNIG TF/TV 74	8 900 000	9 597 922,44 €
DEUTK 5851 0323	1 100 000	1 370 693,97 €
DEUTSC ANN 2.125%22	2 500 000	2 699 972,65 €
DEUTSCH 1625 0833	8 210 000	8 381 937,64 €
DEUTSCH BK AG 1% 19	10 500 000	10 589 066,80 €
DEUTSCHE 0625 1224	1 300 000	1 277 209,06 €
DEUTSCHE 1750 0128	4 900 000	4 694 459,34 €
DEUTSCHE 3600 190127	1 725 000	1 387 209,42 €
DEUTSCHE 4% 31/12/99	4 800 000	5 245 011,44 €
DEUTSCHE AN 3.625%21	940 000	1 064 246,46 €
DEUTSCHE B 1.5 0122	19 300 000	19 658 319,86 €
DEUTSCHE W 1.375% 20	5 764 000	5 985 423,44 €

DEUTSCHLAND 050 0226	2 390 000	2 437 077,11 €
DEVON ENGY 3.25% 22	559 000	454 444,40 €
DH EUROP FN 170 0122	1 723 000	1 817 044,58 €
DH EUROPE 1% 07/19	2 230 000	2 270 733,09 €
DH EUROPE 1200 0627	3 780 000	3 791 705,62 €
DIAG F PLC 0.5 0624	777 000	766 851,46 €
DIAGEO FIN 1.125% 19	3 750 000	3 834 999,72 €
DIAMOND FIN 3.48%19	4 275 000	3 532 078,92 €
DIAMOND1 2. 4.42%21	8 850 000	7 459 517,01 €
DIAMOND1 TF 5.45%23	4 400 000	3 841 775,83 €
DIGITAL 3950 0722	4 875 000	4 077 758,80 €
DIGITAL REALTY 3.5 1	9 153 000	7 209 003,07 €
DIGITAL RLTY 2.75 23	410 000	321 361,23 €
DISCO 2950 0323	3 530 000	2 764 256,15 €
DISCO 2200 0919	170 000	136 824,46 €
DISCOV BK 3.10 20	2 075 000	1 697 130,54 €
DISCOV BK 3.20 0821	445 000	359 386,75 €
DISCOV FIN 3.95% 24	1 775 000	1 453 078,44 €
DISCOVER 3.85% 2022	3 000 000	2 474 025,29 €
DISCOVER 4.10 0227	940 000	761 447,01 €
DISCOVER BK 8.7%19	506	455 132,57 €
DISCOVERY 380 130324	250 000	201 575,62 €
DISCOVERY 4.90%16-26	440 000	372 419,37 €
DISCOVERY 5.625%19	1 491	1 263 079,52 €
DISCOVERY CM 3.95 28	8 000 000	6 233 452,14 €
DISH DBS 7.875 19	2 000 000	1 713 217,06 €
DKE BANK 0250 1122	6 700 000	6 627 348,97 €
DNB 1125 0328	9 700 000	9 653 113,39 €
DNB BANK A 2.125 20	4 000 000	3 177 067,21 €
DNB BANK ASA	5 000 000	5 047 145,42 €
DNB BK 1125 0323	5 000 000	5 153 417,73 €
DOLLAR GL 1.87 18	1 450 000	1 188 555,51 €
DOLLAR GL 3.25% 2023	6 465 000	5 276 381,31 €
DOLLAR TRE 5.75 23	3 290 000	2 810 540,68 €
DOMINION 1.6%16-2019	1 125 000	901 027,56 €
DOMINION RES 5.2%19	2 255	1 896 747,42 €
DOW CHEMI 3.5% 1024	2 645 000	2 133 386,96 €
DQUSN LGHT 3.616 27	1 000 000	787 939,63 €
DREAM GLBAL 1.375 21	5 000 000	5 040 477,40 €
DT PFAND 2875 280627	2 700 000	2 761 653,95 €
DT PFANDBRIEFBAN	5 600 000	5 589 268,46 €
DUKE REALTY	2 000 000	1 648 360,91 €
DUPONT E 2200 010520	3 025 000	2 446 167,94 €
DUPONT EI NE LI0520	1 065 000	874 595,46 €
DVB BANK 1 07/19	900 000	914 463,02 €
DVB BANK 1250 220420	2 800 000	2 872 261,17 €
DVB BK 2375 021220	1 000 000	1 050 853,73 €
E.ETAT 3.75%05 OAT	702 198 690	815 542 312,18 €
E.ETAT 8.5%92 OAT	723 400 593	1 093 868 207,37 €
E.ON SE 0.375 0821	4 482 000	4 516 236,07 €
E.ON SE 0.875 0524	2 400 000	2 424 030,04 €
E.ON SE 1.625 0529	1 000 000	1 016 677,41 €
EASTMAN CHEMI 3.6%22	3 717 000	3 054 870,18 €
EASTMAN CHMC 2.8% 25	1 300 000	1 069 248,28 €
EASTMN CHM 2.70 20	2 170 000	1 763 578,24 €
EASYJET 1.75 23	2 500 000	2 616 893,10 €
EATON 2.75%2022	2 200 000	1 766 072,60 €
EBAY 2.6%12-2022	4 000 000	3 165 535,09 €
EBAY INC 2150 050620	1 525 000	1 226 766,89 €
EBAY INC 2200 010819	2 000 000	1 618 862,28 €
ECOLAB 2.625% 2025	2 966 000	3 353 727,11 €
EDF 1% 13/10/2026	7 000 000	6 840 390,38 €
EDF 1,625% 271125	6 100 000	6 399 171,63 €
EDF 1.875% 36	2 700 000	2 469 688,07 €
EDF 4.25% 49	8 000 000	8 469 948,75 €
EDF 4.625 04/30	500 000	665 353,76 €

EDF 5 5/8%33	1 188	1 702 914,72 €
EDF 5% 14-2049	3 000 000	3 239 608,54 €
EDF 5.375% 2049	3 000 000	3 310 365,95 €
EDISON INC 2% 0521	2 700 000	2 135 316,50 €
EDP FIN 1.125% 2024	4 150 000	4 160 653,96 €
EDP FIN 1875 0923	3 000 000	3 188 932,69 €
EDP FINA BV 1.5 1127	5 330 000	5 249 168,66 €
EDP FINANC 4.875% 20	6 000 000	6 857 511,91 €
EDP SA 2375 160975	3 400 000	3 780 283,01 €
EL PASO 6.5% 2020	2 525 000	2 203 752,08 €
EL PASO OP 6.50% 20	5 328 000	4 587 842,35 €
ELI LI 3.1 051527	1 790 000	1 438 059,58 €
ELISA OY 0875 170324	2 850 000	2 823 499,29 €
ELM BV 3375 290947	3 600 000	3 794 620,31 €
ELY LILLY 1.625% 26	2 800 000	2 976 376,45 €
EMBRAER NL 5.05% 25	2 000 000	1 700 955,40 €
ENABLE MIDS 4.4 0327	3 415 000	2 726 057,73 €
ENABLE MIDSTRM	2 500 000	2 014 392,00 €
ENAGAS FIN 1.25% 25	3 100 000	3 167 585,13 €
ENBRIDGE I 4.25 26	3 258 000	2 701 457,20 €
ENBRIE INC 2.9 07/22	355 000	282 589,45 €
ENBW 3.625% 14-2076	1 315 000	1 396 440,62 €
ENCANA C 3.9 1121	3 000 000	2 508 525,43 €
ENEL 2875 0522	3 500 000	2 815 487,89 €
ENEL 1125 0926	12 500 000	12 226 446,38 €
ENEL FIN 1.966% 2025	3 208 000	3 395 272,20 €
ENEL FIN INT1 PCT16	4 000	4 047 484,68 €
ENEL SPA 5% 75	2 000 000	2 167 477,44 €
ENEL TF/TV 01/74	2 500 000	2 653 147,26 €
ENERGIE B 3.375 0477	4 841 000	5 294 880,71 €
ENERGY 6050 010641	2 120 000	1 786 831,15 €
ENERGY TRAN 4.15%20	2 000 000	1 648 559,67 €
ENEXIS HOLD 0.875%26	2 600 000	2 593 014,73 €
ENEXIS HOLDG 1,50%23	6 890 000	7 256 041,71 €
ENGIE	14 000 000	13 525 470,79 €
ENGIE 2000 0937	4 900 000	4 938 073,83 €
ENGIE SA 0,875 27032	7 500 000	7 551 836,86 €
ENI 0.625% 16-2024	5 500 000	5 404 127,78 €
ENI 4.25%12-03/02/20	2 299 000	2 493 949,00 €
ENI SPA 0.75% 22	2 536 000	2 592 021,60 €
ENI SPA 1 140325	6 851 000	6 839 573,51 €
ENI SPA 1.125% 2028	6 700 000	6 400 632,06 €
ENI SPA 1.50% 26	600 000	612 924,27 €
ENI SPA 1500 170127	6 691 000	6 752 039,21 €
ENI SPA 2.625% 2021	3 004 000	3 293 709,57 €
ENI SPA 3.25% 2023	600 000	696 585,37 €
ENI SPA 4.125%09-19	43	2 327 159,66 €
ENL MIDST 4.85 0726	3 430 000	2 849 417,96 €
ENLINK MD4.40%04/ 24	2 480 000	2 014 680,02 €
ENT PRODT TF/TV 66	1 951 000	1 603 992,29 €
ENTER PR L3M 0278	3 747 000	2 927 637,31 €
ENTER PRODU 5.20% 20	8 600	7 346 290,28 €
ENTERGY 5.59% 24	1 000 000	914 973,83 €
ENTERGY 4% 15-2022	5 605 000	4 694 858,78 €
ENTERGY AR 3.5 04/26	1 620 000	1 315 092,57 €
ENTERGY CO 2.95 0926	475 000	361 624,23 €
ENTERGY MISS 2.85 28	1 125 000	861 487,68 €
ENTERP PROD 3.75% 25	1 350 000	1 102 875,96 €
ENTERPRISE 5.25%2020	5 230	4 448 327,95 €
ENTERPRISE O 6.5 119	1 378 000	1 165 678,08 €
ENTERPRISE PRODU	2 700 000	2 260 439,08 €
EQUIFAX 3300 1222	7 930 000	6 438 397,85 €
EQUIN 5375 0527	3 500 000	2 942 704,05 €
ERAC USA 3.85% 2024	2 300 000	1 919 758,65 €
ERAC USA FINANCE	4 400 000	3 521 113,05 €
ERP OPERA 2.85 11/26	2 450 000	1 897 713,27 €

ERSTE GRP 1.875% 19	4 700 000	4 878 460,76 €
ERSTE GRP 7.125%2022	5 900 000	7 672 527,35 €
ESB FINAN 1.75 0229	4 861 000	5 028 357,58 €
ESB FINAN 3.494% 24	3 374 000	3 914 546,97 €
ESB FINANCE 2.125%27	2 700 000	2 942 305,70 €
ESSEX PORT 3.62 22	2 000 000	1 638 823,17 €
ESSILOR 1,75% 090421	2 500 000	2 652 460,69 €
ETP 6.50% 2042	2 490 000	2 208 786,90 €
ETP 9% 15/04/2019	1 222	1 092 790,03 €
EURO INVS 2.625 0448	5 100 000	5 102 550,00 €
EUROC INVS 1.5 0430	5 200 000	5 191 992,00 €
EUROCLEAR 1.125 -26	5 300 000	5 335 939,76 €
EUROGRID 1.875 25	3 900 000	4 181 989,18 €
EUROGRID 3.875% 2020	38	2 115 693,24 €
EUTELSAT 1.125% 21	5 300 000	5 484 575,40 €
EUTELSAT SA 2.625%20	2 000 000	2 090 144,89 €
EVERYTH 3.25%2018	5 580 000	5 763 225,03 €
EVONIK 2125 071122	4 600 000	4 686 556,07 €
EVONIK FIN 0.75 0928	50 000	46 592,20 €
EXELON 2.85% 20	1 100 000	893 434,16 €
EXELON 3497 0622	1 295 000	1 054 154,26 €
EXELON 4% 10-2020	1 850	1 527 296,91 €
EXELON COR 3.95 25	4 175 000	3 444 251,94 €
EXELON CORP 2.45% 21	105 000	83 991,75 €
EXOR SPA 2.125% 22	1 500 000	1 606 462,89 €
EXOR SPA 2.5%10/24	2 500 000	2 734 119,70 €
EXPE 1375 0626	4 900 000	4 923 155,28 €
EXPEDIA 2.50% 22	5 100 000	5 460 103,92 €
EXPEDIA 5.95 20	1 700 000	1 470 877,48 €
EXPEDIA INC 3.8 28	1 950 000	1 471 250,97 €
EXPRESS 3500 0624	3 350 000	2 680 517,54 €
EXPRESS 4.75% 2021	2 000 000	1 721 995,91 €
EXPRESS SCRIPTS 3%23	3 000 000	2 351 945,36 €
EXPRESS SCRPT 4.5%26	3 450 000	2 874 200,52 €
EXXON 2.222% 16-2021	3 250 000	2 606 725,71 €
EXXON MOBI3.043 0326	5 435 000	4 349 877,69 €
FASTIGHET 3000 0678	2 250 000	2 175 235,58 €
FAURECIA 2625 0625	5 800 000	5 826 191,83 €
FAURECIA 3625 0623	2 850 000	3 009 901,23 €
FCA BANK IE 1%1121	3 700 000	3 777 915,40 €
FCA BK I Eurib3 21	5 052 000	5 039 829,17 €
FCA BK IRL 0.25 20	4 797 000	4 799 932,32 €
FCA CAP IRE 1.25% 20	3 473 000	3 584 427,00 €
FCA CAPI 1.375% 20	5 700 000	5 920 050,07 €
FCA CAPI 1250 210121	900 000	924 245,91 €
FCA CPTL IRE 1.25%18	650 000	658 269,78 €
FCC AQ 1413 0622	1 449 000	1 495 428,57 €
FCC AQUA 2.629 0627	2 900 000	3 045 013,11 €
FCE BANK 1.875% 21	7 421 000	7 859 200,71 €
FCE BANK 0869 0921	1 948 000	1 976 726,51 €
FCE BANK 1.528 1120	2 740 000	2 848 780,47 €
FCE BANK 1660 110221	1 500 000	1 558 361,30 €
FCE BANK PL 1615 523	1 500 000	1 555 857,12 €
FEDEX 1625 110127	5 377 000	5 442 362,31 €
FEDEX 3.25%16-2026	500 000	395 552,53 €
FERR 2124 0523	1 200 000	1 158 942,05 €
FERROVEMIS 2.5 24	1 100 000	1 215 240,07 €
FERROVIAL EMISIO	5 100 000	5 143 698,25 €
FERROVIE 1500 0625	3 950 000	4 029 736,08 €
FGA CAPITAL 2% 19	1 930 000	2 006 788,15 €
FIDELI NATIO 2.25%21	3 061 000	2 410 794,17 €
FIDELITY 3.625% 2020	2 510 000	2 099 854,07 €
FIDELITY 3.875% 2024	569 000	474 040,08 €
FIDELITY 4.50% 2022	644 000	558 175,22 €
FIDELITY NATL 3.5%23	817 000	673 318,89 €
FIRST AMERIC 4.60%14	2 900 000	2 431 282,41 €

FIRST HORIZ 3.5 1220	745 000	614 627,27 €
FIRST RP BK 2.375%19	905 000	736 232,28 €
FLA GAS 5.45%0720	1 000 000	862 843,70 €
FLEXTRONICS 5%2023	2 890 000	2 478 786,66 €
FMGRES080 5.125 24	2 000 000	1 645 657,33 €
FONCIERE RE 1875 526	300 000	312 393,45 €
FONCIERE REGIONS	9 700 000	9 594 517,55 €
FONTERRA 0750 081124	3 100 000	3 034 002,70 €
FORD M +127 280322	6 500 000	5 352 077,12 €
FORD MO CR E3M 1222	3 800 000	3 783 402,87 €
FORD MOT 3157 0820	2 450 000	1 991 503,22 €
FORD MOTO 2681 0120	2 600 000	2 106 501,39 €
FORD MOTOR 2.59 19	3 375 000	2 750 819,69 €
FORD MOTOR 3096 0523	6 675 000	5 275 434,57 €
FORD MOTOR 4.25% 22	1 325 000	1 094 653,22 €
FORD MOTOR 4.375%23	1 135 000	943 869,53 €
FORD MOTOR 4.389% 26	1 000 000	816 784,91 €
FORD MOTOR 5.875%21	2 000 000	1 749 766,00 €
FORD MTR 4.346 26	1 770 000	1 442 715,95 €
FORTIS INC 2.1 21	1 925 000	1 511 358,87 €
FORTIVE 2.35%17-2021	2 100 000	1 673 033,30 €
FRA 0000 0323	15 000 000	14 990 850,00 €
FRESN 3000 0132	3 580 000	3 866 483,32 €
FRESNS 2875 0720	2 596 000	2 775 833,04 €
FRTEL 4.125% 2019	1 200 000	1 251 352,77 €
FS INVS CP 4.25 0120	2 450 000	2 023 923,58 €
FTB MEMPHI 2.95 19	4 825 000	3 952 695,33 €
G4S PLC 2.625% 18	920 000	944 267,96 €
GAI BOND IS 3.4 926	2 042 000	1 568 984,13 €
GALP GAS 1.375% 2023	3 900 000	4 014 622,30 €
GAS 1500 0128	1 400 000	1 378 455,59 €
GAS FENOSA 2.875% 24	1 200 000	1 334 345,41 €
GAS N 1125 0424	2 300 000	2 341 736,14 €
GAS NAT 1875 1029	1 000 000	1 005 346,58 €
GAS NAT FE 4.125% 22	1 000 000	1 076 302,88 €
GAS NAT FENOSA F	8 200 000	8 029 069,07 €
GDF SUEZ 2.375% 2026	4 000 000	4 465 179,67 €
GDF SUEZ 3% 2049	11 900 000	12 502 387,34 €
GDF SUEZ 3.875% 49	4 000 000	4 150 088,22 €
GDF SUEZ 4.75% 13-49	5 000 000	5 756 218,06 €
GDYEAR DTE 3.75 23	1 000 000	1 044 394,17 €
GE 4.65% 2021	1 645	1 423 194,41 €
GE CAP 2.625% 2023	1 900 000	2 080 278,95 €
GE CAP EUR FD 0.8%22	7 510 000	7 626 854,85 €
GE CAPIT2.342% 20	8 250 000	6 608 034,11 €
GE EUR FUND 5.375%20	1 200	1 327 554,70 €
GECINA 1.375 06/27	2 700 000	2 711 778,76 €
GECINA 1.5% 2025	4 600 000	4 734 172,32 €
GECINA 1.625 30	6 600 000	6 438 530,56 €
GECINA 2% 24	1 200 000	1 292 705,41 €
GELF BOND 1.75% 21	2 755 000	2 886 707,49 €
GELF BOND 0.875% 22	3 283 000	3 309 590,50 €
GEN ELEC 0.375 05/22	3 556 000	3 550 488,62 €
GEN ELECT 0.875 0525	5 065 000	4 984 212,63 €
GEN ELECT 1.875 % 27	6 000 000	6 284 872,97 €
GEN ELECT 2.125 0537	7 610 000	7 252 944,70 €
GEN ELECTR 1.5 05/29	3 229 000	3 192 951,37 €
GEN ELECTRI 1.25% 23	13 460 000	13 915 834,73 €
GEN ELECTRIC 2.7%22	6 325 000	5 029 348,29 €
GEN ELECTRIC 5%2021	3 797 000	3 099 316,49 €
GEN MOT 2.35% 19	2 400 000	1 952 266,80 €
GEN MOT 4200 010321	2 080 000	1 730 049,46 €
GEN MOTORS 3.2% 20	7 000 000	5 709 572,53 €
GEN MOTORS 3.2% 21	4 130 000	3 351 797,43 €
GEN MOTORS 3.7 0523	4 505 000	3 685 979,02 €
GEN MOTORS 3950 0424	1 075 000	883 620,35 €

GEN MOTORS F 1 0520	3 664 000	3 780 197,53 €
GEN MOTORS FIN	435 000	354 350,12 €
GEN MOTORS FIN	2 225 000	1 807 560,60 €
GEN MOTORS FIN	2 210 000	1 770 655,02 €
GENERAL MTRS 4.2 27	1 885 000	1 501 322,52 €
GENMOTFIN 4.375% 21	4 365 000	3 644 908,00 €
GENMOTFIN 5.25%2026	8 900 000	7 670 540,59 €
GILEAD 2.35%02/20	1 650 000	1 335 076,16 €
GILEAD SCIE 2.5 0923	1 720 000	1 344 116,29 €
GILEAD SCIE 3.25% 22	3 455 000	2 816 951,91 €
GILEAD SCIE 3.5% 25	1 700 000	1 391 623,55 €
GILEAD SCIE 3.65% 26	1 160 000	947 679,44 €
GILEAD SCIENCES	3 000 000	2 471 778,40 €
GLAX 0000 0920	12 336 000	12 306 938,85 €
GLAXO 1000 0926	4 000 000	3 942 846,16 €
GLAXOSMITH. 4%25	584	720 041,98 €
GLEN F LC 3.875 1027	1 600 000	1 260 331,48 €
GLENCORE 4.125% 18	9 794 000	9 797 917,60 €
GLENCORE FI 1.75% 25	2 307 000	2 330 961,69 €
GLENCORE FI 3.375%20	3 000 000	3 288 270,39 €
GLPFI 4375 0421	3 355 000	2 781 570,57 €
GOLD SACH 5% 11/22	2 470 000	1 985 903,52 €
GOLD M L3US 06/28	3 735 000	2 982 892,68 €
GOLD SACHS 2.75% 20	2 350 000	1 892 601,74 €
GOLD SACHS 3.5% 25	3 840 000	3 081 103,33 €
GOLD SACHS 4.25% 25	7 305 000	6 080 550,50 €
GOLDCORP 3.70%13-23	1 700 000	1 378 937,27 €
GOLDM SA L3MUS 0623	12 570 000	10 038 131,85 €
GOLDM SACH 3.75 0226	755 000	605 509,16 €
GOLDMA 3000 260422	1 425 000	1 151 324,15 €
GOLDMA E3M 1220	3 400 000	3 401 852,72 €
GOLDMAN 2.875% 2026	2 500 000	2 801 571,93 €
GOLDMAN 1.625% 2026	4 300 000	4 356 202,11 €
GOLDMAN 2.125% 24	5 500 000	5 867 690,77 €
GOLDMAN 2.625% 2019	6 500 000	5 305 195,25 €
GOLDMAN 2.625% 21	3 200 000	2 576 004,12 €
GOLDMAN 2300 131219	1 805 000	1 461 726,06 €
GOLDMAN 5.125% 10/19	140	7 716 174,81 €
GOLDMAN 5.75%12-2022	3 090 000	2 742 900,00 €
GOLDMAN 6,375%18	1 100	1 170 256,55 €
GOLDMAN S 1.375 0524	9 006 000	9 223 461,40 €
GOLDMAN S.1.25% 2025	3 773 000	3 790 718,55 €
GOLDMAN SA 3.85 0127	9 045 000	7 299 729,27 €
GOLDMAN SACH 2.55%19	5 205 000	4 253 440,99 €
GOLDMAN SACHS 3.2 23	2 600 000	2 091 082,47 €
GOLDMAN SACHS 4% 24	7 800 000	6 451 217,63 €
GOLDMAN SACHS GP	720 000	571 842,18 €
GOLDMAN SACHS GP	1 555 000	1 254 483,83 €
GOODYEAR 5.125% 2023	3 000 000	2 498 440,87 €
GREAT-WEST 2.5%2023	6 693 000	7 468 671,82 €
GROUPAMA E3M 1299	7 700 000	9 408 606,08 €
GRUPO TE 4625 300126	2 785 000	2 330 092,32 €
GRUPO-ANTO 3250 0424	300 000	311 715,83 €
GSACHS G 0.75 19	1 827 000	1 855 624,84 €
GSACHS G 2% 16-2019	2 300 000	1 870 572,74 €
GSACHS G 2.50% 21	500 000	541 598,47 €
GSACHS G 2.60 20	5 500 000	4 473 993,22 €
GSACHS G 2.625% 2020	5 621 000	6 042 417,39 €
GSACHS G 3.25% 23	3 900 000	4 357 111,00 €
GSACHS G 3.50 26	1 000 000	791 673,33 €
GSACHS G 7.5 19	4 000 000	3 413 554,50 €
GUARDIAN LIFE	6 253 000	5 005 295,26 €
HAMMERSON 2% 22	2 250 000	2 400 482,43 €
HANNOVER 3.375% 49	3 800 000	4 163 118,28 €
HARRIS C 4854 270435	1 250 000	1 110 393,54 €
HCA INC 3.75%14-2019	5 195 000	4 241 727,96 €

HCA INC 4.50 27	975 000	767 672,28 €
HCA INC 4.75%12-2023	1 900 000	1 590 286,26 €
HCA INC 5250 150626	1 825 000	1 524 565,39 €
HDLBRG LUX 1.50 27	6 723 000	6 737 495,41 €
HEALTH CARE 4.50%24	2 000 000	1 704 142,78 €
HEALTHCARE 3.5%26	1 550 000	1 208 401,07 €
HEATHROW 1.875% 2022	3 000 000	3 222 195,23 €
HEIDEBGCMNT 2.25%24	2 050 000	2 227 481,35 €
HEIDELCE 1.625 0426	10 035 000	10 326 934,21 €
HEINEKEN 1% 16-2026	16 100 000	16 094 987,78 €
HEINEKEN 1500 1029	2 900 000	2 912 013,97 €
HEINEKEN 2.5%12-2019	3 618 000	3 711 724,98 €
HEINEKEN NV 1.50% 24	2 000 000	2 085 938,63 €
HEINEKEN NV 2% 21	3 700 000	3 982 379,97 €
HELLA FINANCE 1% 24	800 000	812 049,53 €
HEMSO FAST 1.75 0629	3 900 000	3 846 243,04 €
HEMSO FASTIGHET 1%26	1 700 000	1 641 382,36 €
HERA SPA 0875% 26	1 100 000	1 053 660,62 €
HERA SPA 2.375% 24	200 000	221 421,47 €
HEWLETT CO 2.85 18	3 000 000	2 475 842,58 €
HIGHMARK 6.125 0541	3 000 000	2 723 915,52 €
HIT SAS 0.625 23	1 900 000	1 878 584,50 €
HLDG D'INFRA 2.25%25	2 000 000	2 138 281,56 €
HOLCIM FIN 3% 2024	4 140 000	4 619 841,35 €
HOME 2800 0927	6 590 000	5 071 745,55 €
HOME DEPOT 2 0619	6 500 000	5 287 205,76 €
HOME DEPOT 2.125% 26	1 075 000	790 922,83 €
HOME DEPOT 3%16-2026	2 025 000	1 597 667,40 €
HOST H&R 6% 10/21	775 000	678 052,27 €
HOST HOTELS 3.75%23	2 950 000	2 406 558,11 €
HOWARD HUGHES 3.5%23	3 900 000	3 236 478,70 €
HP ENTERPR 2.10 1019	2 500 000	2 028 292,74 €
HP ENTERPR 3.6 10/20	1 380 000	1 150 196,37 €
HSBC 3.90 05/26	5 100 000	4 182 620,64 €
HSBC 4% 30/03/2022	2 000 000	1 661 720,27 €
HSBC 5.1% 05/04/2021	5 000	4 381 618,36 €
HSBC FR 1.625% 12/18	4 600 000	4 682 944,93 €
HSBC FRANCE	3 700 000	3 702 805,25 €
HSBC HG E3M05 1023	3 250 000	3 249 553,94 €
HSBC HLD 3.262% 0323	10 087 000	8 111 365,46 €
HSBC HLD E3M70 0922	10 673 000	10 774 953,24 €
HSBC HO 4,375 231126	690 000	567 012,76 €
HSBC HOL 0875 060924	18 525 000	18 495 707,29 €
HSBC HOL 4.041 03/28	4 650 000	3 773 254,67 €
HSBC HOLD 1.50% 22	5 753 000	5 972 145,11 €
HSBC HOLD 3.375% 24	7 700 000	7 946 685,85 €
HSBC HOLD 6% 27	1 000 000	820 680,03 €
HSBC HOLD L3M 1123	2 790 000	2 238 594,16 €
HSBC HOLDI 2.65 0122	3 000 000	2 388 407,80 €
HSBC HOLDINGS	745 000	619 343,82 €
HSBC USA 5% 27/09/20	1 225	1 034 497,56 €
HUD PAC 3.95 1127	2 378 000	1 880 530,80 €
HUGHES SATEL 6.5%19	3 365 000	2 876 413,55 €
HUMANA INC 3.15% 22	3 320 000	2 692 915,88 €
HUMANA INC 3.95 0327	1 475 000	1 194 362,02 €
HUNT 5700 0718	1 750 000	1 437 017,73 €
HUNTINGTON 3.15 0321	2 000 000	1 621 827,87 €
HUNTSM 425 25	1 189 000	1 347 855,35 €
HUNTSM 5125 150421	6 701 000	7 580 097,68 €
HUNTSMAN 5125 1122	2 978 000	2 539 008,23 €
HUSKY ENE 3950 0422	7 000 000	5 900 884,93 €
HYUNDAI LIBUS 030420	4 000 000	3 251 973,82 €
IBER 1000 0324	2 200 000	2 230 216,61 €
IBERDR IN 1.875 0523	6 300 000	6 227 813,34 €
IBERDROLA 2.875% 20	7 500 000	8 130 317,75 €
IBERDROLA 1.125%2026	2 200 000	2 214 282,02 €

IBERDROLA 2625 1299	2 900 000	2 902 602,05 €
IBERDROLA 3% 22	9 600 000	10 638 981,91 €
IBERDROLA F 1.621 29	1 500 000	1 504 778,67 €
IBERDROLA IN 3.5% 21	2 500 000	2 753 494,02 €
IBM 0.95 23/05/25	2 700 000	2 721 180,31 €
IBM CO 1800 170519	1 650 000	1 340 258,57 €
IBM CORP 1.125% 24	2 400 000	2 461 969,93 €
IBM CORP 1500 230529	2 700 000	2 762 441,01 €
ICADE 1,125% 171125	6 400 000	6 319 261,60 €
ICADE 1.50 130927	2 300 000	2 286 239,25 €
ICAHN EFLC 6.25 22	2 000 000	1 663 249,81 €
IE2 HOLD 2875 010626	3 200 000	3 501 281,30 €
IGD 2.5% 31/05/2021	1 000 000	1 052 805,89 €
ILL TOOL 1.75% 22	2 361 000	2 532 188,84 €
IMCOL 1625 1125	2 200 000	2 180 489,98 €
IMCOL 2500 1129	3 500 000	3 520 855,21 €
IMERYS 2.5% 13-2020	3 100 000	3 305 454,41 €
IMERYS SA 0.875%22	2 100 000	2 133 360,37 €
IMS HEA INC 5 1026	3 000 000	2 485 506,36 €
IN GRP NV 1.125 225	10 900 000	10 852 850,68 €
INBEV NV 4% 0418	3 000	3 120 327,12 €
INEOS FIN 4 05/23	1 000 000	1 037 270,00 €
INFRA FOCH 1.25% 20	2 900 000	2 992 215,41 €
ING 1375 0128	8 800 000	8 678 686,25 €
ING 2.50 01/10/19	1 500 000	1 210 939,00 €
ING BANK 1.25% 2019	3 920 000	4 025 921,99 €
ING BANK 3.625% 26	1 500 000	1 629 155,21 €
ING BANK 4.5% 2022	5 000 000	5 839 324,41 €
ING BANK NV 3.50% 23	4 159 000	4 299 612,94 €
ING BANK TV290523	5 700	6 048 159,12 €
ING BK 5.80% 23	2 425 000	2 132 720,10 €
ING GP NV 1625 0928	11 900 000	11 828 002,66 €
ING GROEP 0750 0322	5 500 000	5 552 301,96 €
ING GROEP 2.50 0229	7 100 000	7 457 549,40 €
ING GROEP 3.15 22	3 998 000	3 204 479,00 €
ING GROEP 3.95 27	380 000	305 868,99 €
ING GROEP NV	5 525 000	4 550 681,94 €
ING GROUP 3000 0418	2 300 000	2 547 772,92 €
INGER 3750 0828	5 195 000	4 225 042,79 €
INMOBILIARIA 1.45%24	14 500 000	14 558 944,12 €
INNOGY 1500 310729	16 810 000	16 388 661,40 €
INNOGY F 1250 191027	4 117 000	4 091 564,26 €
INNOGY FI 1000 0418	2 300 000	2 327 376,50 €
INT LEASE 5.875%2019	3 150 000	2 628 282,01 €
INT PAPER 3.80% 2026	3 900 000	3 155 717,36 €
INTE SANPA 1.75 0328	12 000 000	11 954 612,14 €
INTEL 3.70% 2025	2 065 000	1 723 692,41 €
INTEL CO 3300 011021	1 550 000	1 278 469,06 €
INTEL CORP 2.60 26	3 490 000	2 702 689,88 €
INTEL CORP 2.7% 22	1 600 000	1 293 165,83 €
INTERCONT 2.35 15092	7 750 000	6 067 320,20 €
INTERNATI FL1.75 324	1 020 000	1 069 339,49 €
INTESA 0875 0622	5 050 000	5 117 989,67 €
INTESA E3M 0422	1 750 000	1 782 717,71 €
INTESA SA 4.375%2019	6 700 000	7 280 526,69 €
INTESA SAN 1.125% 22	6 050 000	6 155 026,06 €
INTESA SAN 4% 23	10 418 000	12 313 675,85 €
INTESA SANP 2% 21	13 040 000	13 899 804,27 €
INTESA SANP 4.75% 24	1 300 000	1 407 789,23 €
INTESA SANP 5.25% 24	2 700 000	2 339 742,04 €
INTESA SANPA 3.5% 22	3 400 000	3 791 380,33 €
INTESA SP 6.625%2018	48	2 556 549,04 €
INTL LEASE 6.25 19	1 817 000	1 561 906,90 €
INTL LS FIN 5.875 22	2 000 000	1 759 406,98 €
INTL PAPER 3%16-2027	1 400 000	1 054 715,62 €
INTRUM 2.75 15/07/22	5 850 000	5 754 497,12 €

IREN SPA 1500 241027	6 653 000	6 524 965,90 €
IRON MOUNT 6% 0823	1 625 000	1 370 134,57 €
ISS GLOBAL 1.5 08/27	2 500 000	2 489 340,28 €
ISTAR 5250 0922	1 725 000	1 369 361,21 €
ITALGAS 1125 0324	11 350 000	11 454 445,65 €
ITC 2700 1122	1 775 000	1 411 073,41 €
JAB HDG 1250 0524	5 000 000	5 076 162,26 €
JAB HOLD 1.75% 23	3 000 000	3 173 702,69 €
JAB HOLDINGS	7 500 000	7 713 003,31 €
JAGUAR LR 4.5 27	1 750 000	1 324 214,34 €
JC DECAUX 1%16-2023	3 500 000	3 586 875,81 €
JOHN DE B E3M 1022	2 796 000	2 803 493,28 €
JOHN DEERE 2.8 0323	2 815 000	2 247 101,76 €
JOHNSON 0000 1220	5 278 000	5 264 525,27 €
JOHNSON 1% 150923	13 526 000	13 674 027,86 €
JOHNSON&JOHN 1.65%35	7 000 000	7 365 569,04 €
JP MORGAN 4.5%12-22	20 050 000	17 097 155,14 €
JPM 2604 0221	2 125 000	1 724 992,82 €
JPM 4.625% 2021	7 500	6 466 651,59 €
JPMO CH L3M 01/02/28	10 700 000	8 681 920,44 €
JPMORG CH 3625 1227	2 112 000	1 668 468,36 €
JPMORG CHASE 4.4%20	2 260 000	1 907 889,08 €
JPMORGA 1638 1805828	15 086 000	15 491 908,82 €
JPMORGAN 1.375% 21	4 629 000	4 825 244,82 €
JPMORGAN 1.5% 25	2 120 000	2 179 594,74 €
JPMORGAN 2.625% 21	13 870 000	15 208 636,17 €
JPMORGAN 0000 0528	3 585 000	2 883 935,28 €
JPMORGAN 0625 250124	15 740 000	15 489 320,15 €
JPMORGAN 1.50% 2022	1 400 000	1 466 487,88 €
JPMORGAN 1.875%2019	6 000 000	6 230 543,77 €
JPMORGAN 2.295% 2021	10 770 000	8 520 284,18 €
JPMORGAN 2.55% 20	3 100 000	2 514 251,19 €
JPMORGAN 2.95% 2026	5 050 000	3 855 360,52 €
JPMORGAN 3.20%2023	6 375 000	5 160 567,00 €
JPMORGAN 3.875% 2024	6 900 000	5 606 993,77 €
JPMORGAN 4125 1226	4 050 000	3 343 090,01 €
JPMORGAN 6.75% 49	2 000 000	1 790 080,09 €
JPMORGAN 6000 0823	2 100 000	1 788 057,89 €
JPMORGAN Ch 4.95 320	4 760 000	4 019 594,26 €
JPMORGAN CHASE	545 000	431 920,01 €
KAISER F 3150 010527	3 035 000	2 425 186,73 €
KAISER HOSP 3.5% 22	700 000	578 956,06 €
KANSAS CITY SOUT	920 000	744 421,90 €
KBC GP NV 1.625 0929	3 000 000	3 005 297,01 €
KBC GROEP 2.375% 24	6 200 000	6 467 142,52 €
KBC GROEP 1%16-2021	8 200 000	8 450 052,93 €
KBC GROEP TV 311299	9 980 000	10 349 815,41 €
KBC GRP 0750 010322	4 800 000	4 837 399,82 €
KBC GRP 0750 181023	3 000 000	2 984 356,37 €
KELLOGG 1000 0524	560 000	562 391,04 €
KERING	3 600 000	3 688 717,04 €
KERR-MCGEE CORP	2 400 000	2 283 226,95 €
KEY BANK 1.60 08/19	2 100 000	1 682 001,60 €
KEY BK 3400 200526	3 327 000	2 642 179,62 €
KEYBANK NA 2.25% 20	9 500 000	7 626 746,14 €
KEYCORP 2.9 15/09/20	3 500 000	2 835 630,36 €
KILROY 3450 1224	735 000	585 808,68 €
KILROY RE 4.375 1025	2 000 000	1 654 092,86 €
KIMBELY-CL 0625 0924	5 600 000	5 577 077,34 €
KINDER M 4150 010322	6 000 000	4 970 308,03 €
KINDER MORG 1.50% 22	5 000 000	5 171 589,11 €
KINDER MORG 3.95%22	4 625 000	3 796 802,57 €
KINDER MORGA 4.30%25	5 600 000	4 646 619,05 €
KLEPIERRE 1% 2023	5 500 000	5 627 313,64 €
KLEPIERRE 1.62 32	4 100 000	3 919 188,94 €
KOHL'S CORP 5.55 45	1 075 000	856 990,22 €

KON DSM 0.75% 2026	3 700 000	3 631 084,22 €
KONINKL 0625 090425	3 000 000	2 911 169,05 €
KPN NV 4.25% 22	2 062 000	2 373 451,29 €
KPN TF/TV PERP EUR	1 720 000	1 820 787,29 €
KRAFT FDS 5.375% 24	2 860 000	2 437 699,01 €
KRAFT HEINZ 2.25% 28	5 762 000	5 900 628,91 €
KRAFT HEINZ 3.95% 25	630 000	513 706,43 €
KRAFT HZ 3% 01/06/26	2 400 000	1 821 366,83 €
KRAFT HZ 3.5% 150722	1 280 000	1 047 129,54 €
KROGER 3500 010226	1 775 000	1 398 795,23 €
KROGER CO/THE	3 000 000	2 491 524,71 €
LA BQE POS 1.00 24	4 900 000	4 836 254,11 €
LABO CORP 3.25 0924	7 561 000	6 013 381,24 €
LABOR CORP 2 03/18	730 000	577 185,84 €
LANDS 1000 0523	4 665 000	4 677 418,49 €
LANXESS 4500 1276	1 605 000	1 814 922,57 €
LANXESS AG 1% 26	2 200 000	2 142 637,88 €
IBBW 0,50 070622	4 200 000	4 225 475,47 €
LBP 2.75% 27	1 500 000	1 605 392,36 €
LEAR CORP	1 825 000	1 428 526,04 €
LEASE CORP 2.375% 19	510 000	534 153,96 €
LEASEPL E3M 1120	1 950 000	1 959 514,70 €
LEASEPLAN 0750 1022	7 242 000	7 278 490,08 €
LEASEPLAN 1 240521	2 800 000	2 879 813,54 €
LEASEPLAN CORP	1 700 000	1 748 384,06 €
LEG IMMOBI 1.25 0124	1 000 000	1 009 269,61 €
LEGRA 1000 0326	2 200 000	2 203 353,95 €
LENNAR CP 4.50 19	3 500 000	2 920 522,83 €
LEVI STRAUSS CO TV	250 000	255 805,31 €
LEXINGTON 4.40% 2024	1 700 000	1 383 637,03 €
LIBERTY MUTUAL E	4 411 000	4 506 767,50 €
LIBERTY PR 3.75 0425	2 000 000	1 616 470,85 €
LIFEP HEALTH 5.5%21	3 480 000	2 911 669,01 €
LINCO NA CR 3.8 0328	1 145 000	925 611,11 €
LINCOLN NATL CRP	2 495 000	1 999 721,82 €
LLO BK GR 1.75 0928	7 790 000	7 767 792,00 €
LLOY BKPLC 0625 0124	9 618 000	9 444 607,08 €
LLOYD 2700 0820	2 475 000	1 997 870,47 €
LLOYD 3000 0122	1 400 000	1 125 991,52 €
LLOYD 3574 1128	2 925 000	2 273 678,97 €
LLOYD 4375 0328	1 590 000	1 302 312,98 €
LLOYDS 2907 1123	8 805 000	6 984 430,13 €
LLOYDS 4.582 101225	1 050 000	864 530,64 €
LLOYDS BANK 4.65% 26	2 245 000	1 833 936,91 €
LLOYDS BK 1% 191121	7 000 000	7 190 631,19 €
LLOYDS BK 150 120927	1 700 000	1 684 190,62 €
LLOYDS BK 4.5% 24	2 410 000	2 006 883,24 €
LLOYDS TSB 6500 0320	2 300	2 584 818,21 €
LONDON SE 0175 0929	1 117 000	1 152 383,72 €
LONDON SE 0875 0924	7 362 000	7 372 283,26 €
LOWE'S C 2500 150426	1 725 000	1 314 591,62 €
LOWES CO 3.75% 15-21	4 000 000	3 384 607,88 €
LTD BRAND 6.625 0421	5 340 000	4 607 063,16 €
LVMH 0750 260524	2 000 000	2 022 288,01 €
LVMH MOET 0.37 22	1 826 000	1 835 838,22 €
LVMH MOET 1% 09/21	4 000 000	4 133 737,10 €
LYB INTL FI 4% 23	1 600 000	1 330 434,34 €
M&S L3M 0728	1 825 000	1 444 911,87 €
MACQ 4150 0324	3 600 000	2 927 337,48 €
MACQU 1250 0325	4 609 000	4 564 073,75 €
MACQUA GP L3M 1123	16 416 000	13 036 333,12 €
MACQUARIE 6.625%2021	1 200 000	1 089 175,65 €
MACQUARIE BK 2.60%19	1 400 000	1 141 970,16 €
MACYSRETAIL 2.875%23	2 175 000	1 675 083,95 €
MAGELLAN HLTH 4.4 24	3 650 000	2 942 746,86 €
MAGNA INTL 1.90% 23	2 500 000	2 679 421,95 €

MANPOW 1.875 09/2022	4 803 000	5 136 908,51 €
MANUF&TRADER 2.10%20	5 300 000	4 250 148,80 €
MANULIFE FIN4.15% 26	4 100 000	3 412 192,97 €
MAPFRE 1.625% 26	3 200 000	3 313 308,72 €
MARATHON OIL 2.8% 22	6 160 000	4 861 945,84 €
MARKEL 3.625%2023	4 000 000	3 272 893,71 €
MARRIOTT 3125 150626	1 000 000	778 489,25 €
MARRTTINTL 2.30 22	4 155 000	3 264 753,06 €
MARRTTINTL 3.75 25	2 075 000	1 680 057,97 €
MARSH & MCL 3.75 326	1 500 000	1 218 513,44 €
MASCO CORP 3.5 1127	3 000 000	2 365 231,53 €
MASTER 3500 260228	295 000	242 485,33 €
MASTERCARD 1.10 1222	3 200 000	3 302 984,60 €
MASTERCARD 3.375% 24	1 370 000	1 124 280,59 €
MATCH GROUP INC	2 000 000	1 765 230,17 €
MCCO 3150 0824	3 429 000	2 720 727,55 €
MCDO 2875 1225	2 700 000	3 077 748,49 €
MCDONALD'S 1.125%22	5 000 000	5 185 230,30 €
MCDONALD'S 3.70%26	6 070 000	4 983 214,09 €
MCDONALD'S CORP	700 000	562 948,96 €
MCKESSON CORP	3 000 000	2 436 462,98 €
MEAD JOHNSON 3%15-20	2 200 000	1 805 543,77 €
MEDIO SPA 0.625 0922	1 250 000	1 243 321,13 €
MEDIOBA 0750 170220	3 486 000	3 531 185,20 €
MEDIOBA E3M 180522	1 400 000	1 419 329,64 €
MEDTRONIC 1.375% 18	3 350 000	2 722 193,36 €
MEDTRONIC 3.5% 25	8 825 000	7 189 162,09 €
MERCI 1800 0226	5 000 000	4 999 626,72 €
MERCIALYS 1.787% 23	2 300 000	2 374 300,66 €
MERCK & CO 2.75% 25	520 000	409 555,70 €
MERCK FIN 4.5%10-20	900	981 591,18 €
MERCK NEW 2.80%2023	3 500 000	2 834 662,76 €
MERCK&CO 5%09-2019	3 857	3 268 019,67 €
MERLIN PROP.2.225%23	4 006 000	4 295 045,57 €
MERLINENTT 2.75% 22	1 000 000	1 037 071,39 €
MET LIFE 0.875% 22	5 000 000	5 089 004,87 €
MET LIFE 2.375% 19	7 470 000	7 834 353,28 €
MET LIFE 2.375% 2023	6 006 000	6 531 063,65 €
METLIFE 3% 03/25	1 675 000	1 312 061,77 €
METSA BR 2750 290927	430 000	455 090,09 €
MEXIC SAB 4% 1027	3 000 000	2 355 016,20 €
MEXICO 3875 30/04/28	4 700 000	3 581 127,16 €
MFINANCE 1.398%2020	2 369 000	2 448 402,63 €
MICROSOFT 1.85% 0220	4 804 000	3 873 039,87 €
MICROSOFT 2 080823	3 015 000	2 329 691,63 €
MICROSOFT 2.70% 2025	1 345 000	1 061 000,88 €
MICROSOFT 2875 0224	6 310 000	5 060 529,62 €
MICROSOFT 3.125% 28	6 000 000	7 289 684,14 €
MICROSOFT1550 080821	10 575 000	8 275 113,18 €
MICROSOFT2400 080826	5 530 000	4 192 011,43 €
MITSUB FIN 2.95%2021	4 225 000	3 419 170,95 €
MIZUH 2953 0222	2 000 000	1 599 269,78 €
MOLSON 1.25% 24	4 500 000	4 545 511,42 €
MOLSON C 2100 150721	4 275 000	3 357 118,55 €
MOLSON CO 1.45% 19	1 600 000	1 280 652,65 €
MOLSON COORS	7 212 000	5 468 946,07 €
MOLSON E3M 150319	2 648 000	2 649 356,14 €
MONDELEZ INT 1% 22	600 000	612 534,13 €
MONDI FINAN 3.375%20	1 260 000	1 383 088,85 €
MONDIALE 5.05% 25	2 000 000	2 263 273,33 €
MOR STAN 1.342 1026	10 940 000	10 791 745,95 €
MORG 5.375% 08/20	110	6 371 518,92 €
MORG 5.625% 09/2019	1 850	1 563 053,32 €
MORG 5.75% 01/21	2 500	2 187 443,82 €
MORG Eurib3 11/21	300 000	299 752,95 €
MORGA STA 1.375 1026	2 740 000	2 696 937,96 €

MORGAN EURIB 122019	5 200 000	5 212 553,67 €
MORGAN 1% 12/2022	9 431 000	9 589 926,15 €
MORGAN 2750 190522	2 100 000	1 679 686,00 €
MORGAN 3300 0426	2 190 000	1 719 650,53 €
MORGAN 3625 0127	8 360 000	6 700 240,36 €
MORGAN C&C 2.97 23	7 000 000	5 607 680,07 €
MORGAN C&C 4.35 21	4 000	3 380 802,54 €
MORGAN ST 2.5 0421	6 650 000	5 347 089,89 €
MORGAN STA 3.875% 26	3 869 000	3 159 075,12 €
MORGAN STA 4.875% 22	3 260 000	2 826 296,43 €
MORGAN STAN 1.75% 24	10 685 000	11 061 220,83 €
MORGAN STAN 1.75% 25	2 040 000	2 102 485,39 €
MORGAN STAN 2.375%21	2 258 000	2 396 822,46 €
MORGAN STAN 2.8 0620	900 000	732 508,03 €
MORGAN STAN 3.70% 24	1 158 000	950 875,81 €
MORGAN STAN 3.772 29	1 370 000	1 102 454,76 €
MORGAN STAN 3.875%24	2 000 000	1 667 042,96 €
MORGAN STAN 7.3%19	4 775	4 177 814,93 €
MORGAN STAN.3.125%26	4 935 000	3 811 605,51 €
MORGAN STAN.3.75%23	2 025 000	1 667 779,91 €
MORGAN STAN.3.95%27	1 785 000	1 438 922,57 €
MORGAN STAN.4.35% 26	3 670 000	3 013 410,14 €
MORGAN STANLEY	10 625 000	8 790 436,18 €
MORGAN STANLEY 4% 25	395 000	326 453,61 €
MORGAN STL 3.125 23	4 805 000	3 863 130,10 €
MORGAN STLEY1.875%23	2 200 000	2 307 475,39 €
MOTIVA ENT 5.75 20	2 456 000	2 103 767,31 €
MOVIL SAB 2.125% 28	1 100 000	1 161 461,93 €
MOVIL SAB 5 03/20	742 000	622 165,46 €
MPLX 4000 0328	5 530 000	4 450 804,03 €
MPLX LP 4% 2025	2 500 000	2 037 043,81 €
MPLX LP 3,375 150323	350 000	283 140,78 €
MPLX LP 4125 010327	3 680 000	2 977 682,59 €
MPT 5000 1027	1 775 000	1 444 833,78 €
MPT OP 3325 240325	750 000	767 679,04 €
MPTOPERAT 4 08/22	850 000	944 610,36 €
MS 5.5%26/01/2020	11 000	9 420 244,11 €
MYLAN 1250 231120	1 151 000	1 181 949,87 €
MYLAN INC 4.20 1123	1 325 000	1 107 465,20 €
NASDAQ OMX 3.875%21	2 000 000	2 285 264,16 €
NATION 1500 0326	10 063 000	10 108 674,28 €
NATION L3M 0329	800 000	650 061,39 €
NATIONAL 0.625% 24	2 575 000	2 526 352,12 €
NATIONAL RETAIL	4 413 000	3 485 582,85 €
NATIONWIDE 0625 0423	8 425 000	8 474 222,65 €
NATIONWIDE 3.90%2025	3 000 000	2 478 424,20 €
NATL 0875 1122	3 987 000	4 111 480,09 €
NATL AUSTR 2% 20	8 770 000	9 276 561,48 €
NES FIN IN 1.25 1129	2 150 000	2 167 042,46 €
NESTL 0875 0725	12 232 000	12 348 704,34 €
NEUBERGE BE 4.5 0327	1 896 000	1 585 079,74 €
NEW Y LI GL 3 0128	1 900 000	1 480 507,11 €
NEW YORK L 2.9 0124	3 550 000	2 862 463,63 €
NEWELL RUBB 3.83 423	7 535 000	6 096 459,77 €
NEWELL RUBBE4.2 0426	810 000	651 571,90 €
NEWELL RUBBER TV21	3 450 000	2 776 564,82 €
NEWFIELD 5.75% 22	3 910 000	3 358 916,84 €
NEWS AMER 3%2022	9 338 000	7 501 910,10 €
NEXTERA 3550 010527	2 375 000	1 906 022,98 €
NEXTERA ENGY 2.3 19	1 000 000	808 039,83 €
NGGLN 1.00 120724	4 900 000	4 962 833,05 €
NIBC BANK 2.25 19	2 000 000	2 089 469,23 €
NISOURCE FI 3.85% 23	1 800 000	1 496 558,12 €
NN GP 1625 0627	9 602 000	9 906 612,01 €
NN GROUP 0875 130123	8 021 000	8 152 328,48 €
NN GROUP 1% 2022	8 296 000	8 492 303,72 €

NN GROUP 4625 130148	4 500 000	5 032 842,75 €
NOBLE ENERG 3.9% 24	1 750 000	1 451 268,45 €
NOBLE ERGY 3.85 0128	5 090 000	4 099 736,30 €
NOKIA 3.375 06/22	515 000	407 944,93 €
NOMURA EUR 1.125%20	2 618 000	2 696 610,12 €
NOR 3ERM 0222	4 000 000	4 047 104,00 €
NORD BK AB 0.30 0622	5 000 000	4 995 640,66 €
NORDE 3500 0325	2 383 000	2 336 568,39 €
NORDEA B 1 0926	550 000	555 261,48 €
NORDEA BANK 1.375%18	4 833 000	4 899 302,14 €
NORDEA BANK 4% 07/19	967 000	1 046 304,42 €
NORDEA BK 1.875%25	3 500 000	3 641 860,36 €
NORDEA BK 2.5%20	2 300 000	1 842 171,45 €
NORDSTROM 4% 03/27	5 475 000	4 347 324,06 €
NORTEGAS 0918 280922	1 200 000	1 213 011,15 €
NORTH GRUM 2008 1020	640 000	514 082,71 €
NORTH GRUM 3250 0128	2 719 000	2 145 391,76 €
NORTHERN TRST CO	1 850 000	1 461 879,45 €
NOVA 4875 0624	1 850 000	1 471 622,59 €
NOVA FIN 1.375 0830	3 421 000	3 428 350,66 €
NOVALIS OF 3% 2022	4 300 000	4 413 018,33 €
NOVARTI FIN 0.5 0823	10 080 000	10 098 598,94 €
NOVARTI FIN 1.7 0828	3 797 000	3 782 217,49 €
NUON FI 4500 1219	2 880 000	3 146 270,60 €
NVENT FINANCE	1 350 000	1 101 051,66 €
NVIDIA CORP 3.20% 26	1 229 000	963 284,89 €
NWIDE 2000 0729	5 852 000	5 937 519,45 €
NXP BV FDG 4.625% 23	3 417 000	2 874 779,91 €
NYKREDIT 0.37 20 E	2 922 000	2 949 865,73 €
NYKREDIT 0.75% 21	3 350 000	3 412 723,58 €
NYKREDIT 0875 130619	2 500 000	2 544 929,80 €
NYKREDIT 2.75% 27	4 500 000	4 862 702,52 €
OAT 0% 25/10/2023	330 000	328 194,90 €
OAT 3% 25/04/22	729 433 924	844 650 910,34 €
OAT 3.50% 25/04/20	1 469 642 763	1 639 601 512,33 €
OAT 4.25%07-23	815 626 000	1 021 740 052,95 €
OAT ZCP 25/04/2021	9 831 119	9 926 480,85 €
OAT ZCP 25/04/2022	9 831 119	9 889 122,60 €
OAT ZCP 25/04/2023	9 879 118	9 859 557,35 €
OCCID PETROL 3% 27	1 395 000	1 087 223,20 €
OHIO NAT FI 6.375 20	2 365 000	2 094 768,20 €
OMEGA HE 4500 150125	4 800 000	3 851 045,25 €
OMNICOM 4.45% 2020	1 200	1 009 345,86 €
OMNICOM GP 3.6%26	3 800 000	3 038 702,28 €
OMNICOM GRP 3.65% 24	1 300 000	1 063 213,76 €
OMV 1000 1226	5 700 000	5 622 454,33 €
OMV AG 6.75 0418	2 991 000	3 189 666,73 €
ONCOR 2.95%15-25	2 550 000	1 998 311,52 €
ONCOR ELEC 4.1% 06/2	1 500 000	1 273 916,88 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1 635 000	1 539 536,55 €
ONEOK INC 7.50% 2023	4 143 000	3 963 268,44 €
ONEOK PART 3.8% 20	4 000 000	3 286 514,62 €
OPTUS FINAN 3.5% 20	6 000 000	6 623 589,44 €
ORAC 2950 1124	11 755 000	9 401 610,48 €
ORAC 3250 1127	4 625 000	3 705 979,39 €
ORACL 2625 0223	3 200 000	2 566 556,90 €
ORACLE 3.125% 25	3 200 000	3 816 238,42 €
ORACLE 2.25 10/19	3 400 000	2 783 108,10 €
ORACLE 2.4% 23	2 550 000	1 985 468,96 €
ORACLE 3.875%2020	5 000 000	4 209 276,88 €
ORACLE CORP	1 925 000	1 472 619,39 €
ORACLE CORP 2.5% 22	3 000 000	2 407 651,34 €
ORAN 0.75 110923	4 100 000	4 147 893,45 €
ORANGE 1375 0328	9 600 000	9 561 584,35 €
ORANGE 0.875%16-2027	4 600 000	4 473 569,26 €
ORANGE 1% 052025	3 000 000	3 034 672,21 €

ORANGE 1.375 30	1 700 000	1 658 466,55 €
ORANGE 1625 031119	4 960 000	3 977 763,25 €
ORANGE 2.75% 2019	3 250 000	2 653 920,02 €
ORANGE 4% 49	3 500 000	3 898 500,81 €
ORANGE 5% 29/10/49	700 000	817 699,80 €
O'REILLY AUTO3.55%26	3 000 000	2 383 912,67 €
ORI ENE FI 7.875 671	1 000 000	1 038 041,73 €
PAC GAS&E 3.30 1227	5 000 000	3 905 096,83 €
PACKAGG CORP 4.5% 23	1 950 000	1 685 877,55 €
PACKAGING CP 2.45 20	1 900 000	1 531 627,12 €
PARKER-H 1125 010325	2 900 000	2 910 693,88 €
PARTNERRE 1.25% 2026	7 380 000	7 185 718,27 €
PASO NATL 8.625% 22	875	843 423,23 €
PATTERSON-UTI	1 475 000	1 168 485,73 €
PEMEX 3.75% 03/19	710 000	734 572,67 €
PENSK 3950 0325	3 660 000	2 989 492,69 €
PENSKE TRUCK 4.25%23	1 000 000	847 007,54 €
PEOPLE'S UNT 3.65%22	4 935 000	4 114 696,95 €
PEPSICO 0.875% 2028	3 500 000	3 412 553,47 €
PEPSICO 2% 0421	1 830 000	1 466 367,55 €
PEPSICO 3.60% 2024	1 575 000	1 311 251,37 €
PERNOD RIC 1.875% 23	1 800 000	1 933 656,72 €
PETMX 6500 0327	4 125 000	3 564 907,98 €
PETROLEOS MEXICA	5 125 000	4 123 916,11 €
PEUGE 2000 0325	6 800 000	6 766 557,04 €
PEUGEOT 2 24	5 750 000	5 837 155,82 €
PFIZER 2.75 06/26	1 425 000	1 113 184,33 €
PFIZER INC 0 03/20	2 452 000	2 456 244,41 €
PHILIPPS 66 4.3% 22	1 300 000	1 098 474,25 €
PHILLIPS 3.605% 25	2 200 000	1 758 294,65 €
PIONEER NAT 3.45% 21	875 000	720 657,50 €
PIT BOWES 0470 0423	2 271 000	1 735 423,86 €
PKOBK 0750 0721	2 600 000	2 640 578,28 €
PLAIN 4500 1226	850 000	689 745,09 €
PLAINS ALL 2.6%19	2 925 000	2 357 552,14 €
PLAINS ALL 4.35%25	750 000	621 496,52 €
PNC 3250 0128	1 910 000	1 504 704,05 €
PNC BANK 1.80%2018	1 750 000	1 426 594,71 €
PNC BANK 3.10 1027	4 965 000	3 911 878,94 €
PNC BANK N 2.45%20	3 000 000	2 428 472,31 €
PNC BANK NA	4 000 000	3 177 785,91 €
PNC FUND 3.3% 03/22	2 000 000	1 636 917,78 €
PNC PITTSB 2.15% 25	5 200 000	4 143 752,12 €
POHJOLA BK 0875 0621	4 000 000	4 115 601,75 €
POSTNL 1% 1124	2 800 000	2 793 199,45 €
PPG INDS 0.875 1125	2 500 000	2 476 471,84 €
PPG INDS 0.875 22	3 900 000	3 974 615,96 €
PPG INDUS 0% 19	2 921 000	2 924 183,89 €
PRAXAIR INC 1.5% 20	2 812 000	2 897 140,33 €
PRECISION 3250 0625	3 285 000	2 675 678,38 €
PRICEL GRP 2.375% 24	9 897 000	10 731 340,06 €
PRICELI GP 3.55 0328	1 195 000	942 022,63 €
PRICELIN 3600 010626	3 575 000	2 887 440,74 €
PRICOA GLOB 2.55% 20	5 700 000	4 621 537,38 €
PRINCIPFIN 3.10 26	1 825 000	1 418 959,69 €
PROCTER 4 7/8%27	2 570	3 570 461,47 €
PROGRECRP 5.375 0323	2 100 000	1 725 909,90 €
PROLINTL2 1.87 25	1 350 000	1 426 061,48 €
PROLINTLII 2.875% 22	1 630 000	1 781 573,70 €
PROLOGIS 1.375% 0521	6 700 000	7 007 669,51 €
PROLOGIS 1.375% 20	4 813 000	4 985 232,49 €
PROLOGIS 1750 0328	3 134 000	3 133 933,89 €
PROLOGIS 3% 01/22	6 631 000	7 280 727,10 €
PROLOGIS 3.375% 24	2 500 000	2 847 855,57 €
PROSEGUR CASH	3 100 000	3 028 554,31 €
PROSEGUR SA 1 23	2 100 000	2 113 850,86 €

PROXIMUS 0.5 220322	4 000 000	4 033 520,33 €
PRUD 4.50% 2021	3 000	2 584 376,14 €
PRUDENT 7.575% 2019	1 000	874 004,96 €
PRUDENT FI 3.50 24	1 000 000	824 821,46 €
PRUDENT FI 4.5% 2020	5 350	4 574 590,40 €
PSA BANQ 0625 1022	4 900 000	4 915 726,55 €
PSA BANQUE FR 0.5 20	2 500 000	2 523 571,73 €
PSE&G 3 15/05/25	2 000 000	1 600 731,80 €
PTN RE FIN 5.5 20	4 325 000	3 754 202,29 €
PUBLIC 2650 1122	1 850 000	1 472 961,37 €
PUBLICIS 1.125% 2021	3 700 000	3 809 337,92 €
PUBLICIS GRP 0.50%23	1 500 000	1 480 737,74 €
PUGET ENERGY INC	2 000 000	1 770 715,94 €
PUGET ENGY 6% 21	2 000 000	1 766 806,25 €
PULTEGROUP 5.5%26	1 500 000	1 259 969,37 €
PZU FIN 1.375% 19	4 711 000	4 828 544,58 €
QC INC 2900 0524	2 681 000	2 101 972,65 €
QORVO INC 6.75 23	3 250 000	2 864 616,62 €
QUAL LIM3M 05/20	720 000	586 651,50 €
QUALC 2600 0123	3 750 000	2 930 540,31 €
QUALC 3250 0527	13 685 000	10 666 332,17 €
QUALCOMM INC	1 425 000	1 150 257,19 €
QUINTILE IMS 3.25 25	300 000	301 480,58 €
QUINTILES 2875 0925	1 400 000	1 357 156,31 €
QVC 4.45% 15/02/2025	4 000 000	3 226 160,37 €
QVC 4.85% 14-2024	770 000	634 413,03 €
QVC INC 4.375% 2023	1 250 000	1 016 595,02 €
RABOBANK 2.50% 2026	9 500 000	10 217 693,24 €
RABOBANK 3.75% 2020	11 950	13 196 745,89 €
RABOBANK 3.875% 2023	1 500 000	1 765 716,28 €
RABOBANK 4% 01/22	6 105 000	7 018 914,78 €
RABOBANK 4,75%0622	6 092	7 440 423,20 €
RABOBANK 4.625% 23	2 375 000	2 034 278,43 €
RABOBANK 5.5% 20	10 650 000	11 640 934,53 €
RABOBANK 6.875 0320	4 500 000	5 074 216,65 €
RABOBANK N 2.5 0121	7 000 000	5 624 411,29 €
RABOBANK NL 3.875%22	2 300 000	1 917 592,65 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	7 960	8 887 369,37 €
RAIFF 4500 0625	1 400 000	1 313 709,38 €
RAIFFEISEN BK 4.5%25	6 000 000	6 391 268,89 €
RAYMOND 5620 2424	7 578 000	6 808 785,40 €
RBS GRP PLC 5.375%19	8 300	9 190 295,44 €
RCI 1 17/05/23	2 000 000	2 038 418,04 €
RCI 1.625 04/25	2 800 000	2 920 498,10 €
RCI 2,25% 290321	3 000 000	3 174 852,49 €
RCI BANQUE	5 265 000	5 325 843,03 €
RCI BANQUE 0.5%2023	4 068 000	4 010 005,07 €
RCI BANQUE 0.625% 20	5 000 000	5 056 243,61 €
RCI BANQUE 0250 0721	5 100 000	5 085 333,60 €
RCI BANQUE E3M 0123	2 750 000	2 742 712,65 €
RCI BANQUE E3M 24	4 950 000	4 955 741,45 €
RCI BQE 0750 260922	13 286 000	13 426 350,78 €
RCI BQE 1375 080324	8 250 000	8 443 975,84 €
REALTY 3650 150128	2 350 000	1 871 043,12 €
REALTY IN. 3.875% 24	830 000	683 076,02 €
RECKITT 2750 0624	8 000 000	6 244 987,42 €
RED EL 2,125% 2023	5 400 000	5 925 618,25 €
RED ELECT 1250 0327	5 300 000	5 296 191,55 €
REDEXIS GAS 1.875 27	2 150 000	2 151 938,85 €
REDEXIS GAS 2.75%21	4 000 000	4 367 055,72 €
REGLP FIN 5% 2022	5 160 000	4 378 637,83 €
REGLP FIN 5.875% 22	1 140 000	994 314,53 €
RELFINANCE 0375 321	5 255 000	5 271 496,82 €
RELX CAPI 1.30% 25	7 184 000	7 357 290,11 €
REN 1750 0128	5 850 000	5 886 818,94 €
RENFINANCE 4.75%2020	4 300 000	4 903 046,14 €

REP SVCS 3.375 1127	2 980 000	2 372 693,40 €
REPSOL 2.625% 2020	2 500 000	2 694 411,60 €
REPSOL BV 4.5% 2075	2 000 000	2 187 325,75 €
REPSOL INT 3.875% 21	3 200 000	3 427 621,26 €
RICHEMO INT 2 0338	3 750 000	3 729 274,32 €
RICHEMO INT 1.5 0330	6 676 000	6 660 510,77 €
RIO TINTO 3.75% 25	192 000	159 774,41 €
ROAD FIN 1.625 1224	3 824 000	3 793 097,89 €
ROAD FIN 2.375 1227	3 556 000	3 507 720,24 €
ROCKIES 6.875% 0440	1 500 000	1 447 326,91 €
ROCKWELL 1950 150719	370 000	298 859,58 €
ROCKWELL 3,2 150324	1 360 000	1 075 327,24 €
ROCKWELL COLLINS	1 145 000	898 385,33 €
ROGERS COMM 3.625%25	1 045 000	858 844,11 €
ROPER IND 3.125% 22	2 000 000	1 627 497,93 €
ROPER TE 2800 151221	515 000	415 249,50 €
ROPER TECH 3% 2020	3 000 000	2 452 982,07 €
ROYA BK CA 4.65 0126	3 270 000	2 767 914,01 €
ROYA BK SC 0625 0322	5 690 000	5 669 952,82 €
ROYAL BK 3.875% 2023	17 010 000	13 670 521,68 €
ROYAL BK 4800 050426	3 390 000	2 901 927,47 €
ROYAL BK SCOT 0326	2 865 000	2 894 806,86 €
ROYAL CAR 2.65 1120	2 400 000	1 937 351,16 €
ROYAL L3M 0523	2 755 000	2 267 103,37 €
RTE 1% 26	2 500 000	2 484 149,86 €
RTE RESEAU 1.875 37	4 100 000	4 111 828,45 €
RWE 5,75%33 EMTN	1 400	2 079 862,51 €
RWE FINANCE 1.875%20	5 000 000	5 184 203,86 €
RY SYS IN 2.875 0920	3 500 000	2 833 341,02 €
RYANAIR 1.875% 21	2 613 000	2 783 096,97 €
RYDER SYSTEM 2.5 010	450 000	353 663,45 €
SABINE P 5625 010221	4 200 000	3 623 223,57 €
SABINE PL 5 03/27	1 005 000	851 077,33 €
SABINE PL 5.75 24	11 970 000	10 699 094,89 €
SALINI IMPREGILO	400 000	364 508,49 €
SAMMONS FIN 4.45 27	7 000 000	5 786 172,44 €
SAMPO 1250 0525	15 686 000	15 868 553,54 €
SAMPO OYJ 1 0923	23 950 000	24 241 880,04 €
SAMPO PLC 1.62 28	300 000	297 924,02 €
SAMV 1800 0724	1 950 000	1 883 719,50 €
SANCO 0750 0323	4 200 000	4 213 690,03 €
SANEF 0.95% 1028	3 900 000	3 707 131,64 €
SANOFI 1% 0326	12 200 000	12 256 372,08 €
SANOFI 0 21/03/20	1 000 000	1 002 072,70 €
SANOFI 0.50 0323	16 200 000	16 246 522,85 €
SANOFI 1.375 0330	2 700 000	2 689 840,97 €
SANOFI 1.75% 14-2026	200 000	213 642,06 €
SANOFI 1.875 0328	3 600 000	3 612 608,92 €
SANPAOLO 5.35% 18	14 600 000	15 337 766,01 €
SANT HDGS 3.70 22	5 450 000	4 434 686,91 €
SANTAN 3125 190127	1 700 000	1 844 838,87 €
SANTAN C 0875 240122	2 300 000	2 333 883,10 €
SANTAN CONS 0.90% 20	200 000	203 540,50 €
SANTAN CONS 1 0521	4 000 000	4 124 310,57 €
SANTAN UK 2.87 21	5 000 000	4 002 487,88 €
SANTAND 156 110422	5 800 000	4 867 529,05 €
SANTAND IS 3.25% 26	4 800 000	5 224 507,20 €
SANTAND ISSU 2.5% 25	2 000 000	2 086 661,37 €
SANTAND UK 5 23	5 965 000	5 115 527,82 €
SANTANDER 0.25%2019	900 000	904 568,38 €
SANTANDER 2125 1120	2 050 000	1 638 940,15 €
SANTANDER 2500 0121	2 500 000	2 011 365,43 €
SANTANDER 4.50% 2025	2 825 000	2 356 360,33 €
SANTANDER INTL	10 200 000	10 649 365,16 €
SANTANDEU 1.125 0923	5 700 000	5 762 675,26 €
SANTC BK 0.75 1022	1 800 000	1 810 724,23 €

SANTD 3.5 0422	1 200 000	986 688,35 €
SANUK 3823 1128	2 170 000	1 707 061,67 €
SAP SE 1% 13/03/2026	1 300 000	1 315 948,06 €
SAP SE 1.375 032030	1 300 000	1 309 637,90 €
SAP SE E3M 0321	4 500 000	4 528 620,00 €
SAPRR Eurib3 19	3 400 000	3 421 998,57 €
SCA HYGIE 1.625 327	1 482 000	1 505 922,15 €
SCA HYGIEN 1.125 324	6 250 000	6 322 424,22 €
SCANIA e3m 24/10/18	835 000	836 162,97 €
SCENTRE MG 1.5% 20	6 967 000	7 233 650,94 €
SCENTRE MGM 1375 323	2 306 000	2 381 320,48 €
SCHAEFF 3500 150522	8 500 000	8 712 448,06 €
SCHAEFFLFI 3.25% 25	7 050 000	7 539 365,96 €
SCHAEFFLFI 4.75 23	3 430 000	2 829 741,86 €
SCHLMB NOR 4.20 21	2 303 000	1 942 283,74 €
SCHNEID 0875 1226	2 000 000	1 965 444,46 €
SCOR 3%15-2046	6 100 000	6 534 107,32 €
SCOR SE 3.625 0548	4 100 000	4 582 186,65 €
SEB 0500 0323	3 250 000	3 249 627,13 €
SELECT INCOM 4.15%22	4 825 000	3 950 772,94 €
SELP FI SA 1.50 1125	2 300 000	2 282 917,31 €
SEMPRA 9.8% 15/02/19	815	710 168,05 €
SERVICE COR 5.375%24	2 750 000	2 366 684,12 €
SES 4.625%16-2022	1 176 000	1 236 984,46 €
SES 5.625% 49	3 031 000	3 274 077,48 €
SES GLOBAL GP 2.5%19	3 000 000	2 425 358,11 €
SES SA 3.6% 23	6 700 000	5 435 397,81 €
SG 2.5% 2026	2 900 000	3 081 732,36 €
SG 0.75%15-2020	500 000	510 310,62 €
SG 0750 26/05/23	6 400 000	6 494 159,41 €
SG 13750 0128	1 700 000	1 672 867,01 €
SG 2.625% 27/02/25	1 800 000	1 897 947,43 €
SG 4.25% 2022	3 800 000	4 537 564,28 €
SG Eurib3 03/23	2 300 000	2 286 174,89 €
SG Eurib3 04/22	3 500 000	3 553 180,65 €
SGOB 1125 0326	8 400 000	8 327 002,84 €
SGSP AUSTR 2 22	6 000 000	6 461 226,46 €
SHELL INTF 1.75 21	3 625 000	2 827 729,41 €
SHELL INTL 0.75%2028	3 000 000	2 854 416,07 €
SHELL INTL 1.625% 27	3 170 000	3 321 799,00 €
SHELL INTL FIN	1 435 000	1 158 048,33 €
SHELL INTL2.125% 20	3 275 000	2 643 492,19 €
SHERW WILL 2.75 22	6 765 000	5 399 510,42 €
SHIRE ACQ 1.90% 2019	3 475 000	2 780 954,41 €
SHIRE ACQ 2.875%2023	1 390 000	1 078 204,88 €
SHIRE ACQ IN 2.4 921	5 645 000	4 425 607,79 €
SHIRE ACQ IN 3.2 926	3 991 000	3 030 768,00 €
SIEMENS FIN.2.35% 26	1 950 000	1 459 771,52 €
SIGMA 4875 0328	850 000	687 521,35 €
SIMON INTL 1.375% 22	1 808 000	1 878 153,04 €
SIMON PROP 2.50% 21	8 000 000	6 401 149,20 €
SISIM 1625 0228	6 825 000	6 779 151,22 €
SKANDINAV 2.5% 2026	5 000 000	5 381 759,85 €
SKANDINAV 2.625%2021	2 000 000	1 601 077,37 €
SKANDINAV ENSKIL	3 000 000	2 428 873,44 €
SKF 2.375% 2020	1 800 000	1 918 756,36 €
SKY PL 2.875% 11/20	3 500 000	2 852 888,62 €
SKY PLC 2.50 09/26	1 687 000	1 852 220,60 €
SL GREEN O 3.25 1022	8 893 000	7 184 825,56 €
SLB 0,625% 19	4 560 000	4 593 622,19 €
SMBC 2.25 07/19	6 600 000	5 346 142,21 €
SMITHFI FO 2.65 1021	1 500 000	1 169 740,21 €
SMITHFIELD FOODS	864 000	698 161,63 €
SMURFIT 2375 0224	1 982 000	2 065 177,11 €
SMURFIT AC 4.12 20	1 050 000	1 129 404,50 €
SNAM 0.875% 16-2026	1 400 000	1 346 584,80 €

SNAM 0000 251020	4 512 000	4 502 828,01 €
SNAM 1.25 0125	4 000 000	4 044 830,46 €
SNAM 1375 1027	8 981 000	8 901 504,40 €
SNS BANK TV051125	5 000 000	5 443 537,80 €
SNTDER UK 3.571% 23	5 070 000	4 100 246,88 €
SOC GEN 4% 23	1 800 000	2 103 161,58 €
SOCIETE 1125 0125	11 200 000	11 109 679,34 €
SOCIETE G 1% 04/22	6 000 000	6 075 404,35 €
SOCIETE GE 0.5 0123	4 700 000	4 625 825,10 €
SODEXO 0750 14042027	3 800 000	3 641 576,56 €
SODEXO SA 2.5 0626	625 000	701 971,85 €
SOFTBANK 5125 0927	1 600 000	1 226 482,00 €
SOGE 1375 0228	23 900 000	23 775 933,88 €
SOGECAP 4.125% 99	2 200 000	2 378 346,78 €
SOLVAY FI 4.199% 49	7 000 000	7 515 889,07 €
SOUTHERN P 1.95 1219	2 700 000	2 166 695,94 €
SP GLOBAL 3.30%2020	6 000 000	4 919 437,33 €
SPAREB VT 0.50 1122	2 000 000	1 992 032,05 €
SPCM 2.875 06/23	1 000 000	1 024 094,86 €
SPECTRA PA 3.50 25	1 400 000	1 096 902,87 €
SPECTRA PARTNERS	1 235 000	962 985,69 €
SPI ELECT 2.375% 20	2 700 000	2 889 553,22 €
SPIRT AERO 3.85 26	2 930 000	2 383 142,90 €
SPRINT SPECT 3.36%21	5 000 000	3 537 328,40 €
SPRISPEC 4.738 0325	4 000 000	3 265 664,37 €
ST FONCIERE 1.875%21	5 900 000	6 225 325,48 €
STAND CHART 4.05% 26	4 225 000	3 453 027,56 €
STANDARD 0750 1023	5 200 000	5 173 139,78 €
STANDARD 1625 1027	2 450 000	2 451 139,89 €
STANDARD CH 2.1 0819	3 875 000	3 114 798,21 €
STARBUCKS C 2.45 26	1 625 000	1 241 717,49 €
STATE ST LIBOR 0647	8 000 000	5 907 445,90 €
STATE STREET 1.95%21	3 350 000	2 659 511,66 €
STATE STREET 3.55%25	1 500 000	1 230 268,94 €
STATOIL 2.875% 25	4 000 000	4 655 308,51 €
STATSTREET 2.55%2020	2 400 000	1 941 480,67 €
STDER CS BK 0.375 20	700 000	704 364,64 €
STE AUTO 1.875% 25	2 600 000	2 782 988,83 €
STE AUTO 2.25% 20	2 000 000	2 090 873,84 €
STE FONCIERE 2.25%22	3 900 000	4 184 542,41 €
STGOBAIN 4.50 19	1 230	1 341 687,08 €
STO EN OYJ 2.5 0328	1 400 000	1 379 922,47 €
STRYKER CO 3.37 24	2 000 000	1 641 318,05 €
SUEDZ 1000 1125	4 000 000	3 929 914,61 €
SUEDZUCKER 1.25 23	200 000	205 451,01 €
SUEZ 1.625% 21/09/32	2 800 000	2 805 647,34 €
SUEZ 2875 1299	600 000	630 821,16 €
SUEZ CO 1 030425	3 300 000	3 323 624,69 €
SUEZ ENVIRON 3% 2020	2 700 000	2 879 245,60 €
SUMIT MIT 10.74 1022	6 000 000	4 899 545,47 €
SUMIT MITSU 2.058%21	5 400 000	4 242 924,99 €
SUMITOMO 2.25%20	4 789 000	5 102 123,87 €
SUMITOMO MI 0.934 24	4 000 000	4 005 118,33 €
SUMITOMO MITSUI	2 500 000	2 025 363,52 €
SUMITOMO MITSUI	7 000 000	5 578 564,87 €
SUMITOMO MITSUI	100 000	101 786,96 €
SUMITOMO MITSUI 1%22	3 390 000	3 473 484,50 €
SUNOCO LOG 4.25% 24	1 675 000	1 351 189,97 €
SUNOCO LS 4 011027	1 010 000	779 086,02 €
SVB FINANC. 5.375%20	3 500	3 005 522,01 €
SVENSKA 1250 020328	7 822 000	7 834 324,63 €
SVENSKA 2.656% 24	2 600 000	2 664 034,37 €
SVENSKA HAND 2.4% 20	11 400 000	9 112 708,06 €
SVENSKA HND 1.875%21	5 250 000	4 082 241,23 €
SVENSKA HNDL 1.95 20	2 659 000	2 107 750,54 €
SVENSKA HNDL 2.45%21	6 300 000	5 015 176,85 €

SVENSKA HNDLSBKN	24 356 000	25 196 277,93 €
SWEDBANK 0250 1122	4 065 000	4 027 547,93 €
SWEDBANK 0300 0609	5 000 000	4 978 552,64 €
SWEDBANK AB 2.8 0322	4 725 000	3 787 560,07 €
SWEDBANK VRN 24	4 200 000	4 290 709,64 €
SWISS BV 2.6% 25	9 300 000	9 564 059,26 €
SYDNEY AIR 2.75% 22	11 300 000	12 688 039,94 €
SYNCHR 3000 0622	3 200 000	2 540 927,76 €
SYNCHRON 3.95 27	2 350 000	1 831 209,79 €
SYNCHRON 4.25 24	4 585 000	3 723 871,75 €
SYNCHRONY FI 2.75%20	410 000	331 293,74 €
SYSCO CORP	2 210 000	1 733 069,95 €
TALANX AG 3.125% 23	8 000 000	9 069 293,78 €
TALANX E3M 1247	10 100 000	9 739 685,13 €
TALLGRASS NRG	1 775 000	1 493 289,02 €
TCP 3900 0527	855 000	680 208,81 €
TD AMERITR 3.3 0427	625 000	494 345,51 €
TD AMERITR 3.62 25	2 750 000	2 253 511,66 €
TDC 1.75% 27	4 210 000	4 202 270,98 €
TDF 2.5% 07/04/26	4 200 000	4 526 010,81 €
TDF INFRA TF 22	1 000 000	1 100 688,41 €
TEL.ITA.7,75%33	1 000	1 503 003,01 €
TELE ITAL 2375 1027	1 570 000	1 555 668,91 €
TELECOM 5.25% 2055	4	458 383,62 €
TELECOM 7.721%08-38	1 480	1 498 787,70 €
TELEF EM 1.447 0127	7 300 000	7 211 635,37 €
TELEF SAU 1.477% 21	8 100 000	8 494 120,74 €
TELEF SAU 5.462 21	1 625 000	1 410 871,47 €
TELEFO 2625 0623	4 900 000	4 827 927,13 €
TELEFON E 1.528 125	6 000 000	6 159 984,31 €
TELEFON.5 7/8%33	1 550	2 296 530,97 €
TELEFONIC 0.318% 20	5 000 000	5 033 495,42 €
TELEFONIC 1715 0128	3 200 000	3 196 235,77 €
TELEFONICA 0.75%2022	800 000	814 626,94 €
TELEFONICA 2.242% 22	4 300 000	4 693 223,36 €
TELEFONICA 3.75% 22	2 200 000	2 294 368,55 €
TELEFONICA 4.71%20	8 300 000	9 086 999,70 €
TELEFONICA 8.25%30	1 500	1 647 987,56 €
TELEFONICA EMIS	6 366 000	5 169 611,83 €
TELEFONICA EUROP	6 300 000	6 235 100,51 €
TELEFONICA TVPERP.	3 000 000	2 966 790,41 €
TELEKFIMA 3.125% 21	15 353 000	17 088 590,73 €
TELEKOM FIN 1.5%26	17 200 000	17 587 705,47 €
TELFON DEUT 2.375%21	6 473 000	6 869 619,68 €
TELIA CO 3000 040478	1 500 000	1 554 675,15 €
TELSTRA 1.125 0426	4 767 000	4 824 105,71 €
TENNET H 2995 010624	7 300 000	7 636 587,80 €
TENNET HL 0.75 06/25	2 000 000	1 990 452,84 €
TEOLL VOIM 2.625%23	3 005 000	3 177 803,56 €
TERNA 4.875%10/19	567	622 484,11 €
TERNA SPA	10 850 000	10 843 577,35 €
TES L LP 6.25% 10/22	196 000	169 894,82 €
TES LOG L 6.375 0524	2 810 000	2 486 894,36 €
TESORO 5.125% 2024	1 250 000	1 054 320,36 €
TESORO C 5375 011022	1 355 000	1 128 520,61 €
TEVA FNC 1,25% 03/23	2 750 000	2 485 854,21 €
TEVA PH 2200 011021	1 635 000	1 200 369,31 €
TEVA PHA 6.75 0328	2 375 000	1 908 559,73 €
TEVA PHARM 0.375% 20	2 222 000	2 165 448,58 €
TEVA PHARM 1.125% 24	5 466 000	4 572 749,27 €
TEVA PHARMA 1.70%19	1 590 000	1 250 699,74 €
TEVA PHARMA 2.80% 23	575 000	397 579,18 €
THALES 0750 0125	600 000	593 245,74 €
THERM 1400 0126	6 790 000	6 800 821,82 €
THERMO 1450 0327	3 250 000	3 227 499,91 €
THERMO 3200 0827	1 305 000	1 014 105,13 €

THERMO FISH 2.95%26	2 150 000	1 635 051,05 €
THERMO FISH3.3%02/22	2 350 000	1 917 776,56 €
THERMO FISHE 0.75%24	5 289 000	5 210 566,68 €
THERMO FISHER 3% 23	370 000	297 185,35 €
THYSS 1.375 030322	3 350 000	3 364 825,36 €
THYSSENKR 3.125% 19	1 000 000	1 049 734,25 €
TIME WAR 3.6% 25	3 695 000	2 939 806,11 €
TIME WARNR 3.80 27	2 135 000	1 688 290,80 €
TJX COS 2.25% 2026	1 740 000	1 279 048,91 €
TLG IM 1375 1124	2 600 000	2 585 860,99 €
TMCC 2 24/10/18	6 575 000	5 380 253,41 €
T-MOBILE 6500 150126	1 625 000	1 420 348,35 €
T-NOTE 1.875 19	6 355 000	5 157 605,94 €
T-NOTE 2.25 02/21	2 834 000	2 302 473,20 €
TOLL B FIN 4.375 423	3 500 000	2 870 738,98 €
TORO 1850 0920	8 050 000	6 386 788,61 €
TORONTO 0375 120121	6 500 000	6 585 141,98 €
TORONTO BK 2.5% 20	4 000 000	3 233 010,35 €
TORONTO DM 1.80 21	5 125 000	4 012 947,72 €
TORONTO DO 3.625% 31	2 875 000	2 243 761,18 €
TOTAL CAP 0625 1024	3 200 000	3 186 193,08 €
TOTAL CAP 1375 1029	8 200 000	8 308 152,78 €
TOTAL CAP 2.875% 25	500 000	577 794,71 €
TOTAL CAPI 0.75%28	7 000 000	6 699 887,97 €
TOTAL S.A. 2.708% 49	7 200 000	7 710 337,12 €
TOTAL S.A. 3.369%26	5 155 000	5 558 001,64 €
TOTAL SA 2.25% 49	30 060 000	31 112 130,72 €
TOTAL SA 2.625% 49	7 572 000	7 775 921,99 €
TOTAL SA 3.875% 22	5 138 000	5 804 375,82 €
TOTAL SYSTE 3.8 0421	5 965 000	4 900 244,28 €
TOY FIN AUS 0.5 0423	1 750 000	1 746 202,50 €
TR INFR 2.2 05/08/25	4 300 000	4 668 645,02 €
TRANS ALLEGHENY 3.85	2 275 000	1 892 452,27 €
TRANS-CANADA 3.8% 20	1 000	828 345,82 €
TRANSCANADA 5.875%76	990 000	852 593,24 €
TRANSURBA 3.375 0327	2 725 000	2 089 690,13 €
TRINITY A 2.12512 22	4 874 000	5 202 577,80 €
TRINITY ACQ 3.5% 21	1 735 000	1 412 476,36 €
TWARN CABL 4% 21	6 000 000	4 921 602,91 €
TWARN CABL 4.125%21	1 500 000	1 237 504,57 €
TYCO ELEC 3.125 0827	775 000	606 575,53 €
TYCO ELECTR 1.1% 23	8 131 000	8 360 224,75 €
TYSON 3550 0627	5 625 000	4 459 256,97 €
TYSON FOODS 2.65% 19	3 300 000	2 678 218,48 €
UA 2014 1 4% 0426	1 250 000	897 350,80 €
UBS 0250 0122	6 923 000	6 889 037,45 €
UBS AG 4.75% 2026	11 895 000	13 155 764,26 €
UBS AG LD 1.125% 20	6 600 000	6 823 800,01 €
UBS AG LOND 1.25% 21	4 610 000	4 800 022,91 €
UBS AG STA 2.35% 20	5 000 000	4 010 192,07 €
UBS E3M 0120	2 900 000	2 918 702,10 €
UBS GRO F 3.491 0523	1 875 000	1 529 860,94 €
UBS GROUP 1.75% 22	5 430 000	5 717 472,26 €
UBS GROUP FUNDIN	1 000 000	1 064 396,10 €
UBS GROUP FUNDIN	4 500 000	4 478 290,71 €
UBS GROUP FUNDIN	8 000 000	6 611 677,17 €
UBS LDN 0125 051121	7 540 000	7 497 996,95 €
UDR 4.625% 01/2022	2 000 000	1 706 066,91 €
UDR INC 3.50 0727	4 887 000	3 851 403,60 €
UNI DI BAN 0.75 1022	8 382 000	8 353 872,55 €
UNIBAIL-RODAM 2.5%24	6 000 000	6 619 481,08 €
UNIC 1000 0123	12 166 000	12 105 880,40 €
UNICREDIT 1.5% 19	700 000	721 067,70 €
UNICREDIT 2.125% 26	5 200 000	5 499 599,08 €
UNICREDIT 4.375% 27	3 520 000	3 846 365,72 €
UNICREDIT 5.75%2025	3 980 000	4 485 819,83 €

UNICREDIT 6,7%0618	5 200	5 541 583,73 €
UNICREDIT 6.95% 22	2 350 000	2 940 352,19 €
UNICREDITO 3.25% 21	11 105 000	12 122 313,37 €
UNILEVER N 0.375 223	7 609 000	7 567 888,77 €
UNILEVER NV	3 650 000	3 644 124,66 €
UNILEVER NV 0875 725	4 400 000	4 423 230,39 €
UNILEVER NV 1 0227	3 991 000	3 926 462,21 €
UNION PAC 4% 21	3 000 000	2 527 012,78 €
UNIONE DI BA 4.25%26	2 912 000	3 116 743,92 €
UNIPL 3500 1127	4 000 000	4 048 688,77 €
UNIPOLSA 3875 010328	1 000 000	983 029,59 €
UNIQA INS.6.875% 43	2 000 000	2 518 927,95 €
UNIT TECH 1.125% 21	1 780 000	1 835 527,30 €
UNITED 2500 0423	5 165 000	4 066 648,01 €
UNITED 2800 0524	2 005 000	1 572 664,20 €
UNITED 4150 0327	7 000 000	5 717 798,69 €
UNITED PARCEL	9 090 000	8 999 821,90 €
UNITEDHEALTH 3.10%26	1 125 000	886 187,34 €
UNITEDHEALTH 3.75%25	4 825 000	4 010 672,14 €
UNITYMEDHN 4 25	3 400 000	3 610 044,45 €
URENCO FIN. 2.25% 22	5 000 000	5 431 354,54 €
US 2250 1127	491 400	386 256,48 €
US AIR 3.95%13-2025	10 000 000	6 414 972,20 €
US BANCORP	1 545 000	1 316 818,80 €
US BANCORP 1.95% 18	3 300 000	2 693 517,50 €
US BANCORP 2.95 22	3 200 000	2 585 191,15 €
US BANCORP 3.10% 26	1 050 000	823 977,72 €
USA 2750 0228	1 865 000	1 522 929,00 €
USA 2000 1022	1 615 000	1 293 696,34 €
USBK 0850 0624	12 832 000	12 831 718,84 €
UTD HEALTH 2.875% 23	1 500 000	1 198 777,29 €
VALE ENE PA 4.5 0328	1 800 000	1 472 682,03 €
VALEO SA	1 000 000	995 854,79 €
VALEO SA 0625 110123	1 800 000	1 809 585,24 €
VALEO SA 1625 0326	1 400 000	1 442 880,39 €
VALERO ENE 3.40 26	1 000 000	782 168,56 €
VALERO ENE 3.65% 25	1 080 000	873 681,67 €
VALIDUS HLDGS	1 590 000	2 010 492,99 €
VENTAS REAL.4.125%26	1 197 000	987 935,00 €
VEOLIA ENV 0 1120	2 000 000	1 997 391,60 €
VEOLIA ENVR 0.314 23	3 500 000	3 446 877,00 €
VEOLIA ENVRNMT	4 300 000	4 466 916,49 €
VEOLIA ENVT 4.45%49	10 200 000	10 651 829,25 €
VEREIT OP 4.87 26	3 600 000	2 984 298,09 €
VERI COM 1.875 1029	9 436 000	9 364 824,32 €
VERISK ANAL 4% 25	5 060 000	4 190 931,58 €
VERIZON 3.376% 0225	5 926 000	4 742 059,23 €
VERIZON 4.125 27	5 389 000	4 442 426,83 €
VERIZON COM 0.875%25	7 000 000	6 856 371,52 €
VERIZON COM 1.375 26	3 593 000	3 570 788,89 €
VERIZON COM 1.75% 21	4 000 000	3 111 642,34 €
VERIZON COM 2.625%20	1 879 000	1 525 174,00 €
VERIZON COM 2.875 38	3 903 000	3 914 891,68 €
VERIZON COM 2.946%22	2 805 000	2 249 982,45 €
VERIZON COMM 3% 2021	11 295 000	9 216 160,39 €
VERIZON COMM 5.15%23	11 115 000	9 774 575,38 €
VERIZON COMM INC	2 000 000	1 629 268,25 €
VERIZON COMM INC	1 500 000	1 115 282,35 €
VESTEDA FI 1.75 19	2 179 000	2 245 010,57 €
VIACOM INC 3.875% 24	800 000	644 830,04 €
VIER GAS T 2.87 25	1 300 000	1 516 911,59 €
VIER GAS TRANS 2%20	1 620 000	1 714 391,86 €
VIMPELCOM 4950 0624	3 350 000	2 723 453,17 €
VISA INC 2.2% 20	6 500 000	5 235 998,06 €
VISA INC 2.80 122022	1 000 000	809 015,55 €

VISA INC 3.15% 12/25	1 500 000	1 209 278,57 €
VIVAT NV 2.375 05/24	3 090 000	3 235 923,26 €
VIVENDI 0.75%16-2021	2 100 000	2 142 714,64 €
VIVENDI 1.125%16-23	1 900 000	1 940 077,59 €
VMWARE I 2.95 210822	3 000 000	2 353 047,12 €
VODAFO GP 1.125 1125	3 175 000	3 126 162,65 €
VODAFONE 0.50% 24	2 950 000	2 877 669,28 €
VODAFONE 0375 221121	1 150 000	1 152 061,19 €
VODAFONE 2.50% 2022	2 552 000	1 993 803,54 €
VODAFONE 2.95% 2023	2 350 000	1 864 571,34 €
VOLK LE 1.125 0424	250 000	250 160,13 €
VOLK BK 1.25 1225	5 858 000	5 805 087,76 €
VOLKS 1375 0125	6 579 000	6 638 922,66 €
VOLKS BK 0.75 0623	6 733 000	6 701 609,23 €
VOLKS BK E3M 0621	1 300 000	1 299 924,17 €
VOLKS IF 3.30% 2033	2 900 000	3 294 805,25 €
VOLKS LEAS 2.625% 24	9 472 000	10 350 111,30 €
VOLKS LEAS 3.25 %18	7	722 865,16 €
VOLKSW F 1.875 0327	15 500 000	15 677 703,62 €
VOLKSWA 1.125 1023	3 400 000	3 452 693,65 €
VOLKSWAGEN 0.75%20	1 900 000	1 937 740,68 €
VOLKSWAGEN 2.125% 22	3 300 000	3 502 168,23 €
VOLKSWAGEN 3.875% 18	11 500 000	11 905 913,77 €
VOLKSWAGEN 4.625% 26	2 320 000	2 528 670,16 €
VOLKSWAGEN PERP	8 500 000	8 888 130,65 €
VOLKSWAGEN PERPET	9 600 000	9 786 826,17 €
VOLVO 4200 10/06/75	4 200 000	4 605 470,15 €
VOLVO CAR 3.25% 21	1 550 000	1 677 065,56 €
VONOVIA BV 075 0124	4 600 000	4 531 844,04 €
VONOVIA BV 1.5 0326	9 100 000	9 116 236,65 €
VONOVIA BV 2.75 0328	1 500 000	1 518 726,68 €
VONOVIA FI 1.50 26	1 800 000	1 814 987,84 €
VONOVIA FIN 2.25% 23	3 500 000	3 768 591,13 €
VOYA FIN 3.125 0724	2 000 000	1 576 632,65 €
VOYA FIN 3650 0626	2 869 000	2 296 786,31 €
WALBOOTS3.3%11/2021	1 600 000	1 310 969,63 €
WALG BOOT 3.8%11/24	1 260 000	1 024 095,13 €
WAL-MART 3.30% 2024	1 500 000	1 246 967,11 €
WASTE 3150 1127	855 000	669 433,68 €
WASTE MAN 2.4 0523	2 545 000	1 998 110,05 €
WATSON PHA 3.25%2022	3 871 000	3 080 623,40 €
WELLS 2625 0722	2 275 000	1 797 075,34 €
WELLS 1500 0527	300 000	303 269,61 €
WELLS 2400 0120	1 000 000	809 689,53 €
WELLS FA 2500 0321	2 000 000	1 596 835,21 €
WELLS FAR 1.625% 25	4 289 000	4 471 811,71 €
WELLS FAR 1375 1026	1 700 000	1 702 764,87 €
WELLS FAR 3.5% 03/22	13 035 000	10 667 751,97 €
WELLS FAR 5.875% 25	2 305 000	2 003 842,20 €
WELLS FARG 3000 0426	4 500 000	3 490 767,17 €
WELLS FARGO 1.125%21	3 873 000	3 990 122,39 €
WELLS FARGO 1.5%22	10 587 000	11 049 556,21 €
WELLS FARGO 2% 26	1 100 000	1 172 579,68 €
WELLS FARGO 2.15%20	4 700 000	3 774 684,51 €
WELLS FARGO 2.25% 23	3 494 000	3 819 495,36 €
WELLS FARGO 3% 2026	9 095 000	7 018 227,60 €
WELLS FARGO 4.10% 26	2 425 000	1 988 597,93 €
WELLS FARGO 4.6%2021	4 000	3 380 007,50 €
WELLS FARGO 7.98% 18	3 289 000	2 706 992,58 €
WELLTOWER 4 0625	6 000 000	4 936 677,92 €
WENDEL SA 1% 0423	2 700 000	2 715 961,44 €
WESFARMERS 2.75% 22	6 250 000	6 990 751,28 €
WEST 4750 0226	2 325 000	1 900 129,52 €
WESTERN GA 5.375% 21	1 610 000	1 387 760,54 €
WESTERN GAS 4%2022	800 000	655 775,73 €

WESTERN GAS PART	1 060 000	865 630,04 €
WESTP BKGN 1.60 19	5 000 000	4 007 462,52 €
WESTPAC 0375 050323	6 000 000	5 914 148,51 €
WESTPAC BANK 2.85%26	3 375 000	2 609 312,11 €
WESTPAC BANKING	10 000 000	9 818 137,97 €
WESTPAC BKG 0.5 25	4 170 000	4 132 305,67 €
WESTROCK 3% 09/24	2 748 000	2 142 025,61 €
WHI POFIN 1.10 1127	6 000 000	5 811 253,20 €
WILL PART 4.30% 24	2 350 000	1 939 758,21 €
WILL PART 5.25% 2020	1 141	964 165,18 €
WILLIAMS PAR 3.9%25	2 400 000	1 937 524,09 €
WILLIS N 3600 150524	245 000	198 077,77 €
WILLOW NO.2 3.375%22	6 430 000	7 375 843,85 €
WLLS FRG CO 3.069 23	7 550 000	6 056 343,45 €
WOLTERS 1500 0327	2 547 000	2 581 897,84 €
WOLTERS K 6.375%18	2 370	2 521 234,57 €
WOLTERS KW 2.87% 23	900 000	1 002 822,70 €
WOODSIDE FIN.3.70%26	2 800 000	2 220 329,31 €
WORLDPAY FIN 3.75%22	4 959 000	5 402 429,65 €
WPP 1375 0325	16 058 000	16 024 520,18 €
WPP FINAN 0.75% 19	3 470 000	3 520 319,75 €
WPP FINANC 3.625%22	3 100 000	2 519 644,65 €
WPP FINANCE 1.625%30	8 200 000	7 778 405,59 €
WYNDHAM WORLDWID	3 530 000	2 842 283,61 €
WYNDHAM WORLDWID	2 250 000	1 819 119,20 €
XEROX 2.75% 19	2 840 000	2 305 518,40 €
XILINX 2950 0624	385 000	303 982,75 €
XLIT 3250 0647	1 600 000	1 648 552,11 €
XLIT LTD 4.45 25	1 075 000	878 653,82 €
YOR BLD S 0.875 0323	2 450 000	2 456 365,32 €
YORKSH BLD 2.125%19	4 000 000	4 087 485,30 €
YORKSHRE BLD 1.25%22	3 550 000	3 634 954,47 €
ZAPA 1750 0328	1 096 000	1 100 035,68 €
ZF NA CAP 2.75% 23	6 500 000	7 162 584,15 €
ZFNA 4750 0425	3 400 000	2 858 779,62 €
ZIMMER BIO 2.425%26	3 650 000	3 839 436,81 €
ZIMMER BIOM 1.414%22	2 000 000	2 061 466,10 €
ZOETIS 3.25%13-2023	6 000 000	4 863 116,10 €
ZUERCH KBK 2.625%27	8 000 000	8 477 295,34 €
ZURICH 7.50%09-2039	215	12 293 396,65 €

TITRES DE CREANCES NEGOCIABLES

Encours sous gestion dans la poche

582 413 303 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2018
CR07 -0.3% 07/02/18	3 300 000	3 304 259,44 €
CR16 0.00% 08/02/18	25 000 000	20 197 492,19 €
CR16 0.00% 19/10/17	50 100 000	40 700 655,50 €
CR16 -0.3% 02/02/18	24 000 000	24 029 788,93 €
CR16 -0.3% 03/04/18	20 000 000	20 024 443,93 €
CR16 -0.3% 05/02/18	6 500 000	6 508 325,43 €
CR16 -0.3% 09/02/18	16 500 000	16 551 348,97 €
CR16 -0.3% 10/01/18	11 000 000	11 000 177,96 €
CR16 -0.3% 12/12/17	2 500 000	2 500 033,16 €
CR16 -0.3% 16/01/18	15 000 000	15 000 072,73 €
CR16 -0.3% 16/02/18	13 000 000	13 000 137,20 €
CR16 -0.3% 20/02/18	3 000 000	3 004 258,02 €
CR16 -0.3% 21/04/17	17 000 000	17 003 440,14 €
CR16 -0.3% 23/02/18	8 500 000	8 500 097,70 €
CR16 -0.3% 26/03/18	3 000 000	3 002 636,40 €
CR16 -0.3% 26/03/18	1 000 000	1 000 013,69 €
CR16 -0.3% 27/03/18	9 000 000	9 000 123,28 €
CR16 -0.3% 27/10/17	17 500 000	17 500 126,53 €
CR16 -0.3% 27/11/17	3 000 000	3 001 657,03 €
CR16 -0.3% 28/02/18	16 000 000	16 000 197,70 €

CR16 -0.3% 28/08/17	21 000 000	21 012 851,15 €
CR16 -0.4% 03/08/17	5 000 000	5 001 663,39 €
CR16 -0.4% 08/03/18	5 000 000	5 000 065,09 €
CR16 -0.4% 12/01/18	1 000 000	1 000 121,68 €
CR16 -0.4% 12/01/18	5 000 000	5 000 018,76 €
CR16 -0.4% 13/02/18	24 500 000	24 510 609,45 €
CR16 -0.4% 16/08/17	15 000 000	15 020 096,00 €
CR16 -0.4% 22/01/18	10 000 000	10 000 064,54 €
CR16 -0.4% 23/03/18	16 000 000	16 000 218,96 €
CR16 -0.4% 26/01/18	19 500 000	19 522 833,26 €
CR16 -0.4% 27/07/17	10 000 000	10 003 025,92 €
CR16 -0.4% 28/02/18	19 000 000	19 011 372,13 €
CR16 -0.4% 30/01/18	7 000 000	7 000 054,21 €
CR16 0.00% 28/06/18	25 200 000	20 401 682,56 €
CR16 27/10/17	2 000 000	2 004 165,44 €
CR31 0.00% 12/10/17	50 240 000	40 827 728,35 €
CR31 0.00% 25/05/17	100 500 000	81 513 458,19 €
CR36 -0.3% 14/09/17	3 700 000	3 706 163,78 €
CR36 10/10/17	25 000 000	25 047 824,65 €

ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIFS

Encours sous gestion dans la poche	8 926 444 076 €
---	------------------------

Libellé des fonds	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/03/2018
ABERDEN GL EMERG MKT	18 609 336,77	162 294 721,59 €
ACADIAN GLBL EQTY	310 000,00	5 632 700,00 €
AMUNDI 3M I2	59 043,73	589 173 845,01 €
AMUNDI CASH INSTITUT	79 436,82	792 524 682,01 €
AVIVA I EMERG. MARKET	75 257,92	92 536 152,63 €
AXA WORLD FUNDS	1 522 453,53	286 924 649,06 €
BLACKROCK GLOBAL FD	8 682 237,52	197 244 961,83 €
BNP PARIBAS AQUA I	265,00	10 062 259,35 €
BNP PARIBAS INVEST3M	170,91	171 667 201,17 €
BNPP MOIS	179,09	4 132 945,18 €
BNY MELLON GL-EMM	82 016 643,84	118 871 949,95 €
BRSF SIC	1 269 742,25	126 050 194,17 €
CARMIGNAC EMR PATRIM	521 259,74	64 396 428,16 €
CIP EM.TOT.OPP A7C	7 299 270,07	81 386 861,28 €
COMGEST EMERG 3DEC	7 498 824,00	262 246 957,14 €
DIMENSIONAL EMERG	12 292 702,08	275 971 161,67 €
FIDELITY FDS EMERG	24 907 495,98	324 039 464,72 €
FIDELITY FUNDS HIGH	18 991 366,86	198 893 202,55 €
FIRST STATE WORLDW	3 340 000,00	6 084 144,00 €
FISHER EMERG MRKTS	1 751 021,23	235 197 171,34 €
FRANK TEMP INV EMKT	18 803 140,54	439 099 236,74 €
GAM MULTIBD	1 651 177,54	477 664 711,29 €
GROUPAMA CASH 4DEC	3 582,56	144 552 767,97 €
HSBC GIF GL	2 439 467,52	80 601 506,32 €
JANUS HANDE GL C FU	7 900 000,00	15 973 800,00 €
JANUS HEND GL C FUND	723 377,43	79 592 985,88 €
JUPITER ECOLOGY CL.I	3 280 000,00	15 348 693,97 €
KBI INST WATER H	775 000,00	14 815 675,00 €
LYXOR WORLD WATER	275 000,00	9 542 390,00 €
MULTIPART ROBECO	526 000,00	14 396 620,00 €
NEUBER BERGMAN	19 363 642,54	356 932 777,53 €
PARVEST ENVIRT OPPO	104 000,00	19 917 040,00 €
PICTET CLEAN ENERG	220 500,00	18 030 285,00 €
PICTET FUND LUX	1 279 147,61	217 325 602,64 €

PICTET FUNDS LUX -EM	243 515,28	87 311 866,03 €
PICTET WATER CL.I	29 900,00	9 642 451,00 €
PIMCO EMERGING	10 756 526,00	122 009 625,32 €
QUONIAM-EM MKT EQUIT	219 608,41	273 357 562,12 €
SCHRODER INTL FUND	904 860,08	153 543 318,37 €
SCHRODER SICAV	1 045 000,00	18 009 634,50 €
SCHRODERS INTL EMERG	22 818 132,62	431 411 024,38 €
SPARINVEST ETHICAL	79 500,00	13 944 300,00 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2 182 601,19	250 586 077,89 €
TOBAM A/B EM MK EQ-A	18 870,94	181 869 835,78 €
UNION + SI.3DEC	7 665,00	1 463 912 135,70 €
VONTOBEL NEW POWER I	110 000,00	11 720 500,00 €

FONDS D'ACTIFS NON-COTES

Engagement global de la poche	1 336 149 944 €
--------------------------------------	------------------------

Libellé des fonds	
ANTIN INFRASTRUCT. A	
AXA SEC. FUND IV LP	
FPS IMMO DURABLE	
LP ACCESS CAPITAL PA	
MERIDIAM TRANSIT A	
NEUBERGER BERMAN EUR	
PANTHEON FRR EUROPE	
CAPENERGIE 3 A	
CAPENERGIE 3 B	
QUAERO EUR INFRA	

FONDS DE DETTES - FONDS COLLECTIFS

Engagement global de la poche	930 730 000 €
--------------------------------------	----------------------

Libellé des fonds	
BNPP FPS FPE I PLU	
CM FUND 2	
CMCIC PR VRN FCT	
FCT CEREAL DETTE	
FCT IDINVEST 2	
FCT NOVO 1	
FCT NOVO 2	
FCT SP EUROCREANCES	
IDINVEST FCT 24	
IDS 3 FCT	
NOVI 1	
NOVI 2	
TIKEHAU CLL EURIB 28	

FONDS DE DETTES - FONDS DEDIES

Engagement global de la poche	650 000 000 €
--------------------------------------	----------------------

Libellé des fonds

FCP BNPP AM FRR DETT FCT SPG DETTE PRIVE FPS IDINVEST FRR LYXOR FRR DETTE PRIV TRUFFLE INNOV FRR FR	
---	--

FONDS DE CAPITAL INVESTISSEMENT - FONDS DEDIES

Engagement global de la poche	250 000 000 €
--------------------------------------	----------------------

Libellé des fonds

FPS ARD FF FRR A SWEN FDS DE FDS A	
---------------------------------------	--